

【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

【提出日】 平成27年12月28日

【発行者名】 大和住銀投信投資顧問株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 多田 正己

【本店の所在の場所】 東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

【事務連絡者氏名】 ディスクロージャー部
植松 克彦

【電話番号】 03-6205-0200

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】 グローバル資産分散オープン

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

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年6月26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。）の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正箇所および訂正事項】

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

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

1

投資信託証券への投資を通じて、先進国から新興国までの幅広い地域の債券、株式、REIT(不動産投資信託)およびコモディティ等へ実質的に分散投資し、安定した利子・配当収益の確保とともに、信託財産の中長期的な成長を目指します。

(以下略)

- 投資信託証券への投資は、主に前記の当該資産クラスを主要投資対象とする以下の投資信託証券（以下「指定投資信託証券」といいます。）の中から行います。

<当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券>

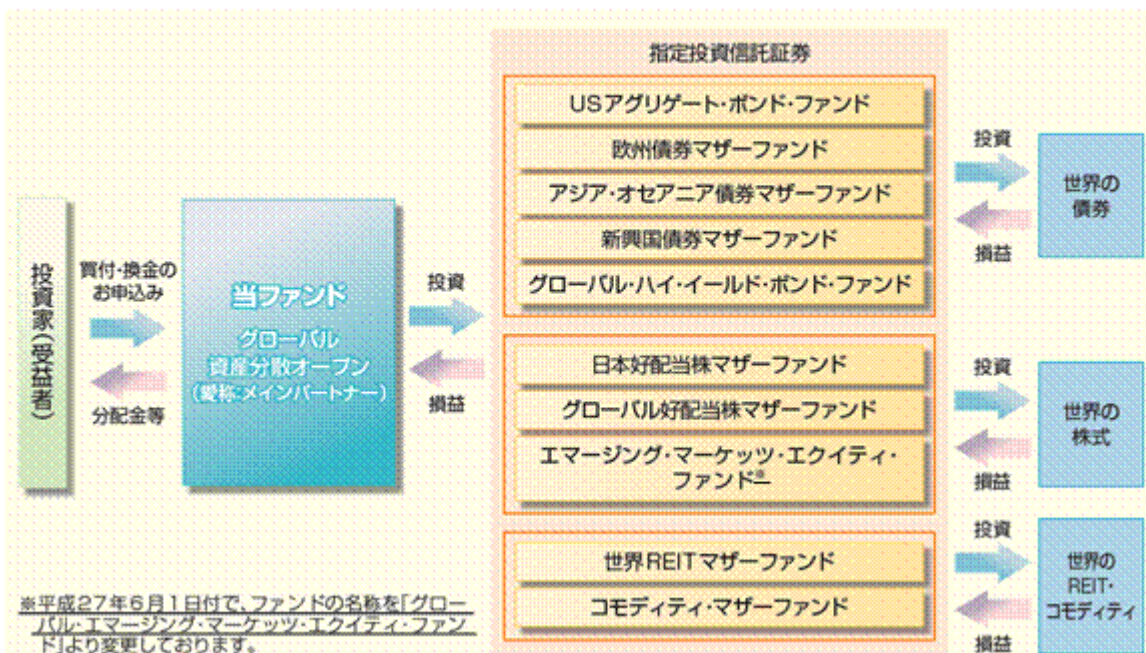
資産	地域・種類	指定投資信託証券
債券	米国債券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund(以下、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」)
	欧州債券	欧州債券マザーファンド
	アジア・オセアニア債券	アジア・オセアニア債券マザーファンド
	新興国債券	新興国債券マザーファンド
	ハイ・イールド債券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund(以下、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」)
株式	日本株式	日本好配当株マザーファンド
	先進国株式	グローバル好配当株マザーファンド
	新興国株式	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund(以下、「エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」) [※]
REIT・コモディティ	世界REIT	世界REITマザーファンド
	コモディティ	コモディティ・マザーファンド

*平成27年6月1日付で、ファンドの名称を「T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund(グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド)」より変更しております。

※上記の指定投資信託証券の全てに投資することを約束するものではありません。

(以下略)

当ファンドの運用の仕組み



※平成27年6月1日付で、ファンドの名称を「グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」より変更しております。

(以下略)

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成27年4月末現在）

(以下略)

<訂正後>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

1 投資信託証券への投資を通じて、先進国から新興国までの幅広い地域の債券、株式、REIT(不動産投資信託)およびコモディティ等へ実質的に分散投資し、安定した利子・配当収益の確保とともに、信託財産の中長期的な成長を目指します。

(以下略)

- 投資信託証券への投資は、主に前記の当該資産クラスを主要投資対象とする以下の投資信託証券(以下「指定投資信託証券」といいます。)の中から行います。

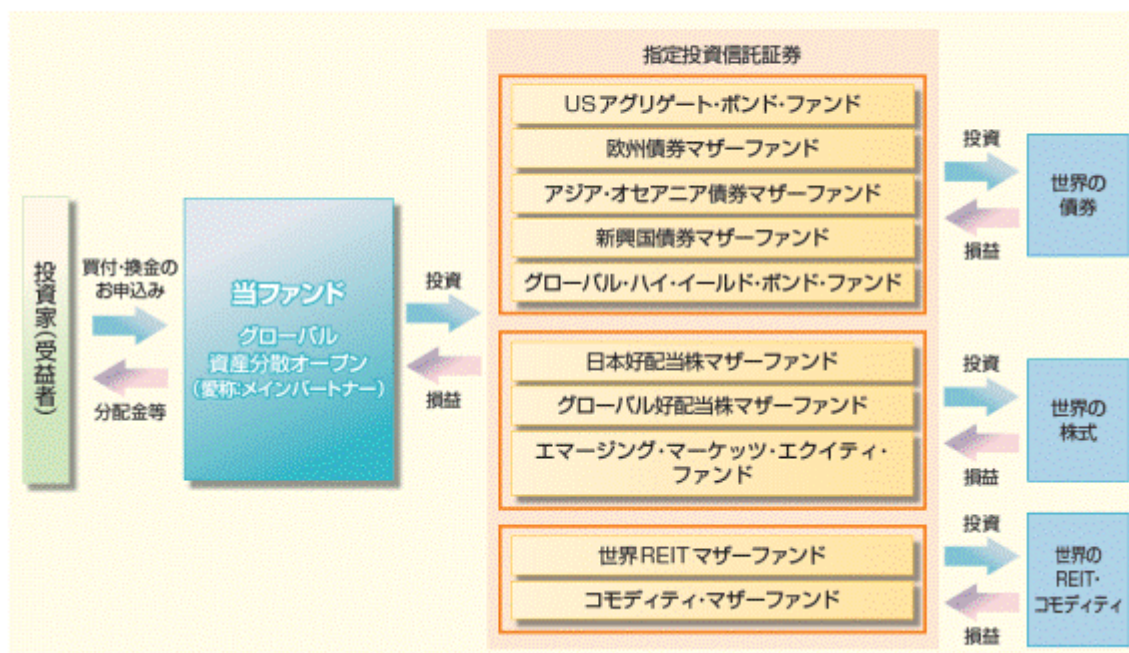
<当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券>

資産	地域・種類	指定投資信託証券
債券	米国債券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund(以下、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」)
	欧州債券	欧州債券マザーファンド
	アジア・オセアニア債券	アジア・オセアニア債券マザーファンド
	新興国債券	新興国債券マザーファンド
	ハイ・イールド債券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund(以下、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」)
株式	日本株式	日本好配当株マザーファンド
	先進国株式	グローバル好配当株マザーファンド
	新興国株式	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund(以下、「エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」)
REIT・コモディティ	世界REIT	世界REITマザーファンド
	コモディティ	コモディティ・マザーファンド

※上記の指定投資信託証券の全てに投資することを約束するものではありません。

(以下略)

当ファンドの運用の仕組み



(以下略)

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成27年10月末現在）

(以下略)

2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 投資方針

投資信託証券への投資を通じて、先進国から新興国までの幅広い地域の債券、株式、REIT（不動産投資信託）およびコモディティ等へ実質的に分散投資し、安定した利子・配当収益の確保とともに、信託財産の中長期的な成長を目指します。

(以下略)

投資信託証券への投資は、主に以下の指定投資信託証券（投資対象ファンド）の中から行います。

資産	地域・種類	指定投資信託証券
債券	米国債券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund（以下、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」）
	欧州債券	欧州債券マザーファンド
	アジア・オセアニア債券	アジア・オセアニア債券マザーファンド
	新興国債券	新興国債券マザーファンド
	ハイ・イールド債券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund（以下、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」）
株式	日本株式	日本好配当株マザーファンド
	先進国株式	グローバル好配当株マザーファンド
	新興国株式	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund（以下、「エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」） [*]
REIT・コモディティ	世界REIT	世界REITマザーファンド
	コモディティ	コモディティ・マザーファンド

*平成27年6月1日付で、ファンドの名称を「T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund（グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド）」より変更しております。

上記の指定投資信託証券の全てに投資することを約束するものではありません。

(以下略)

(2) 投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要

(以下略)

指定投資信託証券の概要は、平成27年4月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。今後、指定投資信託証券の各運用会社の都合等により、記載内容が変更になることがあります。また、今後繰上償還などにより指定投資信託証券から除外される場合や、以下に記載した投資信託証券以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加される場合があります。運用プロセスは、実質的に運用を行う会社のものであり、将来運用プロセスは見直される場合があります。

(以下略)

8. T.Rowe Price Funds SICAV – Emerging Markets Equity Fund^{*}

* 平成27年6月1日付で、ファンドの名称を「T.Rowe Price Funds SICAV – Global Emerging Markets Equity Fund」より変更しております。

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

(3) 運用体制

(以下略)

* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成27年4月末現在で約100名です。

(以下略)

< 訂正後 >

(1) 投資方針

投資信託証券への投資を通じて、先進国から新興国までの幅広い地域の債券、株式、REIT（不動産投資信託）およびコモディティ等へ実質的に分散投資し、安定した利子・配当収益の確保とともに、信託財産の中長期的な成長を目指します。

(以下略)

投資信託証券への投資は、主に以下の指定投資信託証券（投資対象ファンド）の中から行います。

資産	地域・種類	指定投資信託証券
債券	米国債券	T.Rowe Price Funds SICAV – U.S. Aggregate Bond Fund（以下、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」）
	欧州債券	欧州債券マザーファンド
	アジア・オセアニア債券	アジア・オセアニア債券マザーファンド
	新興国債券	新興国債券マザーファンド
	ハイ・イールド債券	T.Rowe Price Funds SICAV – Global High Yield Bond Fund（以下、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」）
株式	日本株式	日本好配当株マザーファンド
	先進国株式	グローバル好配当株マザーファンド
	新興国株式	T.Rowe Price Funds SICAV – Emerging Markets Equity Fund（以下、「エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」）
REIT・コモディティ	世界REIT	世界REITマザーファンド
	コモディティ	コモディティ・マザーファンド

上記の指定投資信託証券の全てに投資することを約束するものではありません。

(以下略)

(2) 投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要

(以下略)

指定投資信託証券の概要は、平成27年10月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。今後、指定投資信託証券の各運用会社の都合等により、記載内容が変更になることがあります。また、今後繰上償還などにより指定投資信託証券から除外される場合や、以下に記載した投資信託証券以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加される場合があります。運用プロセスは、実質的に運用を行う会社のものであり、将来運用プロセスは見直される場合があります。

(以下略)

8 . T.Rowe Price Funds SICAV – Emerging Markets Equity Fund

< 指定投資信託証券の概要 >

（以下略）

(3) 運用体制

（以下略）

* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成27年10月末現在で約100名です。

（以下略）

[次へ](#)

3 投資リスク

<参考情報>

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

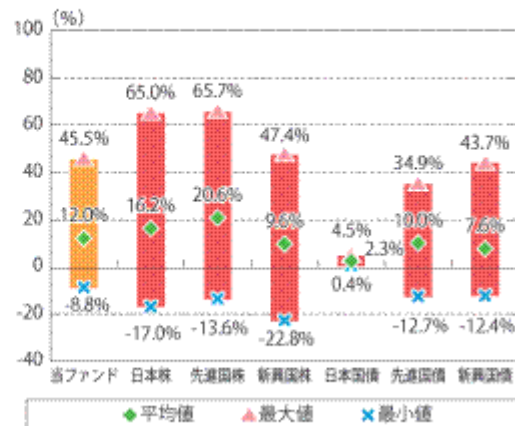
(2010年11月～2015年10月)



※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。
 ※年間騰落率および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ものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2010年11月～2015年10月)



※上記グラフは、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものであり、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
 ※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ものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX(配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み,円ベース)	MSCI Inc.
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,円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村證券株式会社
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本,円ベース)	Citigroup Index LLC
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

(注) 上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

個人の受益者に対する課税

(以下略)

< 損益通算について >

解約時および償還時の譲渡損失（または譲渡益）については、上場株式等の譲渡益（または譲渡損失）との相殺が可能です。当該相殺後の譲渡損失については、確定申告により、申告分離課税を選択した場合の上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

また、源泉徴収選択口座内においても、解約時および償還時の譲渡損失（または譲渡益）については、上場株式等の譲渡益（または譲渡損失）と相殺され、当該相殺後の譲渡損失については、上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について >

公募株式投資信託は税法上、平成26年1月1日以降の少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万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。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

(以下略)

* 上記の内容は平成27年4月末現在のもので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

< 訂正後 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

個人の受益者に対する課税

(以下略)

< 損益通算について >

解約時および償還時の譲渡損失（または譲渡益）については、上場株式等の譲渡益（または譲渡損失）との相殺が可能です。当該相殺後の譲渡損失については、確定申告により、申告分離課税を選択した場合の上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

また、源泉徴収選択口座内においても、解約時および償還時の譲渡損失（または譲渡益）については、上場株式等の譲渡益（または譲渡損失）と相殺され、当該相殺後の譲渡損失については、上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等が追加される予定です。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円¹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。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、満20歳以上の方²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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

1 平成28年1月1日以降、年間120万円となる予定です。

2 20歳未満の方を対象とした「ジュニアNISA」が開始され、平成28年1月1日から口座開設が可能となり、平成28年4月1日から公募株式投資信託などの購入が可能となる予定です。

法人の受益者に対する課税

(以下略)

* 上記の内容は平成27年10月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

[前へ](#) [次へ](#)

5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

グローバル資産分散オープン

(1) 投資状況

（平成27年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （世界REITマザーファンド）	日本	2,129,607,213	15.55%
親投資信託受益証券 （グローバル好配当株マザーファンド）	日本	2,111,812,171	15.42%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	1,378,125,928	10.06%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	1,345,552,652	9.82%
親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド）	日本	1,344,775,274	9.82%
親投資信託受益証券 （アジア・オセアニア債券マザーファンド）	日本	1,302,465,948	9.51%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	658,286,393	4.81%
投資証券	ルクセンブルグ	3,308,211,243	24.15%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		119,732,172	0.87%
純資産総額		13,698,568,994	100.00%

（注）投資比率は、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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成27年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,859,107,127	1.0786 2,005,418,857	1.1455 2,129,607,213	- -	15.55%
2	グローバル好配当株マザーファン ド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,175,645,589	1.6915 1,988,722,078	1.7963 2,111,812,171	- -	15.42%
3	日本好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	942,115,073	1.3647 1,285,798,651	1.4628 1,378,125,928	- -	10.06%
4	T.Rowe Price Funds SICAV- Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,174,723	1,143 1,343,565,316	1,147 1,347,808,067	- -	9.84%
5	欧州債券マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,015,818,098	1.3204 1,341,387,798	1.3246 1,345,552,652	- -	9.82%
6	新興国債券マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	644,574,258	2.0310 1,309,194,775	2.0863 1,344,775,274	- -	9.82%
7	アジア・オセアニア債券マザー ファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	946,421,994	1.3262 1,255,144,849	1.3762 1,302,465,948	- -	9.51%
8	T.Rowe Price Funds SICAV- U.S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	992,339	1,305 1,295,730,404	1,308 1,298,117,465	- -	9.48%
9	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	831,253	748 622,086,274	796 662,285,710	- -	4.83%
10	コモディティ・マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,157,528,386	0.5803 671,829,475	0.5687 658,286,393	- -	4.81%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	74.98%
投資証券	24.15%
合計	99.13%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成19年5月22日）	3,000	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成19年9月27日）	136,194	136,891	0.9696	0.9746
第2特定期間末 （平成20年3月27日）	111,903	114,044	0.8028	0.8178
第3特定期間末 （平成20年9月29日）	91,800	93,739	0.7555	0.7705
第4特定期間末 （平成21年3月27日）	58,671	60,384	0.5357	0.5507
第5特定期間末 （平成21年9月28日）	55,505	56,379	0.6138	0.6228
第6特定期間末 （平成22年3月29日）	48,227	48,936	0.6584	0.6674
第7特定期間末 （平成22年9月27日）	37,347	37,927	0.6243	0.6333
第8特定期間末 （平成23年3月28日）	30,336	30,802	0.6301	0.6391
第9特定期間末 （平成23年9月27日）	22,105	22,491	0.5447	0.5537
第10特定期間末 （平成24年3月27日）	21,940	22,270	0.6349	0.6439
第11特定期間末 （平成24年9月27日）	18,250	18,537	0.6003	0.6093
第12特定期間末 （平成25年3月27日）	20,561	20,815	0.7552	0.7642
第13特定期間末 （平成25年9月27日）	19,577	19,807	0.7823	0.7913
第14特定期間末 （平成26年3月27日）	18,487	18,698	0.8172	0.8262
第15特定期間末 （平成26年9月29日）	17,485	17,674	0.8784	0.8874
平成26年10月末日	17,328	-	0.8821	-
平成26年11月末日	17,591	-	0.9504	-
平成26年12月末日	16,986	-	0.9488	-
平成27年1月末日	16,469	-	0.9327	-
平成27年2月末日	16,421	-	0.9546	-
第16特定期間末 （平成27年3月27日）	15,877	16,036	0.9468	0.9558
平成27年3月末日	15,939	-	0.9522	-
平成27年4月末日	15,792	-	0.9641	-
平成27年5月末日	15,882	-	0.9853	-
平成27年6月末日	14,989	-	0.9551	-
平成27年7月末日	14,720	-	0.9573	-
平成27年8月末日	13,729	-	0.9085	-
第17特定期間末 （平成27年9月28日）	13,386	13,526	0.8891	0.8981
平成27年9月末日	13,198	-	0.8771	-
平成27年10月末日	13,698	-	0.9204	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金（円）
第1特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日）	0.0050
第2特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日）	0.0150
第3特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日）	0.0150
第4特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日）	0.0150

第5特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日）	0.0090
第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日）	0.0090
第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日）	0.0090
第8特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	0.0090
第9特定期間（平成23年3月29日～平成23年9月27日）	0.0090
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	0.0090
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24年9月27日）	0.0090
第12特定期間（平成24年9月28日～平成25年3月27日）	0.0090
第13特定期間（平成25年3月28日～平成25年9月27日）	0.0090
第14特定期間（平成25年9月28日～平成26年3月27日）	0.0090
第15特定期間（平成26年3月28日～平成26年9月29日）	0.0090
第16特定期間（平成26年9月30日～平成27年3月27日）	0.0090
第17特定期間（平成27年3月28日～平成27年9月28日）	0.0090

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日）	2.5%
第2特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日）	15.7%
第3特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日）	4.0%
第4特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日）	27.1%
第5特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日）	16.3%
第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日）	8.7%
第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日）	3.8%
第8特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	2.4%
第9特定期間（平成23年3月29日～平成23年9月27日）	12.1%
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	18.2%
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24年9月27日）	4.0%
第12特定期間（平成24年9月28日～平成25年3月27日）	27.3%
第13特定期間（平成25年3月28日～平成25年9月27日）	4.8%
第14特定期間（平成25年9月28日～平成26年3月27日）	5.6%
第15特定期間（平成26年3月28日～平成26年9月29日）	8.6%
第16特定期間（平成26年9月30日～平成27年3月27日）	8.8%
第17特定期間（平成27年3月28日～平成27年9月28日）	5.1%

（注）収益率 = (当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配付基準価額) ÷ 前特定期末分配付基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日）	143,915,193,041	3,444,616,817
第2特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日）	9,456,550,153	10,531,107,727
第3特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日）	1,210,147,834	19,101,436,301
第4特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日）	1,032,078,680	13,023,015,618
第5特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日）	723,370,575	19,813,830,702
第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日）	420,700,426	17,593,714,515
第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日）	337,246,711	13,762,458,300
第8特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	273,981,316	11,950,617,466
第9特定期間（平成23年3月29日～平成23年9月27日）	225,487,243	7,789,551,735
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	219,834,307	6,245,534,761
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24年9月27日）	180,413,715	4,336,327,069
第12特定期間（平成24年9月28日～平成25年3月27日）	155,641,899	3,332,778,933
第13特定期間（平成25年3月28日～平成25年9月27日）	122,052,475	2,320,663,987
第14特定期間（平成25年9月28日～平成26年3月27日）	148,600,281	2,554,485,378
第15特定期間（平成26年3月28日～平成26年9月29日）	88,632,209	2,802,199,202
第16特定期間（平成26年9月30日～平成27年3月27日）	108,314,639	3,246,153,487
第17特定期間（平成27年3月28日～平成27年9月28日）	53,274,974	1,766,917,163

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

(参考) マザーファンドの運用状況

日本好配当株マザーファンド

(1) 投資状況

（平成27年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
株式	日本	24,487,972,170	94.34%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,468,947,262	5.66%
純資産総額		25,956,919,432	100.00%

（注）投資比率は、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。

その他の資産の投資状況
(平成27年10月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	買建/ 売建	時価合計(円)	投資比率
株価指数先物	日本	買建	1,293,555,000	4.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成27年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,838,400	768.80 1,413,361,920	790.60 1,453,439,040	- -	5.60%
2	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	178,500	7,349.00 1,311,796,500	7,469.00 1,333,216,500	- -	5.14%
3	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,331,600	236.20 786,923,920	250.30 833,899,480	- -	3.21%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	160,500	4,244.00 681,162,000	4,486.00 720,003,000	- -	2.77%
5	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	134,100	3,937.00 527,951,700	4,211.00 564,695,100	- -	2.18%
6	西日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	63,800	7,927.00 505,742,600	8,530.00 544,214,000	- -	2.10%
7	HOYA 日本	株式 精密機器	106,700	4,378.00 467,132,600	5,029.00 536,594,300	- -	2.07%
8	KDDI 日本	株式 情報・通信業	172,500	2,757.60 475,686,696	2,946.00 508,185,000	- -	1.96%
9	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	110,400	4,255.00 469,752,000	4,476.00 494,150,400	- -	1.90%
10	アズビル 日本	株式 電気機器	153,000	2,904.00 444,312,000	3,070.00 469,710,000	- -	1.81%
11	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	351,300	1,191.64 418,623,943	1,266.50 444,921,450	- -	1.71%
12	日本航空 日本	株式 空運業	94,800	4,155.00 393,894,000	4,580.00 434,184,000	- -	1.67%
13	キヤノン 日本	株式 電気機器	110,900	3,614.00 400,792,600	3,640.00 403,676,000	- -	1.56%
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	84,700	4,545.00 384,961,500	4,692.00 397,412,400	- -	1.53%
15	青山商事 日本	株式 小売業	80,700	4,015.00 324,010,500	4,430.00 357,501,000	- -	1.38%
16	野村不動産ホールディングス 日本	株式 不動産業	133,000	2,422.00 322,126,000	2,599.00 345,667,000	- -	1.33%
17	センコー 日本	株式 陸運業	408,000	881.00 359,448,000	841.00 343,128,000	- -	1.32%
18	MS&ADインシュアランスグループホールディングス 日本	株式 保険業	86,600	3,306.00 286,299,600	3,592.00 311,067,200	- -	1.20%
19	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	204,100	1,440.39 293,984,601	1,524.00 311,048,400	- -	1.20%
20	オリックス 日本	株式 その他金融業	173,100	1,736.00 300,501,600	1,781.50 308,377,650	- -	1.19%
21	高砂熱学工業 日本	株式 建設業	176,000	1,611.00 283,536,000	1,743.00 306,768,000	- -	1.18%
22	三菱商事 日本	株式 卸売業	137,500	2,209.20 303,765,819	2,212.50 304,218,750	- -	1.17%
23	関電工 日本	株式 建設業	351,000	811.00 284,661,000	858.00 301,158,000	- -	1.16%
24	三井住友トラスト・ホールディングス 日本	株式 銀行業	613,000	456.90 280,079,700	467.70 286,700,100	- -	1.10%
25	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	70,300	3,730.00 262,219,000	4,044.00 284,293,200	- -	1.10%
26	ソニーフィナンシャルホールディングス 日本	株式 保険業	130,000	2,106.00 273,780,000	2,184.00 283,920,000	- -	1.09%
27	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	68,000	3,849.00 261,732,000	4,044.00 274,992,000	- -	1.06%
28	武田薬品工業	株式	46,100	5,423.00	5,930.00	-	1.05%

	日本	医薬品		250,000,300	273,373,000	-	
29	カシオ計算機 日本	株式 電気機器	117,000	2,249.00 263,133,000	2,292.00 268,164,000	-	1.03%
30	住友商事 日本	株式 卸売業	200,500	1,230.00 246,615,000	1,330.50 266,765,250	-	1.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
株式	94.34%
合計	94.34%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種別	投資比率
(国内)	
銀行業	12.33%
輸送用機器	10.51%
電気機器	7.23%
卸売業	6.98%
情報・通信業	6.36%
建設業	6.17%
保険業	4.32%
化学	3.47%
陸運業	3.42%
機械	3.42%
非鉄金属	2.70%
小売業	2.62%
医薬品	2.45%
食料品	2.18%
その他金融業	2.14%
不動産業	2.11%
精密機器	2.07%
ゴム製品	1.90%
電気・ガス業	1.83%
空運業	1.67%
証券、商品先物取引業	1.27%
石油・石炭製品	1.23%
鉄鋼	1.18%
サービス業	1.04%
ガラス・土石製品	0.94%
倉庫・運輸関連業	0.88%
繊維製品	0.83%
その他製品	0.69%
水産・農林業	0.31%
金属製品	0.09%
小計	94.34%
合計	94.34%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成27年10月末現在）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資 比率
株価指数先物	日本	TOPIX 先物 2712月	買建	83	1,231,720,000	1,293,555,000	4.98%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

世界REITマザーファンド

(1) 投資状況

（平成27年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
---------	-------	---------	------

投資証券	アメリカ	617,722,019	29.01%
	イギリス	372,166,216	17.48%
	オーストラリア	322,047,954	15.12%
	日本	278,900,000	13.10%
	フランス	191,139,670	8.98%
	シンガポール	98,502,456	4.63%
	カナダ	93,371,593	4.38%
	オランダ	42,199,943	1.98%
	ベルギー	36,285,358	1.70%
	ドイツ	11,999,745	0.56%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		65,237,990	3.06%
純資産総額		2,129,572,944	100.00%

(注) 投資比率は、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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成27年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	7,452	23,291 173,567,401	24,710 184,144,516	- -	8.65%
2	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	16,496	9,490 156,557,762	9,447 155,839,790	- -	7.32%
3	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券 -	71,415	1,567 111,941,044	1,612 115,184,753	- -	5.41%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券 -	3,377	33,143 111,925,869	34,026 114,909,064	- -	5.40%
5	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券 -	69,182	1,244 86,124,246	1,193 82,597,192	- -	3.88%
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券 -	10,131	9,357 94,802,453	8,094 82,002,897	- -	3.85%
7	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券 -	25,565	2,335 59,717,641	2,487 63,604,027	- -	2.99%
8	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資証券 -	61,792	839 51,900,763	872 53,919,421	- -	2.53%
9	ICADE フランス	投資証券 -	6,020	11,043 66,481,838	8,897 53,563,691	- -	2.52%
10	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券 -	145,084	328 47,646,369	357 51,887,145	- -	2.44%
11	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券 -	88	603,000 53,064,000	575,000 50,600,000	- -	2.38%
12	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券 -	3,400	16,975 57,716,934	14,844 50,469,946	- -	2.37%
13	SEGRO PLC イギリス	投資証券 -	59,374	785 46,660,139	838 49,808,240	- -	2.34%
14	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	107,000	392 41,946,482	410 43,878,228	- -	2.06%
15	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D アメリカ	投資証券 -	13,825	3,159 43,674,792	3,037 41,986,635	- -	1.97%
16	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 -	58,900	650 38,331,701	669 39,445,701	- -	1.85%
17	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券 -	233	193,200 45,015,600	168,100 39,167,300	- -	1.84%
18	DERWENT LONDON PLC イギリス	投資証券 -	5,478	6,433 35,240,154	7,141 39,119,618	- -	1.84%
19	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	111,538	391 43,629,594	349 39,026,911	- -	1.83%
20	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券 -	9,000	4,316 38,848,192	4,150 37,354,473	- -	1.75%
21	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資証券 -	100,700	374 37,745,300	362 36,533,295	- -	1.72%
22	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT シンガポール	投資証券 -	164,005	220 36,142,034	209 34,307,353	- -	1.61%
23	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券 -	60	585,000 35,100,000	560,000 33,600,000	- -	1.58%
24	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券 -	60	666,000 39,960,000	555,000 33,300,000	- -	1.56%

25	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	206,000	173 35,773,836	155 32,054,774	-	1.51%
26	EUROCOMMERCIAL オランダ	投資証券 -	5,355	5,636 30,182,483	5,824 31,189,499	-	1.46%
27	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT カナダ	投資証券 -	9,167	3,627 33,252,627	3,355 30,757,627	-	1.44%
28	産業ファンド投資法人 日本	投資証券 -	54	570,000 30,780,000	548,000 29,592,000	-	1.39%
29	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券 -	2,233	13,331 29,769,558	12,174 27,185,948	-	1.28%
30	日本アコモデーションファンド 投資法人 日本	投資証券 -	64	459,500 29,408,000	417,500 26,720,000	-	1.25%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資証券	96.94%
合計	96.94%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成27年10月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(平成27年10月末現在)

該当事項はありません。

グローバル好配当株マザーファンド

(1) 投資状況

(平成27年10月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
株式	アメリカ	26,294,378,159	28.90%
	イギリス	9,885,800,347	10.87%
	オーストラリア	7,275,737,584	8.00%
	日本	5,339,533,650	5.87%
	フランス	4,893,204,493	5.38%
	スイス	3,903,971,178	4.29%
	香港	3,796,433,940	4.17%
	オランダ	3,771,637,004	4.15%
	ケイマン諸島	3,044,638,987	3.35%
	台湾	2,920,408,371	3.21%
	シンガポール	2,759,555,681	3.03%
	カナダ	1,888,041,201	2.08%
	韓国	1,826,070,300	2.01%
	フィンランド	1,000,434,764	1.10%
	パナマ	998,655,665	1.10%
	オランダ領アンチル	996,171,254	1.09%
	イタリア	987,109,597	1.08%
	スペイン	909,959,575	1.00%
	ノルウェー	844,972,005	0.93%
	スウェーデン	837,818,467	0.92%
中国	608,353,200	0.67%	
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,196,558,254	6.81%
純資産総額		90,979,443,676	100.00%

(注) 投資比率は、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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成27年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	143,860	8,076 1,161,830,623	7,883 1,134,176,271	-	1.25%

2	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST 香港	株式 不動産	2,870,000	380	394	-	1.25%
				1,091,402,943	1,132,731,600	-	
3	RECKITT BENCKISER GROUP PLC イギリス	株式 家庭用品・パーソナル用品	94,600	10,287	11,898	-	1.24%
				973,177,738	1,125,582,036	-	
4	日本航空 日本	株式 空運業	243,900	4,118.91	4,580.00	-	1.23%
				1,004,602,426	1,117,062,000	-	
5	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 自動車・自動車部品	16,935,000	53	65	-	1.21%
				910,970,009	1,101,655,620	-	
6	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	101,350	11,294	10,867	-	1.21%
				1,144,727,224	1,101,441,496	-	
7	BRISTOL MYERS-SQUIBB アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	134,770	8,198	8,137	-	1.21%
				1,104,942,786	1,096,728,475	-	
8	WELLS FARGO & COMPANY アメリカ	株式 銀行	163,200	6,800	6,660	-	1.19%
				1,109,862,000	1,086,974,179	-	
9	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバコ	148,100	6,418	7,212	-	1.17%
				950,535,686	1,068,185,756	-	
10	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	32,500	31,806	32,796	-	1.17%
				1,033,722,560	1,065,902,240	-	
11	STARBUCKS CORP アメリカ	株式 消費者サービス	140,990	6,573	7,556	-	1.17%
				926,859,448	1,065,355,687	-	
12	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	4,243,000	235.44	250.30	-	1.17%
				998,980,807	1,062,022,900	-	
13	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	85,120	12,027	12,255	-	1.15%
				1,023,819,878	1,043,199,480	-	
14	UNILEVER NV-CVA オランダ	株式 家庭用品・パーソナル用品	188,900	4,893	5,522	-	1.15%
				924,443,655	1,043,135,797	-	
15	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD ケイマン諸島	株式 耐久消費財・アパレル	3,069,000	302	337	-	1.14%
				927,102,643	1,036,524,060	-	
16	ORANGE フランス	株式 電気通信サービス	488,300	1,987	2,121	-	1.14%
				970,308,609	1,035,906,378	-	
17	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	139,180	6,266	7,438	-	1.14%
				872,220,805	1,035,356,818	-	
18	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	95,720	9,975	10,791	-	1.14%
				954,812,083	1,032,965,634	-	
19	NORTHROP GRUMMAN CORP アメリカ	株式 資本財	44,910	20,123	22,979	-	1.13%
				903,724,818	1,032,007,683	-	
20	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	254,500	3,982.88	4,044.00	-	1.13%
				1,013,644,429	1,029,198,000	-	
21	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	395,250	2,481	2,602	-	1.13%
				980,791,195	1,028,786,580	-	
22	アズビル 日本	株式 電気機器	331,800	3,017.06	3,070.00	-	1.12%
				1,001,060,667	1,018,626,000	-	
23	TOTAL SA フランス	株式 エネルギー	172,230	5,511	5,888	-	1.11%
				949,222,803	1,014,227,541	-	
24	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバコ	153,710	5,756	6,525	-	1.10%
				884,755,497	1,003,069,650	-	
25	SAMPO OYJ-A SHS フィンランド	株式 保険	167,470	5,575	5,973	-	1.10%
				933,694,620	1,000,434,764	-	
26	CARNIVAL CORP パナマ	株式 消費者サービス	152,740	6,069	6,538	-	1.10%
				927,006,553	998,655,665	-	
27	SCHLUMBERGER LTD イギリス	株式	104,710	8,811	9,513	-	1.09%

	オランダ領アンチル	エネルギー		922,660,424	996,171,254	-	
28	SNAM SPA イタリア	株式 公益事業	1,590,500	558 887,807,048	620 987,109,597	-	1.08%
29	ACCOR SA フランス	株式 消費者サービス	160,590	5,718 918,265,897	6,117 982,374,316	-	1.08%
30	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	65,720	13,589 893,079,595	14,946 982,308,099	-	1.08%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
株式	93.19%
合計	93.19%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種別	投資比率
（国内）	
空運業	1.23%
銀行業	1.17%
医薬品	1.13%
電気機器	1.12%
情報・通信業	1.06%
サービス業	0.16%
小計	5.87%
（海外）	
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.71%
銀行	9.42%
電気通信サービス	8.18%
食品・飲料・タバコ	7.64%
公益事業	5.14%
エネルギー	5.12%
消費者サービス	4.34%
保険	4.17%
資本財	4.16%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.89%
耐久消費財・アパレル	3.25%
素材	3.06%
家庭用品・パーソナル用品	2.38%
不動産	2.24%
半導体・半導体製造装置	2.24%
自動車・自動車部品	2.17%
各種金融	2.09%
食品・生活必需品小売り	2.07%
ヘルスケア機器・サービス	2.01%
メディア	1.97%
小売	1.08%
ソフトウェア・サービス	1.00%
小計	87.32%
合計	93.19%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

新興国債券マザーファンド

（1）投資状況

（平成27年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
---------	-------	---------	------

国債証券	メキシコ	928,527,344	7.34%
	セルビア	693,151,860	5.48%
	アルゼンチン	639,923,204	5.06%
	コロンビア	546,407,550	4.32%
	トルコ	486,124,110	3.84%
	ジャマイカ	384,265,647	3.04%
	ドミニカ共和国	331,672,526	2.62%
	南アフリカ	324,144,990	2.56%
	インドネシア	322,288,268	2.55%
	ブラジル	269,914,992	2.13%
	コートジボアール	250,652,358	1.98%
	パキスタン	236,464,652	1.87%
	クロアチア	194,376,702	1.54%
	ハンガリー	191,876,775	1.52%
	ロシア	172,622,470	1.36%
	モロッコ	168,792,570	1.33%
	エルサルバドル	143,494,698	1.13%
	スリランカ	107,201,425	0.85%
	ウルグアイ	100,830,600	0.80%
	ルーマニア	100,146,526	0.79%
	ベトナム	95,767,308	0.76%
	モンゴル	78,426,669	0.62%
	バハマ	77,799,150	0.62%
	ナミビア	63,429,580	0.50%
	ケニア	56,319,451	0.45%
	ガボン	52,635,265	0.42%
	グルジア	51,769,380	0.41%
	スロヴェニア	40,034,523	0.32%
	バミューダ	38,810,411	0.31%
	ザンビア	31,158,952	0.25%
エジプト	29,351,497	0.23%	
エクアドル	25,237,875	0.20%	
セネガル	22,600,804	0.18%	
コスタリカ	21,852,675	0.17%	
バルバドス	20,734,350	0.16%	
特殊債券	南アフリカ	262,393,713	2.07%
	メキシコ	251,291,439	1.99%
	ロシア	62,032,067	0.49%
	ルクセンブルグ	52,437,231	0.41%
社債券	カザフスタン	477,452,235	3.77%
	オランダ	465,642,547	3.68%
	メキシコ	376,003,019	2.97%
	トルコ	308,049,028	2.44%
	ヴェネズエラ	306,367,491	2.42%
	ケイマン諸島	222,493,055	1.76%
	インド	204,619,804	1.62%
	インドネシア	198,955,095	1.57%
	ルクセンブルグ	138,361,490	1.09%
	フィリピン	127,994,714	1.01%
	アラブ首長国連邦	112,868,134	0.89%
	ブラジル	110,248,710	0.87%
	イギリス領バージン諸島	107,744,145	0.85%
	トリニダード トバゴ	102,523,200	0.81%
	アメリカ	85,204,275	0.67%
	イスラエル	70,059,857	0.55%
	イギリス	62,686,650	0.50%
	シンガポール	47,049,927	0.37%
	コロンビア	40,237,091	0.32%
	モンゴル	36,622,907	0.29%
	パナマ	36,555,299	0.29%
	コスタリカ	33,870,890	0.27%
	アイルランド	25,842,375	0.20%
	ジャージー	24,960,288	0.20%
	ロシア	24,814,725	0.20%
	チリ	24,379,485	0.19%
	バミューダ	23,818,509	0.19%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	925,868,935	7.32%	
純資産総額		12,648,255,487	100.00%

（注）投資比率は、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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成27年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	3,815,000	11,643.41 444,196,131	11,967.40 456,556,592	7.0000 2017/04/17	3.61%
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券 -	2,648,000	12,573.30 332,941,183	12,241.12 324,144,990	4.6650 2024/01/17	2.56%
3	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	2,300,000	13,885.51 319,366,901	13,869.28 318,993,561	7.2500 2021/09/28	2.52%
4	KAZMUNAIGAZ NATIONAL カザフスタン	社債券 -	2,450,000	13,191.78 323,198,797	12,603.82 308,793,712	7.0000 2020/05/05	2.44%
5	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	2,100,000	12,700.25 266,705,400	12,482.92 262,141,425	4.3750 2021/07/12	2.07%
6	MEXICAN FIXED RATE BONDS メキシコ	国債証券 -	27,600,000	930.54 256,830,350	936.76 258,548,122	10.0000 2024/12/05	2.04%
7	IVORY COAST コートジボアール	国債証券 -	2,099,000	11,543.81 242,304,757	10,874.95 228,265,305	5.3750 2024/07/23	1.80%
8	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券 -	1,600,000	12,488.02 199,808,407	12,513.15 200,210,400	4.0000 2023/10/02	1.58%
9	PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ	社債券 -	2,840,000	7,284.22 206,871,990	6,798.20 193,069,078	5.2500 2017/04/12	1.53%
10	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	23,154,000	816.61 189,079,874	819.85 189,830,162	7.7500 2042/11/13	1.50%
11	ISLAMIC REP OF PAKISTAN パキスタン	国債証券 -	1,475,000	12,512.44 184,558,534	12,575.17 185,483,782	6.7500 2019/12/03	1.47%
12	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	1,500,000	11,803.87 177,058,170	12,224.44 183,366,612	8.7500 2024/05/07	1.45%
13	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	1,554,000	12,627.88 196,237,263	11,636.62 180,833,152	6.5000 2041/06/02	1.43%
14	EXPORT-IMPORT BK INDIA インド	社債券 -	1,450,000	12,358.27 179,195,017	12,393.09 179,699,896	4.0000 2023/01/14	1.42%
15	KINGDOM OF MOROCCO モロッコ	国債証券 -	1,375,000	12,434.56 170,975,268	12,275.82 168,792,570	4.2500 2022/12/11	1.33%
16	JAMAICA GOVERNMENT BOND ジャマイカ	国債証券 -	1,238,094	13,125.02 162,500,245	13,048.49 161,552,735	8.5000 2021/11/16	1.28%
17	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証券 -	1,305,000	12,381.13 161,573,782	12,120.22 158,168,936	5.5000 2025/01/27	1.25%
18	TURKEY REP OF トルコ	国債証券 -	987,000	16,109.92 159,004,959	15,582.92 153,803,439	8.0000 2034/02/14	1.22%
19	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	1,200,000	12,553.95 150,647,445	12,629.21 151,550,568	5.2500 2017/11/21	1.20%
20	PERTAMINA PERSERO PT インドネシア	社債券 -	1,450,000	10,267.74 148,882,305	10,333.32 149,833,183	5.6250 2043/05/20	1.18%
21	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	1,400,000	11,637.48 162,924,840	10,696.62 149,752,785	4.2500 2025/01/07	1.18%
22	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	1,140,000	12,785.09 145,750,124	12,864.84 146,659,268	5.8750 2018/12/03	1.16%
23	HUNGARY ハンガリー	国債証券 -	1,070,000	13,722.77 146,833,654	13,672.94 146,300,497	5.7500 2023/11/22	1.16%
24	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO カザフスタン	社債券 -	1,550,000	9,675.31 149,967,382	9,279.07 143,825,662	5.7500 2043/04/30	1.14%
25	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	1,050,000	14,356.87 150,747,187	13,472.24 141,458,621	6.6250 2037/02/17	1.12%
26	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	1,100,000	14,024.40 154,268,400	12,513.15 137,644,650	6.1250 2041/01/18	1.09%
27	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	1,050,000	13,156.29 138,141,125	13,045.83 136,981,271	5.6250 2021/03/30	1.08%
28	HAZINE MUSTESARLIGI VARL トルコ	国債証券 -	1,150,000	12,032.44 138,373,072	11,863.31 136,428,093	4.4890 2024/11/25	1.08%
29	ESKOM HOLDINGS SOC LTD 南アフリカ	特殊債券 -	1,150,000	12,201.68 140,319,381	11,276.94 129,684,896	7.1250 2025/02/11	1.03%
30	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	1,050,000	12,260.46 128,734,924	11,908.65 125,040,825	4.0000 2024/02/26	0.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
国債証券	57.71%
社債券	30.01%
特殊債券	4.97%
合計	92.68%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

欧州債券マザーファンド

(1) 投資状況

（平成27年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
国債証券	イタリア	215,617,675	16.02%
	イギリス	151,278,241	11.24%
	フランス	88,999,476	6.61%
	ドイツ	48,383,144	3.60%
	スペイン	38,058,436	2.83%
	オランダ	37,313,475	2.77%
	スロヴェニア	36,517,603	2.71%
	ベルギー	32,720,723	2.43%
	インドネシア	32,614,070	2.42%
	ルーマニア	31,099,470	2.31%
	アイルランド	29,492,362	2.19%
	ブルガリア	15,581,653	1.16%
	モンテネグロ	15,141,273	1.13%
	イスラエル	14,790,936	1.10%
	クロアチア	14,593,802	1.08%
	キプロス	14,399,145	1.07%
	メキシコ	14,112,124	1.05%
	ポーランド	13,701,304	1.02%
	モロッコ	13,549,680	1.01%
	チリ	13,209,078	0.98%
ロシア	10,367,892	0.77%	
ノルウェー	8,064,331	0.60%	
デンマーク	7,068,404	0.53%	
リトアニア	5,374,334	0.40%	
特殊債券	スペイン	37,124,347	2.76%
	ロシア	13,450,050	1.00%
社債券	フランス	57,875,516	4.30%
	ルクセンブルグ	42,774,480	3.18%
	オーストリア	42,575,884	3.16%
	イタリア	42,216,684	3.14%
	スウェーデン	32,854,007	2.44%
	アイスランド	30,280,545	2.25%
	韓国	22,470,151	1.67%
	イギリス	21,754,077	1.62%
	オランダ	14,278,573	1.06%
	チェコ	13,230,199	0.98%
	メキシコ	12,164,823	0.90%
	アイルランド	7,920,252	0.59%
	デンマーク	7,357,667	0.55%
	ドイツ	5,744,612	0.43%
アメリカ	3,036,908	0.23%	
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		36,431,467	2.71%
純資産総額		1,345,588,873	100.00%

（注）投資比率は、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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成27年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	463,000	12,771.67 59,132,849	13,317.34 61,659,297	1.5000 2025/06/01	4.58%
2	UK GILT イギリス	国債証券 -	217,000	26,370.47 57,223,923	25,030.98 54,317,241	4.2500 2046/12/07	4.04%
3	UK GILT イギリス	国債証券 -	185,000	26,986.38 49,924,818	25,546.37 47,260,786	4.7500 2038/12/07	3.51%
4	HETA ASSET RESOLUTION AG オーストリア	社債券 -	300,000	14,495.50 43,486,502	14,191.96 42,575,884	2.3750 2022/12/13	3.16%
5	DEXIA CREDIT LOCAL フランス	社債券 -	200,000	18,892.16 37,784,335	18,703.99 37,407,994	1.8750 2017/07/17	2.78%
6	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	183,000	21,104.67 38,621,549	20,389.87 37,313,475	5.5000 2028/01/15	2.77%
7	INSTITUT CREDITO OFICIAL スペイン	特殊債券 -	200,000	18,712.33 37,424,679	18,562.17 37,124,347	1.8750 2017/12/15	2.76%
8	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	236,000	14,540.79 34,316,286	14,630.33 34,527,586	3.5000 2018/12/01	2.57%
9	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	190,000	16,287.37 30,946,021	16,751.65 31,828,145	3.5000 2026/04/25	2.37%
10	ROMANIA GOVERNMENT BOND ルーマニア	国債証券	880,000	3,477.19 30,599,322	3,534.03 31,099,470	5.8500 2023/04/26	2.31%
11	ARION BANKI HF アイスランド	社債券 -	225,000	13,117.28 29,513,893	13,458.02 30,280,545	3.1250 2018/03/12	2.25%
12	IRISH GOVT TREASURY アイルランド	国債証券 -	161,000	18,325.27 29,503,697	18,318.23 29,492,362	5.4000 2025/03/13	2.19%
13	UK GILT イギリス	国債証券 -	124,000	23,676.58 29,358,961	23,641.11 29,314,986	5.0000 2025/03/07	2.18%
14	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	164,000	16,989.76 27,863,212	17,391.41 28,521,916	2.5000 2044/07/04	2.12%
15	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	187,000	14,301.97 26,744,691	14,097.91 26,588,497	1.7000 2018/09/15	1.98%
16	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	138,000	18,771.28 25,904,377	18,620.31 25,696,035	5.9000 2026/07/30	1.91%
17	REPUBLIKA SLOVENIJA スロヴェニア	国債証券 -	143,000	18,511.25 26,471,093	17,672.36 25,271,488	5.1250 2026/03/30	1.88%
18	EXPORT-IMPORT BK KOREA 韓国	社債券 -	160,000	14,139.48 22,623,183	14,043.84 22,470,151	2.0000 2020/04/30	1.67%
19	SKANDINAVISKA ENSKILDA スウェーデン	社債券 -	1,500,000	1,460.46 21,907,018	1,454.12 21,811,803	1.5000 2020/06/17	1.62%
20	FRANCE O.A.T. フランス	国債証券 -	96,000	23,816.92 22,864,248	22,059.80 21,177,416	5.7500 2032/10/25	1.57%
21	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	135,000	15,256.40 20,596,151	15,448.89 20,856,006	4.2500 2020/03/01	1.55%
22	UK GILT イギリス	国債証券 -	89,000	22,492.82 20,018,614	22,904.74 20,385,226	4.2500 2027/12/07	1.51%
23	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	149,000	14,022.59 20,893,659	13,265.00 19,764,855	2.8750 2021/07/08	1.47%
24	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	104,000	20,180.99 20,988,236	17,770.00 18,480,807	3.2500 2045/05/25	1.37%
25	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	110,000	16,223.88 17,846,270	15,921.00 17,513,107	3.7500 2021/04/25	1.30%
26	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	81,000	20,325.99 16,464,056	19,429.04 15,737,526	5.0000 2040/09/01	1.17%
27	REPUBLIC OF BULGARIA ブルガリア	国債証券 -	120,000	13,287.85 15,945,422	12,984.71 15,581,653	2.6250 2027/03/26	1.16%
28	REPUBLIC OF MONTENEGRO モンテネグロ	国債証券 -	112,000	13,549.68 15,175,641	13,518.99 15,141,273	5.9160 2016/12/09	1.13%
29	ALTICE FINCO SA ルクセンブルグ	社債券 -	100,000	15,459.25 15,459,255	15,137.11 15,137,118	9.0000 2023/06/15	1.12%
30	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	85,000	16,231.98 13,797,187	17,653.77 15,005,706	4.7500 2028/09/01	1.12%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
国債証券	67.04%
社債券	26.50%
特殊債券	3.76%
合計	97.29%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

アジア・オセアニア債券マザーファンド

（1）投資状況

（平成27年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
国債証券	韓国	108,216,567	8.31%
	香港	80,538,681	6.18%
	シンガポール	76,045,590	5.84%
	マレーシア	56,878,334	4.37%
特殊債券	国際機関	636,669,988	48.88%
	ドイツ	200,857,430	15.42%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		143,253,311	11.00%
純資産総額		1,302,459,901	100.00%

（注）投資比率は、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。

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成27年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	ASIAN DEVELOPMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	4,000,000	8,942.59 357,703,976	8,884.82 355,393,102	3.5000 2018/07/25	27.29%
2	EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	2,300,000	8,926.56 205,311,068	8,870.07 204,011,761	7.5000 2017/12/15	15.66%
3	LANDWIRTSCH. RENTENBANK ドイツ	特殊債券 -	2,400,000	8,198.20 196,756,824	8,369.05 200,857,430	4.0000 2020/01/30	15.42%
4	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	900,000,000	12.06 108,623,929	12.02 108,216,567	4.2500 2021/06/10	8.31%
5	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	4,800,000	1,674.28 80,365,708	1,677.88 80,538,681	2.4400 2020/12/07	6.18%
6	NORDIC INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	900,000	8,465.68 76,191,132	8,585.01 77,265,124	4.8750 2019/01/22	5.93%
7	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	850,000	8,935.64 75,953,012	8,946.54 76,045,590	2.5000 2019/06/01	5.84%
8	MALAYSIAN GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	2,000,000	2,850.49 57,009,842	2,843.91 56,878,334	4.2620 2016/09/15	4.37%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
特殊債券	64.30%
国債証券	24.70%
合計	89.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成27年10月末現在）

該当事項はありません。

コモディティ・マザーファンド

(1) 投資状況

(平成27年10月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
社債券	イギリス	648,685,564	98.54%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,631,344	1.46%
純資産総額		658,316,908	100.00%

(注) 投資比率は、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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成27年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	BCOM/BARCLAYS 10/20/17 イギリス	社債券 -	5,600,000	12,090.36 677,060,553	11,583.67 648,685,564	0.8500 2017/10/20	98.54%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
社債券	98.54%
合計	98.54%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成27年10月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

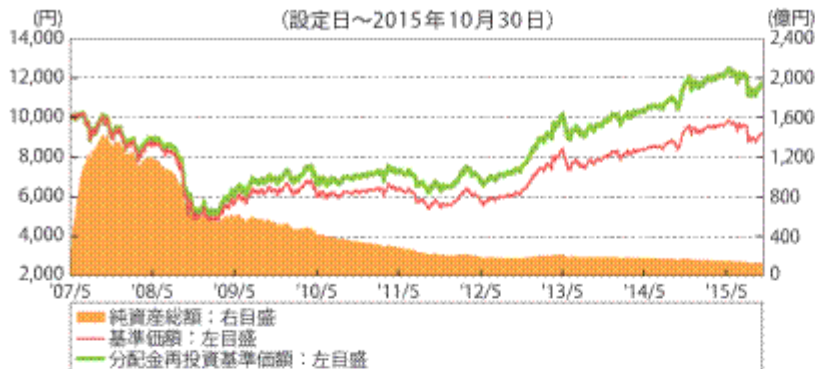
(平成27年10月末現在)

該当事項はありません。

(参考情報)

2015年10月30日現在

基準価額・純資産の推移



*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計算しております。

分配の推移

2015年9月	30円
2015年7月	30円
2015年5月	30円
2015年3月	30円
2015年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	1,670円

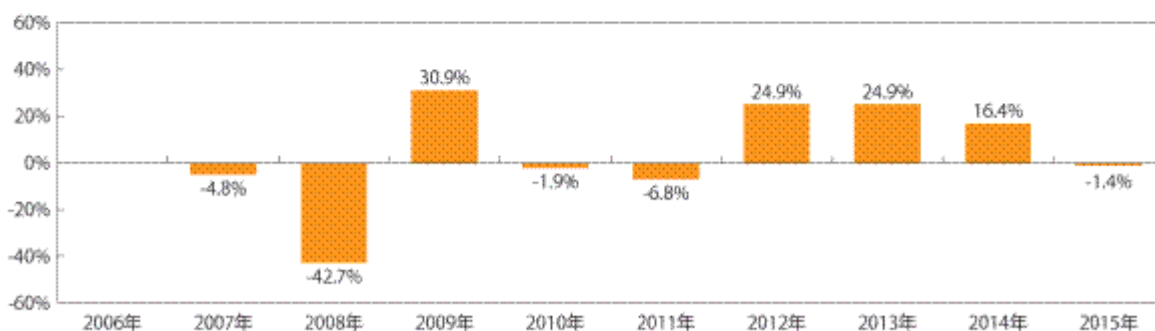
*分配金は1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
世界REITマザーファンド	15.5%
グローバル好配当株マザーファンド	15.4%
日本好配当株マザーファンド	10.1%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	9.8%
欧州債券マザーファンド	9.8%
新興国債券マザーファンド	9.8%
アジア・オセアニア債券マザーファンド	9.5%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	9.5%
T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	4.8%
コモディティ・マザーファンド	4.8%

*投資比率は全て純資産総額対比

年間収益率の推移



*ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2007年は当初設定日(2007年5月22日)から年末までの収益率、2015年は10月末までの収益率です。

*ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

*ファンドには、ベンチマークはありません。

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

[前へ](#)

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

- 1．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、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ヵ月毎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3月28日から平成27年9月28日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

1 財務諸表

グローバル資産分散オープン

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成27年3月27日現在 金額（円）	当期 平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,971,087	1,991,431
コール・ローン	299,940,107	275,792,745
投資証券	4,020,269,234	3,236,064,345
親投資信託受益証券	11,717,779,971	9,975,363,466
流動資産合計	16,039,960,399	13,489,211,987
資産合計	16,039,960,399	13,489,211,987
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,819	-
未払収益分配金	50,309,260	45,168,333
未払解約金	70,759,981	19,404,474
未払受託者報酬	1,143,591	1,040,506
未払委託者報酬	40,026,241	36,418,386
その他未払費用	568,675	546,271
流動負債合計	162,817,567	102,577,970
負債合計	162,817,567	102,577,970
純資産の部		
元本等		
元本	16,769,753,506	15,056,111,317
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	892,610,674	1,669,477,300
（分配準備積立金）	655,632,864	626,749,667
元本等合計	15,877,142,832	13,386,634,017
純資産合計	15,877,142,832	13,386,634,017
負債純資産合計	16,039,960,399	13,489,211,987

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成26年9月30日 至 平成27年3月27日 金額（円）	当期 自 平成27年3月28日 至 平成27年9月28日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	85,885,190	74,151,724
受取利息	76,542	62,662
有価証券売買等損益	1,149,408,013	704,389,610
為替差損益	370,756,074	43,635,855
営業収益合計	1,606,125,819	586,539,369

営業費用		
受託者報酬	3,568,914	3,279,990
委託者報酬	124,913,875	114,801,388
その他費用	800,542	777,829
営業費用合計	129,283,331	118,859,207
営業利益又は営業損失（ ）	1,476,842,488	705,398,576
経常利益又は経常損失（ ）	1,476,842,488	705,398,576
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,476,842,488	705,398,576
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（ ）	59,787,312	3,218,348
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,421,695,243	892,610,674
剰余金増加額又は欠損金減少額	279,152,148	67,415,919
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	279,152,148	67,415,919
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,097,042	2,221,858
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,097,042	2,221,858
分配金	159,025,713	139,880,459
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	892,610,674	1,669,477,300

[次へ](#)

配当等収益 （費用控除後）	38,931,850円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	75,844,750円
分配準備積立金	667,731,519円
分配可能額	782,508,119円
（1万口当たり分配可能額）	(442.13円)
収益分配金	53,096,148円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第47期計算期間末（平成27年3月27日）に、投資信託約款に基づき計算した778,648,613円（1万口当たり464.32円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い150,309,260円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	87,498,840円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	72,706,489円
分配準備積立金	618,443,284円
分配可能額	778,648,613円
（1万口当たり分配可能額）	(464.32円)
収益分配金	50,309,260円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

配当等収益 （費用控除後）	40,091,996円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	68,407,315円
分配準備積立金	641,163,905円
分配可能額	749,663,216円
（1万口当たり分配可能額）	(485.51円)
収益分配金	46,322,238円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第50期計算期間末（平成27年9月28日）に、投資信託約款に基づき計算した739,265,660円（1万口当たり491.01円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い145,168,333円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	53,434,145円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	67,347,660円
分配準備積立金	618,483,855円
分配可能額	739,265,660円
（1万口当たり分配可能額）	(491.01円)
収益分配金	45,168,333円
（1万口当たり収益分配金）	(30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	当期
	自 平成27年3月28日 至 平成27年9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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	当期
	平成27年9月28日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成27年3月27日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	185,494,037
投資証券	9,821,207

合計	175,672,830
----	-------------

当期（平成27年9月28日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	677,739,785
投資証券	148,683,773
合計	826,423,558

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（通貨関連）

区分	種類	前期 平成27年3月27日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	130,000,000	-	130,009,819	9,819
合計		-	-	130,009,819	9,819

（注）時価の算定方法

- A．特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。
 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 特定期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。
 ・特定期間末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。
 ・特定期間末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。
- B．特定期間末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きましては、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

当期（平成27年9月28日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成27年3月28日 至 平成27年9月28日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成27年3月27日現在	当期 平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 0.9468円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,468円）」	1口当たり純資産額 0.8891円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,891円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	日本好配当株マザーファンド	942,115,073	1,285,798,651	
	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	1,859,107,127	2,005,418,857	
	親投資信託 受益証券	グローバル好配当株マザーファンド	1,175,645,589	1,988,722,078	
	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	644,574,258	1,309,194,775	
	親投資信託 受益証券	欧州債券マザーファンド	1,015,818,098	1,341,387,798	
	親投資信託 受益証券	アジア・オセアニア債券マザーファンド	1,035,297,717	1,373,011,832	
	親投資信託 受益証券	コモディティ・マザーファンド	1,157,528,386	671,829,475	
	小計（日本）7銘柄		7,830,086,248	9,975,363,466	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	831,253.850	5,145,461.330	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	1,167,294.490	11,042,605.870	

投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV – U.S. Aggregate Bond Fund	989,772.560	10,689,543.640	
小計(アメリカ・ドル) 3銘柄		2,988,320.900	26,877,610.840 (3,236,064,345)	
合計			13,211,427,811 (3,236,064,345)	

- (注) 1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 3銘柄	24.17%	24.49%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、指定投資信託証券である、「日本好配当株マザーファンド」、「世界REITマザーファンド」、「グローバル好配当株マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「欧州債券マザーファンド」、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」、「コモディティ・マザーファンド」、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」及び「エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」及び「投資証券」は指定投資信託証券に属するものを指します。

指定投資信託証券の状況は以下のとおりです。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本好配当株マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成27年3月27日現在 金額（円）	平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,626,490,168	1,378,353,456
株式	28,261,202,820	22,822,296,130
派生商品評価勘定	43,496,521	4,558,505
未収入金	632,924,097	14,788,813
未収配当金	329,580,000	216,575,500
差入委託証拠金	46,080,000	61,005,000
流動資産合計	30,939,773,606	24,497,577,404
資産合計	30,939,773,606	24,497,577,404
負債の部		
流動負債		
前受金	44,160,000	5,146,000
未払金	524,236,536	13,326,375
未払解約金	98,668,630	4,295,499
流動負債合計	667,065,166	22,767,874
負債合計	667,065,166	22,767,874
純資産の部		
元本等		
元本	21,459,725,900	17,932,438,573
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,812,982,540	6,542,370,957
元本等合計	30,272,708,440	24,474,809,530
純資産合計	30,272,708,440	24,474,809,530
負債純資産合計	30,939,773,606	24,497,577,404

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 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 3月28日 至 平成27年 9月28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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 国内株式についての受取配当金は、原則として、株式の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。 (2)有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年 3月27日現在	平成27年 9月28日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	26,295,630,832円	21,459,725,900円
期中追加設定元本額	232,783,157円	193,685,328円
期中一部解約元本額	5,068,688,089円	3,720,972,655円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	20,351,678,788円	16,990,323,500円
グローバル資産分散オープン	1,108,047,112円	942,115,073円
合計	21,459,725,900円	17,932,438,573円
2. 受益権の総数	21,459,725,900口	17,932,438,573口

(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 3月28日 至 平成27年 9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年 9月28日現在

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成27年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,614,459,455
合計	4,614,459,455

「計算期間」とは、「日本好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成26年10月9日から平成27年3月27日まで)を指しております。

(平成27年9月28日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,292,722,268
合計	1,292,722,268

「計算期間」とは、「日本好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成27年4月9日から平成27年9月28日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)

区分	種類	平成27年3月27日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建 T O P I X	1,447,383,479	-	1,490,880,000	43,496,521
	合計	-	-	1,490,880,000	43,496,521

区分	種類	平成27年9月28日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建 T O P I X	1,193,131,495	-	1,197,690,000	4,558,505
	合計	-	-	1,197,690,000	4,558,505

(注)時価の算定方法

- 1)先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 2)期末の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段等を用いております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成27年3月28日 至 平成27年9月28日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 1.4107円 「1口 = 1円(10,000口 = 14,107円)」	1口当たり純資産額 1.3648円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,648円)」

(3)附属明細表

有価証券明細表

<株式>

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
円	ホクト	34,000	2,178.00	74,052,000	
	西松建設	410,000	504.00	206,640,000	
	奥村組	390,000	637.00	248,430,000	
	大東建託	3,000	12,415.00	37,245,000	
	日成ビルド工業	295,000	383.00	112,985,000	
	大和ハウス工業	99,400	2,974.00	295,615,600	
	積水ハウス	19,600	1,905.00	37,338,000	
	中電工	55,000	2,314.00	127,270,000	
	関電工	351,000	774.00	271,674,000	
	高砂熱学工業	182,000	1,694.00	308,308,000	
	日本たばこ産業	134,100	4,125.00	553,162,500	
	日清紡ホールディングス	75,000	1,344.00	100,800,000	
	ワコールホールディングス	141,000	1,482.00	208,962,000	
	三菱瓦斯化学	130,000	545.00	70,850,000	
	三菱ケミカルホールディングス	180,000	613.10	110,358,000	
	宇部興産	360,000	209.00	75,240,000	
	太陽ホールディングス	43,600	3,800.00	165,680,000	
	D I C	172,000	270.00	46,440,000	
	ポーラ・オルビスホールディングス	15,500	7,340.00	113,770,000	
	武田薬品工業	46,100	5,422.00	249,954,200	
	アステラス製薬	95,500	1,609.50	153,707,250	
	科研製薬	24,000	11,620.00	278,880,000	
	大塚ホールディングス	70,300	3,960.00	278,388,000	
	東燃ゼネラル石油	124,000	1,146.00	142,104,000	
	J Xホールディングス	343,900	444.80	152,966,720	
	ブリヂストン	110,400	4,093.00	451,867,200	
	日本電気硝子	207,000	593.00	122,751,000	
	ニチアス	95,000	729.00	69,255,000	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	102,000	1,656.00	168,912,000	
	丸一鋼管	26,100	2,764.00	72,140,400	
	日本軽金属ホールディングス	760,000	186.00	141,360,000	
	三菱マテリアル	190,000	366.00	69,540,000	
	古河機械金属	384,000	257.00	98,688,000	
	古河電気工業	540,000	193.00	104,220,000	
	リョービ	164,000	451.00	73,964,000	
	アサヒホールディングス	32,000	1,815.00	58,080,000	
	三和ホールディングス	238,000	871.00	207,298,000	
	アマダホールディングス	22,000	932.00	20,504,000	
	アイダエンジニアリング	190,400	995.00	189,448,000	
	やまびこ	33,200	1,003.00	33,299,600	
	小松製作所	42,000	1,805.00	75,810,000	
	アマノ	38,100	1,373.00	52,311,300	
	マックス	69,000	1,143.00	78,867,000	
	マブチモーター	37,000	5,300.00	196,100,000	
	スミダコーポレーション	138,000	815.00	112,470,000	
	アズビル	194,900	2,970.00	578,853,000	
	日本セラミック	22,000	1,731.00	38,082,000	
	カシオ計算機	117,000	2,260.00	264,420,000	
	ニチコン	20,000	873.00	17,460,000	
	K O A	47,000	1,053.00	49,491,000	
	スター精密	73,000	1,636.00	119,428,000	
	キヤノン	110,900	3,511.00	389,369,900	
	リコー	27,000	1,226.50	33,115,500	
デンソー	6,300	5,175.00	32,602,500		
日産自動車	182,300	1,088.00	198,342,400		
トヨタ自動車	178,500	7,049.00	1,258,246,500		
太平洋工業	104,000	1,200.00	124,800,000		
アイシン精機	13,000	3,925.00	51,025,000		
本田技研工業	90,000	3,620.00	325,800,000		
富士重工業	56,000	4,259.00	238,504,000		
愛三工業	73,400	1,053.00	77,290,200		
H O Y A	106,700	4,007.00	427,546,900		
トッパン・フォームズ	69,000	1,469.00	101,361,000		
大日本印刷	185,000	1,173.00	217,005,000		
中国電力	111,700	1,676.00	187,209,200		
電源開発	55,000	3,675.00	202,125,000		
大阪瓦斯	263,000	459.00	120,717,000		

西日本旅客鉄道	63,800	7,490.00	477,862,000
センコー	408,000	817.00	333,336,000
日本航空	94,800	4,475.00	424,230,000
住友倉庫	354,000	606.00	214,524,000
ティーガイア	25,900	1,791.00	46,386,900
伊藤忠テクノソリューションズ	27,400	2,615.00	71,651,000
ネットワークシステムズ	72,000	688.00	49,536,000
日本電信電話	160,500	4,265.00	684,532,500
KDDI	165,200	2,675.50	441,992,600
NTTドコモ	162,300	2,080.00	337,584,000
第一興商	50,000	4,300.00	215,000,000
黒田電気	34,000	2,252.00	76,568,000
伊藤忠商事	169,100	1,306.00	220,844,600
住友商事	200,500	1,206.50	241,903,250
三菱商事	120,500	2,008.50	242,024,250
サンゲツ	55,000	1,943.00	106,865,000
伊藤忠エネクス	133,000	949.00	126,217,000
三信電気	46,000	1,193.00	54,878,000
日鉄住金物産	140,000	381.00	53,340,000
オートバックスセブン	29,000	2,087.00	60,523,000
ローソン	17,900	8,760.00	156,804,000
アダストリア	37,000	7,290.00	269,730,000
すかいらーく	59,800	1,602.00	95,799,600
AOKIホールディングス	79,000	1,492.00	117,868,000
青山商事	80,700	4,275.00	344,992,500
あおぞら銀行	555,000	432.00	239,760,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,838,400	742.00	1,364,092,800
三井住友トラスト・ホールディングス	613,000	442.30	271,129,900
武蔵野銀行	28,000	4,295.00	120,260,000
ふくおかフィナンシャルグループ	230,000	563.00	129,490,000
みずほフィナンシャルグループ	2,931,600	230.10	674,561,160
池田泉州ホールディングス	110,000	528.00	58,080,000
野村ホールディングス	180,000	703.30	126,594,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	91,000	708.00	64,428,000
極東証券	22,000	1,637.00	36,014,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	86,600	3,220.00	278,852,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	130,000	2,005.00	260,650,000
第一生命保険	58,200	1,888.00	109,881,600
東京海上ホールディングス	84,700	4,381.00	371,070,700
ジャックス	295,000	474.00	139,830,000
日立キャピタル	50,000	2,971.00	148,550,000
オリックス	115,600	1,562.50	180,625,000
野村不動産ホールディングス	133,000	2,461.00	327,313,000
パーク24	25,900	2,272.00	58,844,800
スターツコーポレーション	66,000	1,836.00	121,176,000
もしもしホットライン	123,300	1,257.00	154,988,100
ユー・エス・エス	56,500	2,042.00	115,373,000
メイテック	32,200	4,200.00	135,240,000
合計 115銘柄	19,959,300	-	22,822,296,130

デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

世界REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成27年3月27日現在 金額（円）	平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	32,523,739	41,770,683
コール・ローン	16,669,457	13,216,593
投資証券	2,310,439,103	1,945,644,549
派生商品評価勘定	10,346	-
未収配当金	9,491,517	4,705,282
流動資産合計	2,369,134,162	2,005,337,107
資産合計	2,369,134,162	2,005,337,107
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	2,048,881,192	1,859,107,127
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	320,252,970	146,229,980
元本等合計	2,369,134,162	2,005,337,107
純資産合計	2,369,134,162	2,005,337,107
負債純資産合計	2,369,134,162	2,005,337,107

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 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 3月28日 至 平成27年 9月28日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 国内投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の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。 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</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>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年 3月27日現在	平成27年 9月28日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	2,637,791,915円	2,048,881,192円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	588,910,723円	189,774,065円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	2,048,881,192円	1,859,107,127円
合計	2,048,881,192円	1,859,107,127円
2. 受益権の総数	2,048,881,192口	1,859,107,127口

(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 3月28日 至 平成27年 9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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	平成27年 9月28日現在
----	---------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成27年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	456,107,143
合計	456,107,143

「計算期間」とは、「世界REITマザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年3月28日から平成27年3月27日まで）を指しております。

(平成27年9月28日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	167,595,495
合計	167,595,495

「計算期間」とは、「世界REITマザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年3月28日から平成27年9月28日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(通貨関連)

区分	種類	平成27年3月27日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	5,718,110	-	5,707,764	10,346
	合計	-	-	5,707,764	10,346

(注)時価の算定方法

- A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。
・計算期間末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。
・計算期間末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。
- B. 計算期間末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きましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(平成27年9月28日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成27年3月28日 至 平成27年9月28日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 1.1563円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,563円)」	1口当たり純資産額 1.0787円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,787円)」

(3)附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
----	----	----	----	-----	----

円	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	64	25,888,000
	投資証券	産業ファンド投資法人	54	28,080,000
	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	42	10,638,600
	投資証券	日本ビルファンド投資法人	88	50,864,000
	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	60	32,880,000
	投資証券	日本リテールファンド投資法人	107	24,759,800
	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	233	36,417,900
	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	50	10,605,000
	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	60	34,800,000
	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	145	19,314,000
	小計(日本)10銘柄		903	274,247,300
アメリカ ・ドル	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	13,825.000	357,376.250
	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	3,400.000	396,032.000
	投資証券	EPR PROPERTIES	2,100.000	110,649.000
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	16,496.000	1,202,063.520
	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	6,900.000	175,398.000
	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	10,131.000	685,362.150
	投資証券	LIBERTY PROPERTY TRUST	9,000.000	281,700.000
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,452.000	1,362,151.080
	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	2,233.000	203,448.630
	小計(アメリカ・ドル)9銘柄		71,537.000	4,774,180.630 (574,811,348)
カナダ ・ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,167.000	315,161.460
	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,005.000	225,981.150
	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	11,163.000	278,628.480
	投資証券	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500.000	163,515.000
	小計(カナダ・ドル)4銘柄		33,835.000	983,286.090 (88,810,399)
オースト ラリア・ ドル	投資証券	CHARTER HALL RETAIL REIT	100,700.000	403,807.000
	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	58,900.000	431,148.000
	投資証券	GPT GROUP	107,000.000	481,500.000
	投資証券	INVESTA OFFICE FUND	72,492.000	288,518.160
	投資証券	MIRVAC GROUP	206,000.000	359,470.000
	投資証券	SCENTRE GROUP	145,084.000	561,475.080
	投資証券	STOCKLAND	111,538.000	428,305.920
	投資証券	WESTFIELD CORP	61,792.000	602,472.000
	小計(オーストラリア・ドル)8銘柄		863,506.000	3,556,696.160 (301,003,196)
シンガ ポール・ ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	164,005.000	377,211.500
	投資証券	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	180,500.000	240,065.000
	投資証券	CAPITALAND MALL TRUST	149,356.000	284,523.180
	投資証券	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	187,920.000	187,920.000
	小計(シンガポール・ドル)4銘柄		681,781.000	1,089,719.680 (92,048,621)
イギリス ・ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	71,415.000	604,170.900
	投資証券	DERWENT LONDON PLC	5,478.000	200,659.140
	投資証券	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	13,259.000	113,563.330
	投資証券	HAMMERSON PLC	69,182.000	432,733.410
	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	25,565.000	327,232.000
	投資証券	SEGRO PLC	59,374.000	256,614.420
	小計(イギリス・ポンド)6銘柄		244,273.000	1,934,973.200 (354,158,145)
ユーロ	投資証券	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,124.000	81,213.600
	投資証券	BEFIMMO S.C.A.	847.000	46,652.760
	投資証券	COFINIMMO	797.000	75,547.630
	投資証券	EUROCOMMERCIAL	5,355.000	207,827.550
	投資証券	ICADE	6,020.000	369,808.600
	投資証券	KLEPIERRE	3,933.000	161,095.680
	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,377.000	784,477.100
	投資証券	VASTNED RETAIL	1,893.000	73,154.980
	投資証券	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,916.000	133,487.720
	小計(ユーロ)9銘柄		31,262.000	1,933,265.620 (260,565,540)
合計				1,945,644,549 (1,671,397,249)

(注)1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 9 銘柄	28.66%	29.54%
カナダ・ドル	投資証券 4 銘柄	4.43%	4.57%
オーストラリア・ドル	投資証券 8 銘柄	15.01%	15.47%
シンガポール・ドル	投資証券 4 銘柄	4.59%	4.73%
イギリス・ポンド	投資証券 6 銘柄	17.66%	18.20%
ユーロ	投資証券 9 銘柄	12.99%	13.39%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

グローバル好配当株マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成27年3月27日現在 金額（円）	平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,424,398,932	3,584,801,963
コール・ローン	2,196,737,784	1,304,921,063
株式	99,054,372,909	81,789,917,891
派生商品評価勘定	9,173,982	2
未収入金	945,619,086	690,257,962
未収配当金	279,101,634	255,063,645
流動資産合計	104,909,404,327	87,624,962,526
資産合計	104,909,404,327	87,624,962,526
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,846,789	-
未払金	-	918,844,624
未払解約金	145,599,443	46,265,906
流動負債合計	152,446,232	965,110,530
負債合計	152,446,232	965,110,530
純資産の部		
元本等		
元本	57,910,946,035	51,228,992,457
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	46,846,012,060	35,430,859,539
元本等合計	104,756,958,095	86,659,851,996
純資産合計	104,756,958,095	86,659,851,996
負債純資産合計	104,909,404,327	87,624,962,526

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 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 3月28日 至 平成27年 9月28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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金及び配当株式 国内株式についての受取配当金は、原則として、株式の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。 外国株式についての受取配当金及び配当株式は、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ものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年 3月27日現在	平成27年 9月28日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	67,071,780,536円	57,910,946,035円
期中追加設定元本額	285,671,676円	276,136,930円
期中一部解約元本額	9,446,506,177円	6,958,090,508円
元本の内訳		
グローバル好配株オープン	56,601,972,441円	50,053,346,868円
グローバル資産分散オープン	1,308,973,594円	1,175,645,589円
合計	57,910,946,035円	51,228,992,457円
2. 受益権の総数	57,910,946,035口	51,228,992,457口

(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 3月28日 至 平成27年 9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年9月28日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成27年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	6,101,682,108
合計	6,101,682,108

「計算期間」とは、「グローバル好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年1月9日から平成27年3月27日まで）を指しております。

(平成27年9月28日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	3,670,816,478
合計	3,670,816,478

「計算期間」とは、「グローバル好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年7月9日から平成27年9月28日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(通貨関連)

区分	種類	平成27年3月27日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	978,766,464	-	971,919,675	6,846,789
	売建 オーストラリア・ドル ユーロ	14,488,182	-	14,441,720	46,462
		964,278,282	-	955,150,762	9,127,520
	合計	-	-	1,941,512,157	2,327,193

区分	種類	平成27年9月28日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	2,618	-	2,618	0
	売建 香港・ドル	2,618	-	2,616	2
	合計	-	-	5,234	2

(注)時価の算定方法

- A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・計算期間末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を用いております。
 - ・計算期間末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。
- B．計算期間末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きましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成27年3月28日 至 平成27年9月28日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 1.8089円 「1口 = 1円（10,000口 = 18,089円）」	1口当たり純資産額 1.6916円 「1口 = 1円（10,000口 = 16,916円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式>

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
円	大塚ホールディングス	254,500	3,960.00	1,007,820,000	
	アズビル	331,800	2,970.00	985,446,000	
	日本航空	243,900	4,475.00	1,091,452,500	
	NTTドコモ	409,300	2,080.00	851,344,000	
	みずほフィナンシャルグループ	4,243,000	230.10	976,314,300	
	小計（日本）5銘柄	5,482,500	-	4,912,376,800	
アメリカ・ドル	ABBVIE INC	108,500	55.740	6,047,790.000	
	ALTRIA GROUP INC	139,180	54.790	7,625,672.200	
	APPLE INC	65,980	114.710	7,568,565.800	
	BRISTOL MYERS-SQUIBB	134,770	60.240	8,118,544.800	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	83,300	99.580	8,295,014.000	
	CAMPBELL SOUP CO	147,210	51.670	7,606,340.700	
	CARNIVAL CORP	152,740	50.700	7,743,918.000	
	CHEVRON CORP	101,350	77.700	7,874,895.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	117,240	66.260	7,768,322.400	
	DOW CHEMICAL	152,300	42.320	6,445,336.000	
	ELI LILLY & CO	89,710	84.060	7,541,022.600	
	GENERAL MILLS INC	146,700	57.430	8,424,981.000	
	HASBRO INC	102,210	74.950	7,660,639.500	
	HOME DEPOT INC	65,720	116.740	7,672,152.800	
	JOHNSON & JOHNSON	85,120	91.000	7,745,920.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	143,860	61.470	8,843,074.200	
	KIMBERLY CLARK CORP	77,400	108.710	8,414,154.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	36,060	203.890	7,352,273.400	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	103,200	68.500	7,069,200.000	
	MERCK & CO INC	145,900	49.600	7,236,640.000	
	NEWELL RUBBERMAID INC	182,800	40.680	7,436,304.000	
	NEXTERA ENERGY INC	76,250	98.610	7,519,012.500	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	44,910	165.570	7,435,748.700	
	PFIZER INC	204,400	31.890	6,518,316.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	95,720	80.600	7,715,032.000	
	SCHLUMBERGER LTD	104,710	72.900	7,633,359.000	
	STARBUCKS CORP	140,990	57.990	8,176,010.100	
	SYSCO CORP	193,540	39.730	7,689,344.200	
	VERIZON COMM	165,216	44.220	7,305,851.520	
	WELLS FARGO & COMPANY	163,200	51.480	8,401,536.000	
	WESTERN UNION CO	397,800	18.210	7,243,938.000	
小計（アメリカ・ドル）31銘柄	3,967,986	-	236,128,908.420 (28,429,920,573)		
カナダ・ドル	BANK OF NOVA SCOTIA	163,920	57.750	9,466,380.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	184,880	51.610	9,541,656.800	
	小計（カナダ・ドル）2銘柄	348,800	-	19,008,036.800 (1,716,805,883)	
オーストラリア・ドル	AMCOR LTD	770,320	12.890	9,929,424.800	
	AMP LTD	1,390,000	5.550	7,714,500.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	132,505	77.400	10,255,887.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	349,394	29.790	10,408,447.260	
	SONIC HEALTHCARE LTD	559,200	18.920	10,580,064.000	

	TELSTRA CORP	1,846,790	5.670	10,471,299.300	
	WESFARMERS LIMITED	262,299	39.150	10,269,005.850	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	345,559	29.950	10,349,492.050	
	小計(オーストラリア・ドル) 8銘柄	5,656,067	-	79,978,120.260 (6,768,548,317)	
香港 ・ドル	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	3,069,000	19.860	60,950,340.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,851,000	22.950	42,480,450.000	
	CHINA MOBILE LTD	633,000	94.400	59,755,200.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,870,000	23.550	67,588,500.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	16,935,000	3.240	54,869,400.000	
	HANG SENG BANK LTD	384,600	141.900	54,574,740.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	4,048	181.600	735,116.800	
	PETROCHINA CO LTD-H	6,300,000	5.550	34,965,000.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	840,000	72.850	61,194,000.000	
	小計(香港・ドル) 9銘柄	32,886,648	-	437,112,746.800 (6,788,360,957)	
シンガ ポール・ ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	560,000	16.770	9,391,200.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,470,400	7.260	10,675,104.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,845,000	3.640	10,355,800.000	
	小計(シンガポール・ドル) 3銘柄	4,875,400	-	30,422,104.000 (2,569,755,125)	
台湾 ・ドル	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	680,000	338.000	229,840,000.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	82,000	2,730.000	223,860,000.000	
	SILICONWARE PRECISION INDS	6,160,000	39.500	243,320,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	2,113,131	127.000	268,367,637.000	
	小計(台湾・ドル) 4銘柄	9,035,131	-	965,387,637.000 (3,523,664,875)	
イギリス ・ポンド	ASTRAZENECA PLC	116,900	43.300	5,061,770.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,100	36.180	5,358,258.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	395,250	12.890	5,094,772.500	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	153,710	35.140	5,401,369.400	
	INMARSAT PLC	536,800	10.250	5,502,200.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,007,900	2.446	4,911,323.400	
	NATIONAL GRID PLC	566,100	8.909	5,043,384.900	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	94,600	59.900	5,666,540.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	295,680	15.570	4,603,737.600	
	VODAFONE GROUP PLC	2,200,850	2.176	4,789,049.600	
	小計(イギリス・ポンド) 10銘柄	6,515,890	-	51,432,405.400 (9,413,673,160)	
スイス・ フラン	NESTLE SA (REGD)	105,520	72.400	7,639,648.000	
	NOVARTIS AG-REG	81,890	91.350	7,480,651.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,500	251.500	8,173,750.000	
	SWISS RE AG	85,000	83.900	7,131,500.000	
	小計(スイス・フラン) 4銘柄	304,910	-	30,425,549.500 (3,741,734,077)	
ノル ウェー・ クローネ	TELENOR ASA	362,900	162.200	58,862,380.000	
	小計(ノルウェー・クローネ) 1銘柄	362,900	-	58,862,380.000 (831,725,429)	
スウェー デン・ク ローナ	ERICSSON LM-B SHS	711,360	81.100	57,691,296.000	
	小計(スウェーデン・クローナ) 1銘柄	711,360	-	57,691,296.000 (826,139,358)	
韓国・ ウォン	KT&G CORP	94,300	105,500.000	9,948,650,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1銘柄	94,300	-	9,948,650,000.000 (1,004,813,650)	
ユーロ	ACCOR SA	160,590	42.455	6,817,848.450	
	ALLIANZ AG REGD DM 50	46,300	138.350	6,405,605.000	
	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	31,913	65.720	2,097,322.360	
	FERROVIAL SA	294,309	21.570	6,348,245.130	
	K+S AG	189,167	30.915	5,848,097.800	
	KONINKLIJKE DSM NV	147,800	41.590	6,147,002.000	
	ORANGE	488,300	14.135	6,902,120.500	
	RELX NV	257,922	14.320	3,693,443.040	
	SAMPO OYJ-A SHS	167,470	43.830	7,340,210.100	
	SANOFI	79,200	87.010	6,891,192.000	
	SIEMENS AG DM 5	53,480	80.000	4,278,400.000	
	SNAM SPA	1,590,500	4.476	7,119,078.000	
	TOTAL SA	172,230	40.385	6,955,508.550	
	UNILEVER NV-CVA	188,900	35.560	6,717,284.000	

小計(ユーロ)14銘柄	3,868,081	-	83,561,356.930 (11,262,399,687)
合計	74,109,973	-	81,789,917,891 (76,877,541,091)

- (注)1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	外国株式 31銘柄	32.81%	34.76%
カナダ・ドル	外国株式 2銘柄	1.98%	2.10%
オーストラリア・ドル	外国株式 8銘柄	7.81%	8.27%
香港・ドル	外国株式 9銘柄	7.83%	8.30%
シンガポール・ドル	外国株式 3銘柄	2.96%	3.14%
台湾・ドル	外国株式 4銘柄	4.07%	4.31%
イギリス・ポンド	外国株式 10銘柄	10.86%	11.51%
スイス・フラン	外国株式 4銘柄	4.32%	4.57%
ノルウェー・クローネ	外国株式 1銘柄	0.96%	1.02%
スウェーデン・クローナ	外国株式 1銘柄	0.95%	1.01%
韓国・ウォン	外国株式 1銘柄	1.16%	1.23%
ユーロ	外国株式 14銘柄	13.00%	13.77%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

新興国債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成27年3月27日現在 金額（円）	平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	415,099,628	538,686,655
コール・ローン	252,083,268	151,056,384
国債証券	5,690,781,347	7,199,871,316
特殊債券	449,628,878	553,539,497
社債券	3,673,927,424	3,573,244,238
派生商品評価勘定	11,276,242	48,172,915
未収入金	-	329,408,380
未収利息	157,380,660	176,162,696
前払費用	14,385,146	31,110,449
流動資産合計	10,664,562,593	12,601,252,530
資産合計	10,664,562,593	12,601,252,530
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,138,946	26,567,612
未払金	37,639,845	142,971,725
未払解約金	-	999,999
流動負債合計	42,778,791	170,539,336
負債合計	42,778,791	170,539,336
純資産の部		
元本等		
元本	5,202,610,716	6,120,077,528
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,419,173,086	6,310,635,666
元本等合計	10,621,783,802	12,430,713,194
純資産合計	10,621,783,802	12,430,713,194
負債純資産合計	10,664,562,593	12,601,252,530

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 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 3月28日 至 平成27年 9月28日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年 3月27日現在	平成27年 9月28日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	5,672,108,090円	5,202,610,716円
期中追加設定元本額	379,039,820円	1,607,569,679円
期中一部解約元本額	848,537,194円	690,102,867円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	751,485,028円	644,574,258円
大和住銀/T・ロウ・プライスF0Fs用新興国債券ファンド（適格機関投資家専用）	2,660,612,876円	2,206,150,320円
T・ロウ・プライス新興国債券オープンM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	1,790,512,812円	3,269,352,950円
合計	5,202,610,716円	6,120,077,528円
2. 受益権の総数	5,202,610,716口	6,120,077,528口

(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 3月28日 至 平成27年 9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年 9月28日現在

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成27年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	76,703,645
特殊債証券	5,637,909
社債証券	213,081,459
合計	142,015,723

「計算期間」とは、「新興国債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年11月8日から平成27年3月27日まで）を指しております。

(平成27年9月28日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	281,911,479
特殊債証券	41,144,359
社債証券	269,273,374
合計	592,329,212

「計算期間」とは、「新興国債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年5月8日から平成27年9月28日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(通貨関連)

区分	種類	平成27年3月27日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	628,268,993	-	623,537,425	4,731,568
	メキシコ・ペソ	28,285,048	-	28,435,680	150,632
	ユーロ	1,610,368	-	1,557,120	53,248
	売建				
	アメリカ・ドル	29,895,416	-	29,467,780	427,636
メキシコ・ペソ	480,392,253	-	472,066,269	8,325,984	
ユーロ	45,876,740	-	43,858,880	2,017,860	
合計		-	-	1,198,923,154	6,137,296

区分	種類	平成27年9月28日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	674,688,326	-	648,537,380	26,150,946
	メキシコ・ペソ	28,273,524	-	27,856,858	416,666
	売建				
	アメリカ・ドル	28,273,524	-	28,102,150	171,374
	メキシコ・ペソ	674,688,326	-	626,686,785	48,001,541
合計		-	-	1,331,183,173	21,605,303

(注) 時価の算定方法

- A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。
 ・計算期間末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。
 ・計算期間末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。
- B. 計算期間末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きましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成27年3月28日 至 平成27年9月28日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 2.0416円 「1口 = 1円 (10,000口 = 20,416円)」	1口当たり純資産額 2.0311円 「1口 = 1円 (10,000口 = 20,311円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ・ドル	国債証券	ARGBON 7 04/17/17	3,815,000.000	3,670,068.150	
	国債証券	ARGBON 8.75 05/07/24	1,500,000.000	1,387,425.000	
	国債証券	BAHAMA 5.75 01/16/24	600,000.000	646,500.000	
	国債証券	BARBAD 6.625 12/05/35	200,000.000	177,588.000	
	国債証券	BERMUD 4.854 02/06/24	305,000.000	320,250.000	
	国債証券	BRAZIL 4.25 01/07/25	1,200,000.000	1,042,500.000	
	国債証券	BRAZIL 4.875 01/22/21	200,000.000	192,000.000	
	国債証券	BRAZIL 5 01/27/45	1,059,000.000	759,832.500	
	国債証券	COLOM 4 02/26/24	1,050,000.000	1,013,250.000	
	国債証券	COLOM 4.375 07/12/21	2,100,000.000	2,144,100.000	
	国債証券	COLOM 5 06/15/45	200,000.000	170,500.000	
	国債証券	COLOM 6.125 01/18/41	1,100,000.000	1,091,750.000	
	国債証券	COSTAR 7 04/04/44	200,000.000	179,500.000	
	国債証券	CROATI 6 01/26/24	300,000.000	318,750.000	
	国債証券	CROATI 6.625 07/14/20	865,000.000	947,036.600	
	国債証券	CROATI 6.75 11/05/19	315,000.000	344,137.500	
	国債証券	DOMREP 5.5 01/27/25	1,305,000.000	1,275,637.500	
	国債証券	DOMREP 6.85 01/27/45	460,000.000	449,650.000	
	国債証券	DOMREP 7.45 04/30/44	300,000.000	312,000.000	
	国債証券	DOMREP 7.5 05/06/21	600,000.000	651,000.000	
	国債証券	ECUA 10.5 03/24/20	250,000.000	193,750.000	
	国債証券	EGYPT 5.875 06/11/25	260,000.000	247,579.800	
	国債証券	ELSALV 5.875 01/30/25	460,000.000	411,700.000	
	国債証券	ELSALV 6.375 01/18/27	115,000.000	103,931.250	
	国債証券	ELSALV 6.375 01/18/27	750,000.000	677,812.500	
	国債証券	GABON 6.375 12/12/24	300,000.000	259,500.000	
	国債証券	GEORG 6.875 04/12/21	400,000.000	422,080.000	
	国債証券	INDOIS 4.35 09/10/24	600,000.000	570,000.000	
	国債証券	INDON 4.625 04/15/43	740,000.000	630,642.800	
	国債証券	INDON 6.625 02/17/37	1,050,000.000	1,136,478.000	
	国債証券	INDON 6.75 01/15/44	200,000.000	216,168.000	
	国債証券	IVYCST 5.375 07/23/24	2,099,000.000	1,873,042.650	
	国債証券	IVYCST 6.375 03/03/28	200,000.000	182,692.000	
	国債証券	JAMAN 6.75 04/28/28	500,000.000	507,500.000	
	国債証券	JAMAN 7.625 07/09/25	850,000.000	932,875.000	
	国債証券	JAMAN 7.875 07/28/45	400,000.000	403,000.000	
	国債証券	JMGB 8.5 11/16/21	1,238,094.760	1,342,701.380	
	国債証券	KENINT 6.875 06/24/24	500,000.000	466,030.000	
	国債証券	LITHUN 6.125 03/09/21	200,000.000	234,170.000	
	国債証券	MEX 3.6 01/30/25	900,000.000	878,625.000	
	国債証券	MEX 3.625 03/15/22	500,000.000	502,500.000	
	国債証券	MEX 4 10/02/23	1,600,000.000	1,624,000.000	
	国債証券	MONGOL 4.125 01/05/18	300,000.000	281,250.000	
国債証券	MONGOL 5.125 12/05/22	430,000.000	362,047.100		

国債証券	MOROC 4.25 12/11/22	1,375,000.000	1,395,858.750
国債証券	PKSTAN 6.75 12/03/19	1,475,000.000	1,514,456.250
国債証券	PKSTAN 7.25 04/15/19	200,000.000	207,078.000
国債証券	PKSTAN 8.25 04/15/24	200,000.000	211,398.000
国債証券	REPHUN 5.375 03/25/24	340,000.000	371,450.000
国債証券	REPHUN 5.75 11/22/23	1,070,000.000	1,197,062.500
国債証券	REPNAM 5.5 11/03/21	500,000.000	529,850.000
国債証券	ROMANI 4.375 08/22/23	786,000.000	823,272.120
国債証券	RUSSIA 4.5 04/04/22	800,000.000	793,560.000
国債証券	RUSSIA 4.875 09/16/23	400,000.000	397,492.000
国債証券	RUSSIA 5.625 04/04/42	200,000.000	184,400.000
国債証券	SENEGL 6.25 07/30/24	200,000.000	183,332.000
国債証券	SERBIA 5.25 11/21/17	1,200,000.000	1,249,500.000
国債証券	SERBIA 5.875 12/03/18	1,140,000.000	1,201,275.000
国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	2,300,000.000	2,601,875.000
国債証券	SERBIA FL 11/01/24	613,618.970	627,578.790
国債証券	SLOVEN 5.25 02/18/24	295,000.000	327,081.250
国債証券	SOAF 4.665 01/17/24	2,648,000.000	2,647,496.880
国債証券	SRILAN 5.875 07/25/22	500,000.000	493,350.000
国債証券	SRILAN 6.25 07/27/21	200,000.000	202,956.000
国債証券	SRILAN 6.25 10/04/20	200,000.000	205,484.000
国債証券	TURKEY 5.625 03/30/21	1,050,000.000	1,102,363.500
国債証券	TURKEY 6 01/14/41	250,000.000	245,957.500
国債証券	TURKEY 8 02/14/34	987,000.000	1,198,899.030
国債証券	TURKSK 4.489 11/25/24	1,150,000.000	1,098,250.000
国債証券	URUGUA 4.5 08/14/24	800,000.000	818,000.000
国債証券	VIETNM 4.8 11/19/24	800,000.000	774,400.000
国債証券	ZAMBIN 5.375 09/20/22	225,000.000	168,412.500
国債証券	ZAMBIN 8.97 07/30/27	305,000.000	256,962.500
特殊債券	ESKOM 5.75 01/26/21	875,000.000	823,558.750
特殊債券	ESKOM 6.75 08/06/23	300,000.000	284,250.000
特殊債券	ESKOM 7.125 02/11/25	1,150,000.000	1,094,397.500
特殊債券	GAZPRU 7.288 08/16/37	230,000.000	226,975.500
特殊債券	GAZPRU 8.146 04/11/18	400,000.000	430,940.000
特殊債券	PEMEX 5.5 06/27/44	400,000.000	329,432.000
特殊債券	PEMEX 6.5 06/02/41	1,119,000.000	1,054,657.500
特殊債券	VEBBNK 6.902 07/09/20	275,000.000	274,656.250
社債券	AEFES 3.375 11/01/22	400,000.000	339,540.000
社債券	AGILE 8.875 04/28/17	150,000.000	151,320.000
社債券	ALFAA 6.875 03/25/44	200,000.000	198,000.000
社債券	ALRSRU 7.75 11/03/20	200,000.000	209,708.000
社債券	AUTOPA 4.95 07/29/35	290,000.000	284,872.800
社債券	BANCO 3.875 02/08/22	200,000.000	203,964.000
社債券	BANDCR 5.25 08/12/18	275,000.000	278,437.500
社債券	BBVASM 6.5 03/10/21	325,000.000	349,375.000
社債券	BCOM 7.375 02/15/21	160,000.000	172,184.000
社債券	BCP FL 04/24/27	115,000.000	119,485.000
社債券	BHARTI 5.125 03/11/23	200,000.000	209,650.000
社債券	BRPRSA 9 PERPETUAL	300,000.000	246,000.000
社債券	BRSRBZ 7.375 02/02/22	200,000.000	153,000.000
社債券	CEMEX 9.375 10/12/22	500,000.000	542,500.000
社債券	CHMFRU 5.9 10/17/22	220,000.000	212,108.600
社債券	CIFIHG 8.875 01/27/19	200,000.000	202,620.000
社債券	DPWDU 6.85 07/02/37	490,000.000	530,425.000
社債券	ECOPET 5.875 09/18/23	150,000.000	148,500.000
社債券	ECOPET 7.375 09/18/43	190,000.000	180,025.000
社債券	EMAAR 4.564 06/18/24	200,000.000	206,120.000
社債券	EMIRAT 4.5 02/06/25	180,952.000	183,440.090
社債券	EXIMBK 4 01/14/23	1,450,000.000	1,463,470.500
社債券	FMCN 6.75 02/15/20	130,000.000	91,650.000
社債券	GARAN 6.25 04/20/21	200,000.000	207,742.000
社債券	GCCAMM 8.125 02/08/20	200,000.000	209,500.000
社債券	GCX 7 08/01/19	200,000.000	197,000.000
社債券	GEBGG 7.75 07/05/17	200,000.000	207,622.000
社債券	GGBRBZ 5.75 01/30/21	200,000.000	178,000.000
社債券	GLBL 9.75 08/15/22	175,000.000	156,625.000
社債券	HALKBK 4.875 07/19/17	375,000.000	381,127.500

社債券	HKHKD 3.875 04/08/23	400,000.000	378,816.000	
社債券	HSBKKZ 7.25 01/28/21	200,000.000	204,500.000	
社債券	ICICI FL 04/30/22	200,000.000	204,538.000	
社債券	ICTPM 5.875 09/17/25	200,000.000	215,494.000	
社債券	ISCTR 6 10/24/22	300,000.000	286,875.000	
社債券	ISRELE 6.875 06/21/23	350,000.000	399,777.000	
社債券	JAFZSK 7 06/19/19	250,000.000	286,285.000	
社債券	KTZKZ 6.95 07/10/42	300,000.000	247,110.000	
社債券	KZOKZ 5.75 04/30/43	1,550,000.000	1,185,750.000	
社債券	KZOKZ 7 05/05/20	2,450,000.000	2,573,847.500	
社債券	KZOLKZ 9.125 07/02/18	500,000.000	550,100.000	
社債券	LNGFOR 6.75 01/29/23	200,000.000	201,242.000	
社債券	LUKOIL 3.416 04/24/18	200,000.000	192,380.000	
社債券	MABEMX 7.875 10/28/19	250,000.000	275,075.000	
社債券	MRFGBZ 9.5 05/04/20	200,000.000	195,500.000	
社債券	NPNSJ 5.5 07/21/25	200,000.000	197,776.000	
社債券	PCCW 5.75 04/17/22	300,000.000	322,941.000	
社債券	PDLLN 8.25 05/31/20	400,000.000	377,500.000	
社債券	PDVSA 5.25 04/12/17	2,840,000.000	1,327,700.000	
社債券	PDVSA 8.5 11/02/17	1,530,000.000	1,028,925.000	
社債券	PEMEX 3.5 07/23/20	800,000.000	781,000.000	
社債券	PEMEX 4.25 01/15/25	900,000.000	832,500.000	
社債券	PEMEX 5.625 01/23/46	150,000.000	127,402.500	
社債券	PEMEX 5.625 01/23/46	100,000.000	82,875.000	
社債券	PERTIJ 5.625 05/20/43	950,000.000	770,032.000	
社債券	PETBRA 3 01/15/19	400,000.000	292,000.000	
社債券	PETBRA 3.25 03/17/17	200,000.000	178,500.000	
社債券	PETBRA 4.875 03/17/20	635,000.000	457,200.000	
社債券	PETBRA 5.375 01/27/21	325,000.000	229,937.500	
社債券	PETBRA 5.625 05/20/43	405,000.000	249,075.000	
社債券	PETBRA 6.75 01/27/41	215,000.000	136,740.000	
社債券	PETBRA 6.85 06/05/15	584,000.000	369,204.800	
社債券	PETBRA 7.875 03/15/19	100,000.000	84,910.000	
社債券	PETRTT 9.75 08/14/19	800,000.000	868,000.000	
社債券	PGASIJ 5.125 05/16/24	200,000.000	192,412.000	
社債券	PLNIJ 5.5 11/22/21	200,000.000	204,000.000	
社債券	PLNIJ 7.875 06/29/37	200,000.000	219,786.000	
社債券	PRECN 5.375 01/26/19	200,000.000	77,060.000	
社債券	PRECN 5.625 01/19/25	150,000.000	55,125.000	
社債券	PSALM 7.39 12/02/24	650,000.000	849,875.000	
社債券	RPCUH 6 08/31/36	200,000.000	225,250.000	
社債券	SBERRU 6.125 02/07/22	700,000.000	705,075.000	
社債券	SHIMAO 8.375 02/10/22	200,000.000	208,730.000	
社債券	SMPM 4.25 10/17/19	200,000.000	201,870.000	
社債券	SOLUIJ 6.25 02/24/20	200,000.000	192,158.000	
社債券	TBIGIJ 5.25 02/10/22	200,000.000	188,750.000	
社債券	TCZIRA 4.25 07/03/19	700,000.000	686,140.000	
社債券	TDBM 9.375 05/19/20	300,000.000	298,479.000	
社債券	VEDLN 7.125 05/31/23	200,000.000	144,640.000	
社債券	VIP 7.748 02/02/21	200,000.000	203,010.000	
社債券	VOTORA 7.25 04/05/41	400,000.000	296,000.000	
社債券	WESCHI 6.5 09/11/19	200,000.000	195,988.000	
社債券	YASARH 8.875 05/06/20	200,000.000	208,240.000	
	小計(アメリカ・ドル) 164銘柄	92,634,665.730	88,779,578.090 (10,689,061,202)	
メキシコ ・ペソ	国債証券	MBONO 10 12/05/24	27,600,000.000	35,277,216.000
	国債証券	MBONO 5 12/11/19	6,800,000.000	6,762,668.000
	国債証券	MBONO 6.5 06/09/22	14,300,000.000	14,874,431.000
	国債証券	MBONO 7.75 11/13/42	23,154,000.000	25,672,460.580
	国債証券	MBONO 8.5 12/13/18	5,300,000.000	5,881,675.000
	特殊債券	PEMEX 7.19 09/12/24	1,400,000.000	1,333,500.000
	小計(メキシコ・ペソ) 6銘柄	78,554,000.000	89,801,950.580 (637,593,849)	
	合計		11,326,655,051 (11,326,655,051)	

(注) 1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	73銘柄	85.98%
	特殊債券	8銘柄	
	社債券	83銘柄	
メキシコ・ペソ	国債証券	5銘柄	5.13%
	特殊債券	1銘柄	

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

欧州債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成27年3月27日現在 金額（円）	平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	130,493,269	4,837,420
コール・ローン	503,094	492,305
国債証券	1,016,568,121	937,393,172
特殊債券	35,763,289	36,697,515
社債券	360,607,999	345,895,168
派生商品評価勘定	8,076,902	6,830,184
未収利息	13,741,534	12,740,211
前払費用	4,588,997	3,264,308
流動資産合計	1,570,343,205	1,348,150,283
資産合計	1,570,343,205	1,348,150,283
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,616,970	6,781,966
未払金	12,878,161	-
流動負債合計	20,495,131	6,781,966
負債合計	20,495,131	6,781,966
純資産の部		
元本等		
元本	1,186,170,922	1,015,818,098
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	363,677,152	325,550,219
元本等合計	1,549,848,074	1,341,368,317
純資産合計	1,549,848,074	1,341,368,317
負債純資産合計	1,570,343,205	1,348,150,283

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 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3月28日 至 平成27年9月28日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	1,361,772,582円	1,186,170,922円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	175,601,660円	170,352,824円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,186,170,922円	1,015,818,098円
合計	1,186,170,922円	1,015,818,098円
2. 受益権の総数	1,186,170,922口	1,015,818,098口

(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3月28日 至 平成27年9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年9月28日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 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>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。</p>
------------	---

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成27年3月27日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	103,442,454
特殊債券	410,303
社債券	12,964,719
合計	116,817,476

「計算期間」とは、「欧州債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年3月28日から平成27年3月27日まで）を指しております。

（平成27年9月28日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	28,819,023
特殊債券	250,751
社債券	5,980,552
合計	35,050,326

「計算期間」とは、「欧州債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年3月28日から平成27年9月28日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（通貨関連）

区分	種類	平成27年3月27日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	イギリス・ポンド	61,736,132	-	59,797,966	1,938,166
	スイス・フラン	11,172,461	-	10,785,390	387,071
	スウェーデン・クローナ	14,523,351	-	14,268,640	254,711
	ポーランド・ズロチ	49,258,967	-	48,172,490	1,086,477
	ユーロ	99,388,142	-	95,567,017	3,821,125
	売建				
	イギリス・ポンド	37,462,630	-	36,272,700	1,189,930
	デンマーク・クローネ	8,312,880	-	7,929,840	383,040
	ノルウェー・クローネ	856,900	-	827,200	29,700
	ルーマニア・レイ	23,263,770	-	22,259,250	1,004,520
	ポーランド・ズロチ	18,312,106	-	18,060,865	251,241
	ハンガリー・フォリント	11,179,856	-	10,884,653	295,203
	ユーロ	136,690,911	-	131,897,063	4,793,848
合計	-	-	456,723,074	459,932	

区分	種類	平成27年9月28日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）

市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	イギリス・ポンド	40,782,765	-	39,429,410	1,353,355
	スイス・フラン	8,699,669	-	8,370,120	329,549
	スウェーデン・クローナ	7,579,790	-	7,429,955	149,835
	ルーマニア・レイ	4,384,726	-	4,298,445	86,281
	ポーランド・ズロチ	38,151,700	-	37,532,565	619,135
	ユーロ	152,278,070	-	148,051,670	4,226,400
	売建				
	イギリス・ポンド	38,752,905	-	37,540,041	1,212,864
	スイス・フラン	514,880	-	492,360	22,520
	デンマーク・クローネ	16,470,740	-	16,010,020	460,720
	ノルウェー・クローネ	1,103,273	-	1,029,405	73,868
	スウェーデン・クローナ	30,006,203	-	29,265,247	740,956
	ルーマニア・レイ	37,187,662	-	36,044,163	1,143,499
	ポーランド・ズロチ	28,242,407	-	27,074,464	1,167,943
	ユーロ	99,598,650	-	97,608,247	1,990,403
	合計	-	-	490,176,112	48,218

(注) 時価の算定方法

- A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。
 ・計算期間末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。
 ・計算期間末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。
- B. 計算期間末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きましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成27年3月28日 至 平成27年9月28日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 1.3066円 「1口 = 1円 (10,000口 = 13,066円)」	1口当たり純資産額 1.3205円 「1口 = 1円 (10,000口 = 13,205円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
イギリス ・ポンド	国債証券	UKT 4.25 12/07/27	89,000.000	110,903.790	
	国債証券	UKT 4.25 12/07/46	187,000.000	256,876.290	
	国債証券	UKT 4.75 12/07/38	189,000.000	264,274.920	
	国債証券	UKT 5 03/07/25	128,000.000	164,478.720	
	特殊債券	ICO 1.875 12/15/17	200,000.000	200,500.000	
	社債券	DEXGRP 1.875 07/17/17	200,000.000	202,080.000	
	小計(イギリス・ポンド) 6銘柄			993,000.000	1,199,113.720 (219,473,784)
デンマ ーク・ク ローネ	国債証券	DGB 4.5 11/15/39	240,000.000	394,096.800	
	社債券	RDKRE 2 04/01/24	400,000.000	412,012.000	
	小計(デンマーク・クローネ) 2銘柄			640,000.000	806,108.800 (14,566,386)
ノル ウェー・ クローネ	国債証券	NGB 4.25 05/19/17	541,000.000	573,795.420	
	小計(ノルウェー・クローネ) 1銘柄			541,000.000	573,795.420 (8,107,729)
スウェ ーデン・ク ローナ	社債券	NDASS 1 04/08/22	800,000.000	778,112.000	
	社債券	SEB 1.5 06/17/20	1,500,000.000	1,536,525.000	
	小計(スウェーデン・クローナ) 2銘柄			2,300,000.000	2,314,637.000 (33,145,601)
ルーマ ニア・レイ	国債証券	ROMGB 5.85 04/26/23	880,000.000	1,026,097.600	
	小計(ルーマニア・レイ) 1銘柄			880,000.000	1,026,097.600 (31,357,542)
ロシア・ ルーブル	国債証券	RFLB 7.5 02/27/19	5,863,000.000	5,297,220.500	
	小計(ロシア・ルーブル) 1銘柄			5,863,000.000	5,297,220.500 (9,746,885)

ポーランド・ズロチ	国債証券	POLGB 1.5 04/25/20	420,000.000	404,577.600	
	国債証券	POLGB 3.25 07/25/25	350,000.000	362,596.500	
	小計(ポーランド・ズロチ) 2銘柄		770,000.000	767,174.100 (24,488,197)	
ユーロ	国債証券	BGARIA 2.625 03/26/27	120,000.000	113,640.000	
	国債証券	BGB 0.8 06/22/25	48,000.000	47,295.360	
	国債証券	BGB 4.25 03/28/41	62,000.000	92,797.260	
	国債証券	BGB 4.25 09/28/22	55,000.000	69,400.100	
	国債証券	BGB 5 03/28/35	49,000.000	76,063.190	
	国債証券	BTPS 1.5 06/01/25	463,000.000	451,716.690	
	国債証券	BTPS 1.7 09/15/18	187,000.000	199,480.950	
	国債証券	BTPS 3.5 12/01/18	236,000.000	259,128.000	
	国債証券	BTPS 4.25 03/01/20	135,000.000	155,849.400	
	国債証券	BTPS 4.5 02/01/20	221,000.000	256,910.290	
	国債証券	BTPS 4.75 09/01/28	85,000.000	109,702.700	
	国債証券	BTPS 4.75 09/01/44	132,000.000	181,745.520	
	国債証券	BTPS 5 08/01/39	46,000.000	64,319.500	
	国債証券	BTPS 5 09/01/40	56,000.000	78,181.600	
	国債証券	BTPS 5.75 02/01/33	19,000.000	27,917.460	
	国債証券	CHILE 1.625 01/30/25	100,000.000	98,625.000	
	国債証券	CROAT1 5.875 07/09/18	100,000.000	110,250.000	
	国債証券	CYPRUS 3.875 05/06/22	105,000.000	106,547.700	
	国債証券	DBR 2.5 07/04/44	150,000.000	191,739.000	
	国債証券	DBR 3.25 07/04/21	72,000.000	85,087.440	
	国債証券	FRTR 3.25 05/25/45	104,000.000	134,204.720	
	国債証券	FRTR 3.5 04/25/26	190,000.000	236,314.400	
	国債証券	FRTR 3.75 04/25/21	110,000.000	131,197.000	
	国債証券	FRTR 4.25 10/25/18	168,000.000	190,354.080	
	国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	96,000.000	155,924.160	
	国債証券	INDON 2.875 07/08/21	149,000.000	144,902.500	
	国債証券	INDON 3.375 07/30/25	100,000.000	94,098.000	
	国債証券	IRISH 5.4 03/13/25	161,000.000	220,270.540	
	国債証券	ISRAEL 2.875 01/29/24	100,000.000	110,320.000	
	国債証券	MEX 3.625 04/09/29	100,000.000	104,727.000	
	国債証券	MONTEN FL 12/09/16	56,000.000	56,330.400	
	国債証券	MOROC 3.5 06/19/24	100,000.000	101,500.000	
	国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	183,000.000	278,086.800	
	国債証券	PGB 5.65 02/15/24	67,000.000	83,791.540	
	国債証券	SLOREP 1.5 03/25/35	60,000.000	51,448.200	
	国債証券	SLOREP 5.125 03/30/26	143,000.000	186,496.310	
	国債証券	SLOVEN 2.125 07/28/25	30,000.000	30,952.200	
	国債証券	SPGB 5.9 07/30/26	138,000.000	186,330.360	
	社債券	ADRBID 7.875 11/15/20	100,000.000	105,000.000	
	社債券	ALTICE 9 06/15/23	100,000.000	114,240.000	
	社債券	ARION 3.125 03/12/18	225,000.000	227,241.000	
	社債券	BALTAL 7.75 09/15/22	100,000.000	101,375.000	
	社債券	C FL 02/25/30	20,000.000	22,785.400	
	社債券	DEXGRP 0.625 01/21/22	50,000.000	49,843.500	
	社債券	EIBKOR 2 04/30/20	160,000.000	168,649.600	
	社債券	HETAR 2.375 12/13/22	300,000.000	318,873.000	
	社債券	ISPIM 4.125 04/14/20	50,000.000	55,631.000	
	社債券	LABFP 8.25 07/01/23	100,000.000	100,225.000	
	社債券	LOXAM 7 07/23/22	100,000.000	102,354.000	
	社債券	MONTE 3.5 03/20/17	100,000.000	104,241.000	
	社債券	NWIDE 6.75 07/22/20	50,000.000	61,348.500	
	社債券	PEMEX 2.75 04/21/27	110,000.000	92,479.200	
	社債券	PSMGR 2.625 04/15/21	7,000.000	7,210.700	
	社債券	SYMRIS 1.75 07/10/19	35,000.000	35,903.700	
	社債券	TITIM 5.25 02/10/22	50,000.000	56,387.500	
	社債券	UNICZ 0.625 04/30/20	100,000.000	99,152.000	
	社債券	VW FL PERPETUAL	8,000.000	7,250.960	
	社債券	WINDIM 7 04/23/21	100,000.000	100,750.000	
	社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	59,842.500	
小計(ユーロ) 59銘柄		6,411,000.000	7,264,428.930 (979,099,731)		
合計				1,319,985,855 (1,319,985,855)	

- (注) 1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	16.36%	16.63%
	特殊債券 1銘柄		
	社債券 1銘柄		
デンマーク・クローネ	国債証券 1銘柄	1.09%	1.10%
	社債券 1銘柄		
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.60%	0.61%
スウェーデン・クローナ	社債券 2銘柄	2.47%	2.51%
ルーマニア・レイ	国債証券 1銘柄	2.34%	2.38%
ロシア・ルーブル	国債証券 1銘柄	0.73%	0.74%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	1.82%	1.86%
ユーロ	国債証券 38銘柄	72.99%	74.17%
	社債券 21銘柄		

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

アジア・オセアニア債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成27年3月27日現在 金額（円）	平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	108,762,729	154,729,645
コール・ローン	13,351,539	3,873,206
国債証券	374,474,793	311,113,444
特殊債券	1,072,029,221	892,815,225
未収利息	11,763,590	10,509,628
前払費用	4,781	-
流動資産合計	1,580,386,653	1,373,041,148
資産合計	1,580,386,653	1,373,041,148
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1,089,741,708	1,035,297,717
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	490,644,945	337,743,431
元本等合計	1,580,386,653	1,373,041,148
純資産合計	1,580,386,653	1,373,041,148
負債純資産合計	1,580,386,653	1,373,041,148

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 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3月28日 至 平成27年9月28日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	1,262,166,614円	1,089,741,708円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	172,424,906円	54,443,991円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,089,741,708円	1,035,297,717円
合計	1,089,741,708円	1,035,297,717円
2. 受益権の総数	1,089,741,708口	1,035,297,717口

(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3月28日 至 平成27年9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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	平成27年9月28日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 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>(2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。</p>
------------	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成27年3月27日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	7,296,899
特殊債券	30,376,047
合計	37,672,946

「計算期間」とは、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年3月28日から平成27年3月27日まで）を指しております。

（平成27年9月28日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,717,575
特殊債券	1,422,493
合計	295,082

「計算期間」とは、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年3月28日から平成27年9月28日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成27年3月27日現在）

該当事項はありません。

（平成27年9月28日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成27年3月28日 至 平成27年9月28日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 1.4502円 「1口 = 1円（10,000口 = 14,502円）」	1口当たり純資産額 1.3262円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,262円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
オーストラリア・ドル	特殊債券	ASIA 3.5 07/25/18	5,000,000.000	5,161,600.000	
	小計（オーストラリア・ドル）1銘柄		5,000,000.000	5,161,600.000 (436,826,208)	
香港・ドル	国債証券	HKGB 2.44 12/07/20	4,800,000.000	5,124,480.000	
	小計（香港・ドル）1銘柄		4,800,000.000	5,124,480.000 (79,583,174)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.5 06/01/19	850,000.000	869,125.000	
	小計（シンガポール・ドル）1銘柄		850,000.000	869,125.000 (73,414,989)	
ニュージーランド・ドル	特殊債券	EIB 7.5 12/15/17	2,300,000.000	2,515,740.000	
	特殊債券	NIB 4.875 01/22/19	900,000.000	951,345.000	
	特殊債券	RENTEN 4 01/30/20	2,400,000.000	2,470,272.000	
	小計（ニュージーランド・ドル）3銘柄		5,600,000.000	5,937,357.000 (455,989,017)	
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 4.25 06/10/21	900,000,000.000	1,016,901,000.000	
	小計（韓国・ウォン）1銘柄		900,000,000.000	1,016,901,000.000 (102,707,001)	
マレーシア・リンギット	国債証券	MGS 4.262 09/15/16	2,000,000.000	2,022,200.000	
	小計（マレーシア・リンギット）1銘柄		2,000,000.000	2,022,200.000 (55,408,280)	
合計				1,203,928,669 (1,203,928,669)	

- (注) 1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
オーストラリア・ドル	特殊債券 1 銘柄	31.81%	36.28%
香港・ドル	国債証券 1 銘柄	5.80%	6.61%
シンガポール・ドル	国債証券 1 銘柄	5.35%	6.10%
ニュージーランド・ドル	特殊債券 3 銘柄	33.21%	37.88%
韓国・ウォン	国債証券 1 銘柄	7.48%	8.53%
マレーシア・リングgit	国債証券 1 銘柄	4.03%	4.60%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

コモディティ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成27年3月27日現在 金額（円）	平成27年9月28日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,657,432	2,468,141
社債券	749,358,836	666,464,809
未収利息	1,297,892	2,846,657
流動資産合計	753,314,160	671,779,607
資産合計	753,314,160	671,779,607
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1,157,510,867	1,157,528,386
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	404,196,707	485,748,779
元本等合計	753,314,160	671,779,607
純資産合計	753,314,160	671,779,607
負債純資産合計	753,314,160	671,779,607

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 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 3月28日 至 平成27年 9月28日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成27年 3月27日現在	平成27年 9月28日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	1,157,481,362円	1,157,510,867円
期中追加設定元本額	29,505円	17,519円
期中一部解約元本額	-	-
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,157,510,867円	1,157,528,386円
合計	1,157,510,867円	1,157,528,386円
2. 受益権の総数	1,157,510,867口	1,157,528,386口
3. 元本の欠損	404,196,707円	485,748,779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 3月28日 至 平成27年 9月28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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
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拠った場合、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	平成27年 9月28日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	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。

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。
------------	---

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成27年3月27日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
社 債 券	132,539,682
合計	132,539,682

「計算期間」とは、「コモディティ・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年3月28日から平成27年3月27日まで）を指しております。

（平成27年9月28日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
社 債 券	90,628,451
合計	90,628,451

「計算期間」とは、「コモディティ・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年3月28日から平成27年9月28日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成27年3月27日現在）

該当事項はありません。

（平成27年9月28日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成27年3月28日 至 平成27年9月28日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年3月27日現在	平成27年9月28日現在
1口当たり純資産額 0.6508円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,508円）」	1口当たり純資産額 0.5804円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,804円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ・ドル	社債券	BCOM/BARCLAYS 10/20/15	7,400,000.000	5,535,422.000	
	小計（アメリカ・ドル）1銘柄		7,400,000.000	5,535,422.000 (666,464,809)	
合計				666,464,809 (666,464,809)	

（注）1. 各種通貨ごとの小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	社債券 1銘柄	99.20%	100.00%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

（参考）

T.Rowe Price Funds SICAV（以下、同ファンド）は、ルクセンブルグ大公国の法律に基づき組成されたオープン・エンド型の変動資本金会社型投資信託であり、「2010年12月17日の集団投資事業に関する法律のパート」に従って認可されています。

同ファンドの2015年6月30日現在の財務諸表は、ルクセンブルグ大公国において一般に認められる会計基準に準拠して作成されています。

同ファンドの「貸借対照表」、「損益および純資産変動計算書」、「投資証券口数変動計算書」、「一口当たり純資産額および純資産推移」および「有価証券明細表」等は、2015年6月30日現在の財務諸表の原文を委託会社で抜粋・翻訳したものです。

T.ロウ・プライス・ファンズ SICAV

貸借対照表

2015年6月30日現在（未監査）

	エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド*	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	USアグリゲート・ボンド・ファンド
	米ドル	米ドル	米ドル
資 産			
有価証券（取得原価）	1,180,813,188	1,758,498,284	162,864,181
評価（損）益	116,600,829	(17,644,448)	(9,903,421)
有価証券（時価）	1,297,414,017	1,740,853,836	152,960,760
TBA取引（時価）	-	-	9,232,992
現金預金	23,374,73551	37,770,945	12,894,137
有価証券売却に係る未収入金	246,639	8,434,950	53,245
未収配当金および未収利息	5,597,599	29,587,409	880,768
発行未収金	496,230	2,354,615	72,057
為替予約取引に係る評価益	-	11,532,193	1,413,468
オプション（時価）	-	-	-
先物取引に係る評価益	-	-	49,164
スワップ契約（時価）	-	293,438	-
委託証拠金	-	-	-
その他の資産	1,880	11,155	3,248
資産合計	1,327,131,100	1,830,838,541	177,560,019
負 債			
外国税引当金	200,938	-	-
有価証券購入に係る未払金	2,010,647	11,049,766	10,288,216
買戻未払金	329,600	3,874,490	52,878
為替予約取引に係る評価損	205	11,929,127	15,180
未払運用報酬	1,152,905	1,444,239	37,353
オプション（時価）	-	-	-
スワップ契約（時価）	-	572,146	-
委託証拠金	-	-	115,467
先物取引に係る評価損	-	-	-

当座貸越		-	-
その他の負債	369,007	485,359	47,301
負債合計	4,067,302	29,355,127	10,556,395
純資産	1,323,067,798	1,801,483,414	167,003,624

*当ファンドの以前の名称は、グローバル・エマージング・マーケッツ・エクイティ・ファンド
添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

T・ロウ・プライス・ファンズ SICAV

損益および純資産変動計算書

2015年6月30日に終了した期間（未監査）

	エマージング・マー ケッツ・エクイティ・ ファンド*	グローバル・ハイ・ イールド・ボンド・ ファンド	USアグリゲート・ ボンド・ファンド
	米ドル	米ドル	米ドル
収益			
受取利息（源泉税控除後）	26,558	56,506,422	1,880,354
受取配当金（源泉税控除後）	13,703,234	492,199	1,531
スワップに係る利息	-	267,671	-
収益合計	13,729,792	57,266,292	1,881,885
費用			
運用報酬	7,157,420	7,726,067	162,047
カストディーフィー	179,214	118,476	12,292
管理会社報酬	136,945	187,124	32,179
年次税	95,596	345,257	13,836
専門家報酬	90,484	84,747	15,802
スワップに係る利息	-	191,074	63
支払利息	132	1,060	3,060
その他の費用	21,614	17,244	-
費用合計	7,681,405	8,671,049	239,279
運用会社により免除または負担された費用控除前の純（損）益	6,048,387	48,595,243	1,642,606
運用会社により免除または負担された費用	10,650	25,392	20,181
投資（損）益	6,059,037	48,620,635	1,662,787
実現（損）益の内訳：			
スイング・プライシング	1,233,109	-	25,964
有価証券(外国税控除後)	17,335,725	(2,599,474)	136,841
TBA取引	-	-	27,233
為替予約取引	(18,202)	(76,952,290)	(2,916,659)
先物取引	-	498	(128,988)
オプション	-	-	-
スワップ	-	(834,321)	(2,341)
外貨取引	(1,113,616)	(1,018,650)	(46,674)

外国税引当金の変動	-	-	-
実現（損）益計	17,437,016	(81,404,237)	(2,904,624)
評価（損）益の内訳：			
有価証券（外国税控除後）	23,111,127	1,822,904	(2,635,229)
TBA取引	-	-	(17,782)
為替予約取引	4,662	34,820,655	1,562,896
先物取引	-	-	69,568
オプション	-	-	-
スワップ	-	754,828	3,055
外貨建のその他の資産および負債	30,093	138,304	6
評価（損）益計	23,145,882	37,536,691	(1,017,486)
運用による純資産の純増(減)額	46,641,935	4,753,089	(2,259,323)
分配金：			
分配による純資産の減少額	(45,718)	(5,885,455)	(813,519)
資本取引：			
投資証券発行受領額	104,733,121	408,893,962	88,148,629
投資証券買戻支払額	(407,648,870)	(275,923,297)	(10,528,345)
資本取引による純資産の純増(減)額	(302,915,749)	132,970,665	77,620,284
純資産の増(減)額 合計	(256,319,532)	131,838,299	74,547,442
期首現在純資産	1,579,387,330	1,669,645,115	92,456,182
換算調整	-	-	-
期末現在純資産	1,323,067,798	1,801,483,414	167,003,624

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

T . ロウ・プライス・ファンズ SICAV

投資証券口数変動計算書

2015年6月30日に終了した期間（未監査）

	エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド*	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	USアグリゲート・ボンド・ファンド
(特段の注記のない限り金額は米ドル)	米ドル	米ドル	米ドル
クラスJd			
期首現在発行済投資証券	967,846	6,505,862	5,852,914
発行投資証券口数	5,881	233,143	155,713
買戻投資証券口数	(149,051)	(781,567)	(473,721)
期末現在発行済投資証券	824,676	5,957,438	5,534,906

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

T . ロウ・プライス・ファンズ SICAV

一口当たり純資産額（未監査）

	エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド*	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	USアグリゲート・ボンド・ファンド
(特段の注記のない限り金額は米ドル)	米ドル	米ドル	米ドル

以下の時点のクラスJd証券一口当たり純資産額：

2015年6月30日	7.44	9.98	10.79
2014年12月31日	7.23	9.93	10.92
2013年12月31日	7.15	10.35	10.63

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表

Emerging Markets Equity Fund

2015年6月30日現在(未監査)

銘柄名	通貨	株数	評価額 (米ドル)	対純資産比率 (%)
公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券				
株式				
ブラジル				
Banco Bradesco SA Preference	BRL	849,938	7,818,958	0.59
BR Malls Participacoes SA	BRL	3,189,500	14,922,962	1.13
BRF SA	BRL	261,612	5,514,019	0.42
CCR SA	BRL	1,106,900	5,436,100	0.41
Itau Unibanco Holding SA Preference	BRL	3,204,114	35,493,283	2.68
Lojas Renner SA	BRL	1,101,200	40,773,999	3.08
Petroleo Brasileiro SA, ADR Preference	USD	894,100	7,421,030	0.56
Petroleo Brasileiro SA, ADR	USD	213,100	1,955,192	0.15
Raia Drogasil SA	BRL	836,800	10,263,227	0.78
			129,598,770	9.80
ケイマン諸島				
58.com, Inc., ADR	USD	106,400	6,875,568	0.52
Alibaba Group Holding Ltd., ADR	USD	113,563	9,400,745	0.71
ASM Pacific Technology Ltd.	HKD	945,700	9,362,541	0.71
Baidu, Inc., ADR	USD	176,200	35,620,592	2.69
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	HKD	621,000	3,096,678	0.23
Hengan International Group Co. Ltd.	HKD	222,500	2,643,030	0.20
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	HKD	3,213,000	6,996,277	0.53
Tencent Holdings Ltd.	HKD	2,422,300	48,300,753	3.65
Vipshop Holdings Ltd., ADR	USD	395,100	8,771,220	0.66
Want Want China Holdings Ltd.	HKD	9,609,000	10,169,168	0.77
			141,236,572	10.67
チリ				
Banco Santander Chile, ADR	USD	181,343	3,650,435	0.28
SACI Falabella	CLP	1,035,597	7,287,000	0.55
			10,937,435	0.83
中国				
BAIC Motor Corp. Ltd. Class H, 144A	HKD	4,180,500	5,033,764	0.38
Bank of China Ltd. Class H	HKD	18,341,100	11,937,004	0.90
China Longyuan Power Group Corp. Ltd. Class H	HKD	6,827,000	7,599,937	0.57
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. Class H	HKD	1,198,600	5,759,670	0.44
China Vanke Co. Ltd. Class H	HKD	1,266,750	3,120,013	0.24
China Vanke Co. Ltd. Class A	CNY	2,619,883	6,133,489	0.46

Dongfeng Motor Group Co. Ltd. Class H	HKD	6,206,000	8,330,025	0.63
Huaneng Renewables Corp. Ltd. Class H	HKD	16,622,000	6,706,231	0.51
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Class H	HKD	20,851,445	16,581,124	1.25
Kweichow Moutai Co. Ltd. Class A	CNY	165,914	6,894,503	0.52
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Class H	HKD	2,500,300	33,810,158	2.56
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Class A	CNY	193,100	2,551,346	0.19
			114,457,264	8.65

コロンビア

Grupo Aval Acciones y Valores SA, ADR				
Preference	USD	676,800	6,639,408	0.50
			6,639,408	0.50

香港

AIA Group Ltd.	HKD	5,469,400	35,785,349	2.70
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	HKD	2,634,500	19,820,105	1.50
China Unicom Hong Kong Ltd.	HKD	5,598,000	8,823,823	0.67
CNOOC Ltd.	HKD	10,433,000	14,794,939	1.12
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	HKD	2,820,000	2,786,848	0.21
Techtronic Industries Co. Ltd.	HKD	1,223,500	4,012,669	0.30
			86,023,733	6.50

インド

Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	INR	1,943,962	9,395,727	0.71
Axis Bank Ltd.	INR	1,956,720	17,156,507	1.30
Container Corp. Of India Ltd.	INR	295,789	7,794,133	0.59
Glenmark Pharmaceuticals Ltd.	INR	516,174	8,055,681	0.61
Housing Development Finance Corp. Ltd.	INR	1,041,086	21,193,435	1.60
ICICI Bank Ltd.	INR	3,495,769	16,901,392	1.28
Infosys Ltd.	INR	1,883,245	29,112,015	2.20
Maruti Suzuki India Ltd.	INR	148,731	9,779,988	0.74
Power Grid Corp. of India Ltd.	INR	3,196,328	6,982,380	0.53
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	INR	501,220	6,885,493	0.52
Tata Consultancy Services Ltd.	INR	205,056	8,208,255	0.62
Tata Motors Ltd.	INR	1,522,405	10,365,489	0.78
			151,830,495	11.48

インドネシア

Astra International Tbk. PT	IDR	22,076,600	11,732,082	0.89
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	8,000,000	8,096,153	0.61

Bank Mandiri Persero Tbk. PT	IDR	13,312,283	10,029,257	0.76
Matahari Department Store Tbk. PT	IDR	5,889,000	7,306,250	0.55
			37,163,742	2.81
ルクセンブルグ				
Tenaris SA, ADR	USD	251,500	6,825,710	0.52
			6,825,710	0.52
マレーシア				
Astro Malaysia Holdings Bhd.	MYR	7,658,900	6,247,542	0.47
			6,247,542	0.47
メキシコ				
Grupo Financiero Santander Mexico SAB de CV, ADR Class B	USD	1,104,000	10,156,800	0.77
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	MXN	7,582,940	18,436,021	1.39
			28,592,821	2.16
オランダ				
Yandex NV Class A	USD	254,000	3,830,320	0.29
			3,830,320	0.29
フィリピン				
BDO Unibank, Inc.	PHP	4,114,240	9,888,861	0.75
GT Capital Holdings, Inc.	PHP	387,780	11,751,097	0.89
SM Investments Corp.	PHP	674,712	13,389,584	1.01
Universal Robina Corp.	PHP	3,283,810	14,125,508	1.07
			49,155,050	3.72
カタール				
Qatar National Bank SAQ	QAR	131,966	6,990,592	0.53
			6,990,592	0.53
ロシア				
Magnit PJSC, Reg. S, GDR	USD	566,434	30,927,296	2.34
Sberbank of Russia, ADR	USD	3,266,396	16,959,128	1.28
			47,886,424	3.62
南アフリカ				
Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	ZAR	699,460	20,703,142	1.57
FirstRand Ltd.	ZAR	2,067,322	9,138,236	0.69
Mr Price Group Ltd.	ZAR	437,284	8,986,578	0.68
Naspers Ltd. Class N	ZAR	68,133	10,610,082	0.80
Sanlam Ltd.	ZAR	3,097,820	17,030,114	1.29
Shoprite Holdings Ltd.	ZAR	1,521,775	21,602,899	1.63
Woolworths Holdings Ltd.	ZAR	2,340,418	19,049,332	1.44
			107,120,383	8.10
韓国				
Hyundai Glovis Co. Ltd.	KRW	25,499	4,607,666	0.35

Hyundai Motor Co.	KRW	125,692	15,291,846	1.15
LG Household & Health Care Ltd.	KRW	28,083	19,444,236	1.47
NAVER Corp.	KRW	21,531	12,233,844	0.92
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	32,205	36,595,213	2.77
SK Hynix, Inc.	KRW	427,903	16,222,626	1.23
			104,395,431	7.89
スイス				
Cie Financiere Richemont SA	ZAR	1,149,543	9,459,486	0.71
			9,459,486	0.71
台湾				
Catcher Technology Co. Ltd.	TWD	1,858,000	23,228,452	1.75
China Life Insurance Co. Ltd.	TWD	7,502,000	7,664,479	0.58
Delta Electronics, Inc.	TWD	2,129,000	10,887,947	0.82
Quanta Computer, Inc.	TWD	4,237,000	10,000,236	0.76
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	12,139,050	55,144,376	4.17
Uni-President Enterprises Corp.	TWD	12,939,484	22,886,377	1.73
			129,811,867	9.81
タイ				
CP ALL PCL	THB	5,618,000	7,691,903	0.58
Kasikornbank PCL, NVDR	THB	2,812,900	15,727,942	1.19
Siam Cement PCL (The), NVDR	THB	398,700	6,129,573	0.46
			29,549,418	2.23
トルコ				
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S	TRY	342,945	3,125,250	0.24
BIM Birlesik Magazalar A/S	TRY	752,711	13,423,698	1.01
Turkiye Garanti Bankasi A/S	TRY	1,563,476	4,875,826	0.37
Turkiye Halk Bankasi A/S	TRY	901,719	4,108,673	0.31
			25,533,447	1.93
アラブ首長国連邦				
DP World Ltd.	USD	581,306	12,439,948	0.94
Emaar Malls Group PJSC	AED	3,583,202	3,258,521	0.25
First Gulf Bank PJSC	AED	1,199,350	4,963,548	0.37
			20,662,017	1.56
イギリス				
Fresnillo PLC	GBP	459,597	5,024,741	0.38
SABMiller PLC	ZAR	498,477	25,956,708	1.96
			30,981,449	2.34
アメリカ				
MercadoLibre, Inc.	USD	46,000	6,571,560	0.49

Southern Copper Corp.	USD	197,300	5,913,081	0.45
			12,484,641	0.94
株式 計			1,297,414,017	98.06
公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 計			1,297,414,017	98.06
有価証券 計			1,297,414,017	98.06

為替予約取引

買い	金額	売り	金額	決済日	評価(損)益 (米ドル)	対純資産比率 (%)
ZAR	9,724,538	USD	799,789	01/07/2015	(205)	-
為替予約取引に係る評価損 計					(205)	-

取引相手方	評価(損)益
Citibank	(159)
J.P. Morgan	(46)
	(205)

現金	23,374,735	1.77
その他資産(負債)	2,279,046	0.17
純資産 計	1,323,067,798	100.00

国別投資比率	対純資産比率(%)
インド	11.48
ケイマン諸島	10.67
台湾	9.81
ブラジル	9.80
中国	8.65
南アフリカ	8.10
韓国	7.89
香港	6.50
フィリピン	3.72
ロシア	3.62
インドネシア	2.81
イギリス	2.34
タイ	2.23
メキシコ	2.16
トルコ	1.93
アラブ首長国連邦	1.56
南アフリカ	0.94
チリ	0.83
スイス	0.71

カタール	0.53
ルクセンブルグ	0.52
コロンビア	0.50
マレーシア	0.47
オランダ	0.29
有価証券 計	98.06
現金その他資産（負債）	1.94
合計	100.00

通貨

AED:	アラブ首長国連邦・ディルハム
BRL:	ブラジル・リアル
CLP:	チリ・ペソ

CNY:	中国・人民元
GBP:	イギリス・ポンド
HKD:	香港・ドル
IDR:	インドネシア・ルピア
INR:	インド・ルピー
KRW:	韓国・ウォン
MXN:	メキシコ・ペソ
MYR:	マレーシア・リングgit
PHP:	フィリピン・ペソ
QAR:	カタール・リヤル
THB:	タイ・バーツ
TRY:	トルコ・リラ
TWD:	タイ・バーツ
USD:	米ドル
ZAR:	南アフリカ・ランド

T.ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドから提供を受けた情報をもとに作成しております。
*対純資産比率は、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンドの純資産に対する比率
*添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表

Global High Yield Bond Fund

2015年6月30日現在（未監査）

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 (米ドル)	対純資産比率 (%)
公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券				
債券				
バミューダ				
Aircastle Ltd. 5.5% 15/02/2022	USD	2,225,000	2,285,553	0.13
			2,285,553	0.13
カナダ				
First Quantum Minerals Ltd., 144A 7.25% 15/10/2019	USD	1,075,000	1,077,687	0.06
First Quantum Minerals Ltd., Reg. S 7.25%				
15/05/2022	USD	3,425,000	3,279,438	0.18
Pacific Rubiales Energy Corp., Reg. S 5.375%				
26/01/2019	USD	5,825,000	4,822,925	0.27
			9,180,050	0.51
ケイマン諸島				
Brakes Capital, Reg. S 7.125% 15/12/2018	GBP	1,100,000	1,780,921	0.10
CAR, Inc., Reg. S 6.125% 04/02/2020	USD	1,720,000	1,750,564	0.10
Mizzen Bondco Ltd., Reg. S 7% 01/05/2021	GBP	1,988,700	3,086,751	0.17
Wynn Macau Ltd., 144A 5.25% 15/10/2021	USD	200,000	190,943	0.01
			6,809,179	0.38
チェコ共和国				
RPG Byty Sro, Reg. S 6.75% 01/05/2020	EUR	2,800,000	3,310,395	0.18
			3,310,395	0.18
フランス				
CGG SA 7.75% 15/05/2017	USD	1,650,000	1,617,000	0.09
Europcar Groupe SA, Reg. S 11.5% 15/05/2017	EUR	2,625,000	3,283,246	0.18
Europcar Groupe SA, Reg. S 5.75% 15/06/2022	EUR	1,775,000	2,034,526	0.11
Holding Medi-Partenaires SAS, Reg. S 7% 15/05/2020	EUR	2,950,000	3,522,179	0.20
Loxam SAS, Reg. S 7% 23/07/2022	EUR	2,400,000	2,734,540	0.15
Numericable-SFR SAS, Reg. S 6.25% 15/05/2024	USD	6,615,000	6,544,154	0.36
			19,735,645	1.09
ドイツ				
Kirk Beauty Zero GmbH, Reg. S 6.25% 15/07/2022	EUR	775,000	862,338	0.05
KraussMaffei Group GmbH, Reg. S 8.75% 15/12/2020	EUR	2,362,500	2,842,529	0.16
Safari Holding Verwaltungs GmbH, Reg. S 8.25%				
15/02/2021	EUR	1,925,000	2,279,680	0.13
WEPA Hygieneprodukte GmbH, Reg. S 6.5% 15/05/2020	EUR	825,000	990,592	0.05
			6,975,139	0.39

アイルランド

Ardagh Packaging Finance PLC, Reg. S 6.25%				
31/01/2019	USD	575,000	586,500	0.03
Vimpel Communications OJSC, Reg. S 7.748%				
02/02/2021	USD	4,000,000	4,034,640	0.23
			4,621,140	0.26

イタリア

Cerved Group SpA, Reg. S 6.375% 15/01/2020				
	EUR	975,000	1,144,450	0.06
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 8% Perpetual				
	USD	1,800,000	1,768,293	0.10
			2,912,743	0.16

カザフスタン

Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC, Reg. S 7.25%				
03/05/2017	USD	3,685,000	3,818,176	0.21
Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC, Reg. S 7.25%				
28/01/2021	USD	640,000	662,317	0.04
			4,480,493	0.25

ルクセンブルグ

Altice Financing SA, Reg. S 6.5% 15/01/2022				
	USD	6,400,000	6,398,016	0.36
Altice Finco SA, Reg. S 9.875% 15/12/2020				
	USD	3,800,000	4,175,155	0.23
Altice Finco SA, 144A 8.125% 15/01/2024				
	USD	2,625,000	2,715,563	0.15
Altice SA, Reg. S 7.75% 15/05/2022				
	USD	7,500,000	7,329,825	0.41
ArcelorMittal 10.6% 01/06/2019				
	USD	2,850,000	3,421,895	0.19
Bormioli Rocco Holdings SA, Reg. S 10% 01/08/2018				
	EUR	3,200,000	3,658,203	0.20
Cirsa Funding Luxembourg SA, Reg. S 8.75%				
15/05/2018	EUR	1,487,030	1,709,214	0.10
Cirsa Funding Luxembourg SA, Reg. S 5.875%				
15/05/2023	EUR	2,475,000	2,688,295	0.15
Gestamp Funding Luxembourg SA, Reg. S 5.625%				
31/05/2020	USD	1,775,000	1,834,862	0.10
Magnolia BC SA, Reg. S 9% 01/08/2020				
	EUR	3,035,000	3,627,710	0.20
Millicom International Cellular SA, Reg. S 6.625%				
15/10/2021	USD	1,200,000	1,236,372	0.07
Play Topco SA, Reg. S 7.75% 28/02/2020				
	EUR	3,175,000	3,647,917	0.20
SIG Combibloc Holdings SCA, Reg. S 7.75% 15/02/2023				
	EUR	5,725,000	6,703,788	0.37
Trinseo Materials Operating SCA, 144A 6.375%				
01/05/2022	EUR	825,000	923,917	0.05
Trinseo Materials Operating SCA, 144A 6.75%				
01/05/2022	USD	1,200,000	1,222,200	0.07
Vimpel Communications OJSC, Reg. S 8.25% 23/05/2016				
	USD	4,125,000	4,282,142	0.24
Wind Acquisition Finance SA, Reg. S 4.75%				
15/07/2020	USD	4,025,000	4,012,140	0.22

Wind Acquisition Finance SA, Reg. S 7.375%				
23/04/2021	USD	8,350,000	8,524,390	0.47
			68,111,604	3.78
オランダ				
LGE HoldCo VI BV, Reg. S 7.125% 15/05/2024	EUR	3,300,000	4,122,889	0.23
Nyrstar Netherlands Holdings BV, Reg. S 8.5%				
15/09/2019	EUR	3,575,000	4,180,864	0.23
Polish Television Holding BV, Reg. S 11% 15/01/2021	EUR	4,175,000	5,585,194	0.31
Schaeffler Holding Finance BV, Reg. S 6.25%				
15/11/2019	USD	1,400,000	1,502,473	0.08
United Group BV, Reg. S 7.875% 15/11/2020	EUR	2,675,000	3,171,911	0.18
UPC Holding BV, Reg. S 6.75% 15/03/2023	CHF	1,900,000	2,224,291	0.12
UPC Holding BV, Reg. S 6.75% 15/03/2023	EUR	3,625,000	4,424,051	0.25
VimpelCom Holdings BV, Reg. S 5.2% 13/02/2019	USD	1,675,000	1,606,400	0.09
			26,818,073	1.49
スウェーデン				
Ciech Group Financing AB, Reg. S 9.5% 30/11/2019	EUR	2,550,000	3,119,844	0.17
Dometic Group AB, Reg. S 9.5% 26/06/2019	EUR	3,850,000	4,365,510	0.24
Norcell Sweden Holding 2 AB, Reg. S 10.75%				
29/09/2019	EUR	1,576,250	1,919,586	0.11
			9,404,940	0.52
イギリス				
Arqiva Broadcast Finance PLC, Reg. S 9.5%				
31/03/2020	GBP	7,325,000	12,760,023	0.71
Boparan Finance PLC, Reg. S 5.25% 15/07/2019	GBP	2,325,000	3,478,822	0.19
Cleopatra Finance Ltd., 144A 6.25% 15/02/2022	USD	2,550,000	2,452,195	0.14
Ephios Bondco PLC, Reg. S 6.25% 01/07/2022	EUR	3,200,000	3,504,265	0.19
Infinis PLC, Reg. S 7% 15/02/2019	GBP	2,075,000	3,413,204	0.19
International Game Technology PLC, 144A 6.5%				
15/02/2025	USD	3,675,000	3,419,734	0.19
Kerling PLC, Reg. S 10.625% 01/02/2017	EUR	2,700,000	3,097,705	0.17
Matalan Finance PLC, Reg. S 6.875% 01/06/2019	GBP	3,525,000	5,434,494	0.30
New Look Secured Issuer PLC, Reg. S 6.5% 01/07/2022	GBP	2,325,000	3,581,560	0.20
New Look Senior Issuer PLC, Reg. S 8% 01/07/2023	GBP	1,750,000	2,696,418	0.15
OTE PLC 4.625% 20/05/2016	EUR	3,300,000	3,487,567	0.19
Virgin Media Finance PLC, Reg. S 7% 15/04/2023	GBP	2,750,000	4,631,482	0.26
			51,957,469	2.88
アメリカ				
AES Corp. 5.5% 15/03/2024	USD	4,075,000	3,968,296	0.22
AGCO Corp. 5.875% 01/12/2021	USD	3,000,000	3,370,155	0.19
AK Steel Corp. 7.625% 01/10/2021	USD	4,875,000	3,902,535	0.22

AK Steel Corp. 8.375% 01/04/2022	USD	2,350,000	1,938,750	0.11
Antero Resources Corp. 6% 01/12/2020	USD	4,275,000	4,359,239	0.24
Antero Resources Corp. 5.125% 01/12/2022	USD	9,100,000	8,721,076	0.48
Atwood Oceanics, Inc. 6.5% 01/02/2020	USD	4,000,000	3,840,000	0.21
Bill Barrett Corp. 7.625% 01/10/2019	USD	4,350,000	4,141,526	0.23
Bill Barrett Corp. 7% 15/10/2022	USD	1,025,000	933,052	0.05
Boise Cascade Co. 6.375% 01/11/2020	USD	4,700,000	4,976,125	0.28
Boyd Gaming Corp. 6.875% 15/05/2023	USD	2,775,000	2,839,630	0.16
Calpine Corp. 5.375% 15/01/2023	USD	8,625,000	8,450,258	0.47
CenturyLink, Inc. 5.625% 01/04/2020	USD	1,225,000	1,234,727	0.07
CenturyLink, Inc. 6.45% 15/06/2021	USD	2,225,000	2,260,289	0.13
Chesapeake Energy Corp. 5.375% 15/06/2021	USD	4,825,000	4,393,235	0.24
Chesapeake Energy Corp. 5.75% 15/03/2023	USD	4,800,000	4,328,136	0.24
Clean Harbors, Inc. 5.25% 01/08/2020	USD	1,350,000	1,377,567	0.08
Clean Harbors, Inc. 5.125% 01/06/2021	USD	1,800,000	1,800,558	0.10
CMS Energy Corp. 5.05% 15/03/2022	USD	1,875,000	2,069,831	0.11
CNO Financial Group, Inc. 5.25% 30/05/2025	USD	6,500,000	6,597,500	0.37
Concho Resources, Inc. 7% 15/01/2021	USD	1,275,000	1,338,189	0.07
Concho Resources, Inc. 5.5% 01/04/2023	USD	6,925,000	6,921,122	0.38
CONSOL Energy, Inc. 5.875% 15/04/2022	USD	6,000,000	5,163,390	0.29
CoreLogic, Inc. 7.25% 01/06/2021	USD	1,575,000	1,681,312	0.09
Crown Castle International Corp., REIT 5.25% 15/01/2023	USD	5,175,000	5,225,741	0.29
Denbury Resources, Inc. 5.5% 01/05/2022	USD	3,725,000	3,379,860	0.19
Discover Financial Services 10.25% 15/07/2019	USD	3,700,000	4,595,080	0.25
Dycom Investments, Inc. 7.125% 15/01/2021	USD	2,900,000	3,048,625	0.17
EPL Oil & Gas, Inc. 8.25% 15/02/2018	USD	2,075,000	1,252,273	0.07
Exterran Holdings, Inc. 7.25% 01/12/2018	USD	4,125,000	4,269,375	0.24
Ferrellgas LP 6.5% 01/05/2021	USD	2,900,000	2,936,728	0.16
FTI Consulting, Inc. 6.75% 01/10/2020	USD	825,000	859,031	0.05
FTI Consulting, Inc. 6% 15/11/2022	USD	10,825,000	11,352,719	0.63
Gannett Co., Inc. 6.375% 15/10/2023	USD	425,000	443,570	0.02
Graphic Packaging International, Inc. 4.75% 15/04/2021	USD	1,775,000	1,798,164	0.10
Greif, Inc. 7.75% 01/08/2019	USD	450,000	497,680	0.03
Group 1 Automotive, Inc. 5% 01/06/2022	USD	2,000,000	2,000,000	0.11
HCA Holdings, Inc. 6.25% 15/02/2021	USD	16,725,000	18,119,029	1.01
HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	275,000	278,190	0.02
HRG Group, Inc. 7.875% 15/07/2019	USD	3,175,000	3,365,500	0.19
HRG Group, Inc. 7.75% 15/01/2022	USD	2,975,000	2,916,363	0.16
iStar Financial, Inc., REIT 7.125% 15/02/2018	USD	2,900,000	3,051,684	0.17

iStar Financial, Inc., REIT 5% 01/07/2019	USD	3,125,000	3,073,328	0.17
Lender Processing Services, Inc. 5.75% 15/04/2023	USD	2,768,000	2,951,380	0.16
Level 3 Financing, Inc. 7% 01/06/2020	USD	2,875,000	3,056,686	0.17
Level 3 Financing, Inc. 8.625% 15/07/2020	USD	3,150,000	3,374,280	0.19
Level 3 Financing, Inc. 6.125% 15/01/2021	USD	650,000	682,848	0.04
MarkWest Energy Partners LP 4.5% 15/07/2023	USD	4,200,000	4,094,517	0.23
Men's Wearhouse, Inc. (The) 7% 01/07/2022	USD	5,075,000	5,430,250	0.30
MGM Resorts International 6.625% 15/12/2021	USD	4,325,000	4,512,878	0.25
MGM Resorts International 6% 15/03/2023	USD	4,125,000	4,186,999	0.23
MPT Operating Partnership LP, REIT 6.875% 01/05/2021	USD	2,450,000	2,593,080	0.14
MPT Operating Partnership LP, REIT 6.375% 15/02/2022	USD	2,050,000	2,180,687	0.12
Nationstar Mortgage LLC 7.875% 01/10/2020	USD	500,000	501,872	0.03
Nationstar Mortgage LLC 6.5% 01/07/2021	USD	7,700,000	7,180,250	0.40
Navistar International Corp. 8.25% 01/11/2021	USD	4,600,000	4,401,096	0.24
Newfield Exploration Co. 5.75% 30/01/2022	USD	3,625,000	3,685,755	0.20
Newfield Exploration Co. 5.625% 01/07/2024	USD	225,000	228,313	0.01
Newfield Exploration Co. 5.375% 01/01/2026	USD	1,600,000	1,602,752	0.09
Nord Anglia Education Finance LLC, Reg. S 5.75% 15/07/2022	CHF	1,725,000	1,910,566	0.11
NRG Energy, Inc. 6.25% 15/07/2022	USD	4,500,000	4,591,710	0.25
NRG Energy, Inc. 6.25% 01/05/2024	USD	1,925,000	1,922,911	0.11
Oasis Petroleum, Inc. 7.25% 01/02/2019	USD	675,000	695,250	0.04
Oasis Petroleum, Inc. 6.5% 01/11/2021	USD	1,075,000	1,074,742	0.06
Oasis Petroleum, Inc. 6.875% 15/03/2022	USD	1,650,000	1,684,898	0.09
Oasis Petroleum, Inc. 6.875% 15/01/2023	USD	1,050,000	1,042,450	0.06
Omega Healthcare Investors, Inc., REIT 5.875% 15/03/2024	USD	775,000	819,562	0.05
Peabody Energy Corp. 6% 15/11/2018	USD	4,625,000	2,345,985	0.13
Penn Virginia Corp. 7.25% 15/04/2019	USD	4,125,000	3,609,375	0.20
Penn Virginia Corp. 8.5% 01/05/2020	USD	4,350,000	3,936,750	0.22
Penske Automotive Group, Inc. 5.75% 01/10/2022	USD	3,600,000	3,769,200	0.21
PH Glatfelter Co. 5.375% 15/10/2020	USD	4,150,000	4,284,875	0.24
Pinnacle Entertainment, Inc. 7.5% 15/04/2021	USD	6,175,000	6,510,519	0.36
PolyOne Corp. 5.25% 15/03/2023	USD	2,325,000	2,320,815	0.13
Post Holdings, Inc. 7.375% 15/02/2022	USD	2,350,000	2,413,614	0.13
Prestige Brands, Inc. 8.125% 01/02/2020	USD	1,800,000	1,922,841	0.11
Quiksilver, Inc. 10% 01/08/2020	USD	2,925,000	1,111,500	0.06
Range Resources Corp. 5% 15/08/2022	USD	1,375,000	1,352,024	0.07
Range Resources Corp. 5% 15/03/2023	USD	3,850,000	3,769,843	0.21

Regal Entertainment Group 5.75% 15/03/2022	USD	12,675,000	12,900,552	0.72
Regal Entertainment Group 5.75% 15/06/2023	USD	250,000	248,770	0.01
Reynolds Group Issuer, Inc. 9.875% 15/08/2019	USD	1,618,000	1,701,505	0.09
Ryerson, Inc. 9% 15/10/2017	USD	3,500,000	3,530,748	0.20
Ryerson, Inc. 11.25% 15/10/2018	USD	2,857,000	2,899,855	0.16
SandRidge Energy, Inc. 7.5% 15/03/2021	USD	2,825,000	1,243,000	0.07
Select Medical Corp. 6.375% 01/06/2021	USD	3,900,000	3,932,097	0.22
SESI LLC 7.125% 15/12/2021	USD	6,325,000	6,736,125	0.37
SM Energy Co. 6.5% 01/01/2023	USD	4,790,000	4,933,844	0.27
SM Energy Co. 5% 15/01/2024	USD	3,375,000	3,210,722	0.18
SM Energy Co. 5.625% 01/06/2025	USD	550,000	545,108	0.03
Sprint Communications, Inc. 11.5% 15/11/2021	USD	5,000,000	5,917,500	0.33
Sprint Corp. 7.125% 15/06/2024	USD	16,050,000	14,868,319	0.83
Targa Resources Partners LP 5.25% 01/05/2023	USD	4,175,000	4,130,140	0.23
Tenet Healthcare Corp. 8.125% 01/04/2022	USD	1,700,000	1,854,921	0.10
Terex Corp. 6.5% 01/04/2020	USD	1,025,000	1,077,270	0.06
Terex Corp. 6% 15/05/2021	USD	5,500,000	5,553,405	0.31
T-Mobile USA, Inc. 6.25% 01/04/2021	USD	5,450,000	5,599,875	0.31
T-Mobile USA, Inc. 6.633% 28/04/2021	USD	4,100,000	4,282,245	0.24
T-Mobile USA, Inc. 6% 01/03/2023	USD	8,675,000	8,893,870	0.49
T-Mobile USA, Inc. 6.5% 15/01/2024	USD	825,000	855,834	0.05
T-Mobile USA, Inc. 6.375% 01/03/2025	USD	1,575,000	1,615,147	0.09
TransDigm, Inc. 6.5% 15/07/2024	USD	1,900,000	1,879,100	0.10
United Continental Holdings, Inc. 6.375% 01/06/2018	USD	3,250,000	3,415,864	0.19
United Rentals North America, Inc. 6.125% 15/06/2023	USD	3,800,000	3,875,772	0.21
Vulcan Materials Co. 7.5% 15/06/2021	USD	3,250,000	3,769,512	0.21
Walter Investment Management Corp. 7.875% 15/12/2021	USD	7,585,000	6,978,162	0.39
WellCare Health Plans, Inc. 5.75% 15/11/2020	USD	4,225,000	4,412,526	0.25
William Carter Co. (The) 5.25% 15/08/2021	USD	4,825,000	4,979,641	0.28
Wolverine World Wide, Inc. 6.125% 15/10/2020	USD	1,850,000	1,967,401	0.11
WPX Energy, Inc. 6% 15/01/2022	USD	7,700,000	7,619,727	0.42
WPX Energy, Inc. 5.25% 15/09/2024	USD	1,075,000	986,646	0.05
			401,237,714	22.27
イギリス領バージン諸島				
Studio City Finance Ltd., Reg. S 8.5% 01/12/2020	USD	3,200,000	3,217,184	0.18
			3,217,184	0.18
債券 計			621,057,321	34.47
株式				
アイルランド				
Allergan PLC Preference 5.5%	USD	2,829	2,931,099	0.16

2,931,099 0.16

ルクセンブルグ

Altice SA	EUR	12,593	1,752,285	0.10
			1,752,285	0.10

イギリス

Liberty Global PLC	USD	22,800	1,160,748	0.07
			1,160,748	0.07

アメリカ

Advanced Micro Devices, Inc.	USD	401,700	964,080	0.05
American Tower Corp., REIT Preference 5.25%	USD	12,240	1,255,151	0.07
American Tower Corp., REIT Preference 5.5%	USD	10,453	1,059,516	0.06
Crown Castle International Corp., REIT Preference 4.5%	USD	41,650	4,285,785	0.24
General Motors Co.	USD	52,178	1,743,267	0.10
Howard Hughes Corp. (The)	USD	6,300	903,420	0.05
Lands' End, Inc.	USD	1,375	33,248	-
MBIA, Inc.	USD	363,800	1,949,968	0.11
New Residential Investment Corp., REIT	USD	114,500	1,767,880	0.10
Ocwen Financial Corp.	USD	364,000	3,723,720	0.21
Range Resources Corp.	USD	27,712	1,361,213	0.07
T-Mobile US, Inc.	USD	62,700	2,457,213	0.13
T-Mobile US, Inc. Preference 5.5%	USD	12,341	852,146	0.05
			22,356,607	1.24
株式 計			28,200,739	1.57

ワラント

アメリカ

American International Group, Inc. 19/01/2021	USD	37,400	1,028,500	0.05
Bank of America Corp. 16/01/2019	USD	113,900	700,485	0.04
BATS Global Markets, Inc. 28/10/2018	USD	49,050	1,246,360	0.07
Wells Fargo & Co. 28/10/2018	USD	47,050	1,070,858	0.06
			4,046,203	0.22
ワラント 計			4,046,203	0.22

公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 計

653,304,263 36.26

その他の規制のある市場において取引されている有価証券
債券

オーストラリア

BlueScope Steel Finance Ltd., 144A 7.125% 01/05/2018	USD	2,275,000	2,343,250	0.13
			2,343,250	0.13

ベルギー

Barry Callebaut Services NV, Reg. S 5.5% 15/06/2023	USD	9,900,000	10,566,121	0.59
			10,566,121	0.59

バミューダ

Digicel Group Ltd., Reg. S 8.25% 30/09/2020	USD	7,750,000	7,785,224	0.43
Digicel Group Ltd., Reg. S 7.125% 01/04/2022	USD	2,225,000	2,109,044	0.12
Digicel Ltd., Reg. S 6% 15/04/2021	USD	2,275,000	2,203,167	0.12
NCL Corp. Ltd., 144A 5.25% 15/11/2019	USD	2,625,000	2,715,221	0.15
Seadrill Ltd., 144A 6.125% 15/09/2017	USD	2,000,000	1,788,950	0.10
			16,601,606	0.92

カナダ

1011778 BC ULC, 144A 4.625% 15/01/2022	USD	2,350,000	2,303,000	0.13
Air Canada, Reg. S 7.75% 15/04/2021	USD	3,150,000	3,362,625	0.19
Bombardier, Inc., 144A 5.5% 15/09/2018	USD	7,925,000	7,925,000	0.44
Canbriam Energy, Inc., 144A 9.75% 15/11/2019	USD	3,725,000	3,836,750	0.21
Cascades, Inc., 144A 5.5% 15/07/2022	USD	1,275,000	1,235,156	0.07
Cascades, Inc., 144A 5.75% 15/07/2023	USD	6,250,000	6,046,875	0.34
Concordia Healthcare Corp., 144A 7% 15/04/2023	USD	3,075,000	3,086,531	0.17
Eldorado Gold Corp., Reg. S 6.125% 15/12/2020	USD	3,525,000	3,511,781	0.19
Great Canadian Gaming Corp., 144A 6.625% 25/07/2022	CAD	1,875,000	1,579,755	0.09
Lundin Mining Corp., 144A 7.5% 01/11/2020	USD	3,525,000	3,807,000	0.21
Masonite International Corp., 144A 5.625% 15/03/2023	USD	1,425,000	1,448,156	0.08
MDC Partners, Inc., 144A 6.75% 01/04/2020	USD	6,675,000	6,649,969	0.37
MDC Partners, Inc., Reg. S 6.75% 01/04/2020	USD	3,200,000	3,188,000	0.18
MDC Partners, Inc., Reg. S 6.75% 01/04/2020	USD	775,000	772,094	0.04
MPL 2 Acquisition Canco, Inc., 144A 9.875% 15/08/2018	USD	1,975,000	2,108,708	0.12
Norbord, Inc., 144A 6.25% 15/04/2023	USD	2,025,000	2,065,500	0.11
Novelis, Inc. 8.75% 15/12/2020	USD	4,075,000	4,311,065	0.24
Pacific Rubiales Energy Corp., Reg. S 7.25% 12/12/2021	USD	1,800,000	1,523,592	0.08
Pacific Rubiales Energy Corp., Reg. S 5.125% 28/03/2023	USD	300,000	220,163	0.01
Pacific Rubiales Energy Corp., Reg. S 5.625% 19/01/2025	USD	4,275,000	3,160,871	0.18
Precision Drilling Corp. 6.625% 15/11/2020	USD	4,075,000	4,007,477	0.22
Precision Drilling Corp. 6.5% 15/12/2021	USD	875,000	855,282	0.05
Reliance Intermediate Holdings LP, 144A 6.5% 01/04/2023	USD	3,775,000	3,944,875	0.22
Seven Generations Energy Ltd., 144A 8.25% 15/05/2020	USD	1,250,000	1,326,250	0.07
Seven Generations Energy Ltd., Reg. S 8.25% 15/05/2020	USD	2,250,000	2,387,250	0.13

Seven Generations Energy Ltd., 144A 6.75%				
01/05/2023	USD	3,025,000	3,032,562	0.17
Tervita Corp., Reg. S 10.875% 15/02/2018	USD	2,575,000	1,812,800	0.10
Tervita Corp., 144A 8% 15/11/2018	USD	3,375,000	3,088,125	0.17
Tervita Corp., Reg. S 8% 15/11/2018	USD	3,700,000	3,385,500	0.19
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 5.375% 15/03/2020	USD	3,425,000	3,522,921	0.20
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 5.875% 15/05/2023	USD	2,950,000	3,031,125	0.17
Videotron Ltd. 5% 15/07/2022	USD	4,300,000	4,305,375	0.24
			96,842,133	5.38
ケイマン諸島				
BCP Singapore VI Cayman Financing Co. Ltd., Reg. S 8% 15/04/2021	USD	1,675,000	1,684,212	0.09
Nexteer Automotive Group Ltd., Reg. S 5.875% 15/11/2021	USD	3,425,000	3,517,629	0.20
UPCB Finance VI Ltd., Reg. S 6.875% 15/01/2022	USD	2,610,000	2,792,700	0.15
			7,994,541	0.44
フランス				
CGG SA 6.5% 01/06/2021	USD	350,000	290,500	0.02
CGG SA 6.875% 15/01/2022	USD	7,425,000	6,315,594	0.35
			6,606,094	0.37
ドイツ				
Unitymedia GmbH, Reg. S 6.125% 15/01/2025	USD	3,525,000	3,687,115	0.20
Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG, Reg. S 5% 15/01/2025	USD	3,575,000	3,549,367	0.20
			7,236,482	0.40
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance PLC, Reg. S 7% 15/11/2020	USD	511,765	524,559	0.03
James Hardie International Finance Ltd., 144A 5.875% 15/02/2023	USD	2,300,000	2,380,500	0.13
			2,905,059	0.16
イスラエル				
B Communications Ltd., 144A 7.375% 15/02/2021	USD	4,475,000	4,801,116	0.27
			4,801,116	0.27
ルクセンブルグ				
Accudyne Industries Borrower, 144A 7.75% 15/12/2020	USD	4,550,000	4,242,875	0.23
Altice SA, 144A 7.625% 15/02/2025	USD	4,775,000	4,548,188	0.25
Ardagh Finance Holdings SA, 144A 8.375% 15/06/2019	EUR	700,000	799,961	0.04
Ardagh Finance Holdings SA, 144A 8.625% 15/06/2019	USD	938,812	976,364	0.05
Ardagh Finance Holdings SA, Reg. S 8.625% 15/06/2019	USD	2,204,939	2,293,137	0.13

Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA, Reg.					
S 5.625% 15/12/2016	USD	2,350,000	2,352,937	0.13	
Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA, 144A					
6% 15/06/2017	USD	2,250,000	2,255,625	0.13	
Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA, Reg.					
S 6% 15/06/2017	USD	1,350,000	1,353,375	0.07	
Capsugel SA, Reg. S 7% 15/05/2019	USD	2,050,000	2,096,350	0.12	
Capsugel SA, Reg. S 7% 15/05/2019	USD	2,175,000	2,217,391	0.12	
Consolidated Energy Finance SA, Reg. S 6.75%					
15/10/2019	USD	4,750,000	4,845,000	0.27	
INEOS Group Holdings SA, Reg. S 6.125% 15/08/2018	USD	2,250,000	2,296,283	0.13	
Intelsat Jackson Holdings SA 6.625% 15/12/2022	USD	4,100,000	3,763,513	0.21	
Intelsat Jackson Holdings SA 5.5% 01/08/2023	USD	4,250,000	3,754,450	0.21	
NII International Telecom SCA, 144A 11.375%					
15/08/2019**	USD	1,100,000	995,500	0.06	
NII International Telecom SCA, Reg. S 11.375%					
15/08/2019**	USD	2,325,000	2,104,125	0.12	
			40,895,074	2.27	
オランダ					
DPx Holdings BV, 144A 7.5% 01/02/2022	USD	2,650,000	2,779,188	0.15	
JLL, 144A 8.75% 01/05/2020	USD	2,625,000	2,684,062	0.15	
Playa Resorts Holding BV, 144A 8% 15/08/2020	USD	625,000	650,000	0.04	
Playa Resorts Holding BV, Reg. S 8% 15/08/2020	USD	2,025,000	2,106,000	0.12	
Schaeffler Holding Finance BV, Reg. S 6.875%					
15/08/2018	USD	2,750,000	2,860,000	0.16	
VimpelCom Holdings BV, 144A 7.504% 01/03/2022	USD	2,425,000	2,385,921	0.13	
VTR Finance BV, Reg. S 6.875% 15/01/2024	USD	2,475,000	2,541,701	0.14	
Ziggo Bond Finance BV, Reg. S 5.875% 15/01/2025	USD	1,900,000	1,885,912	0.10	
			17,892,784	0.99	
スペイン					
Abengoa Greenfield SA, 144A 6.5% 01/10/2019	USD	1,425,000	1,311,157	0.07	
			1,311,157	0.07	
イギリス					
Iron Mountain Europe PLC, Reg. S 6.125% 15/09/2022	GBP	2,175,000	3,531,473	0.19	
Jaguar Land Rover Automotive PLC, Reg. S 5.625%					
01/02/2023	USD	4,550,000	4,794,472	0.27	
Virgin Media Finance PLC, Reg. S 6% 15/10/2024	USD	1,900,000	1,940,603	0.11	
Virgin Media Secured Finance PLC, 144A 5.25%					
15/01/2026	USD	1,600,000	1,563,760	0.09	
			11,830,308	0.66	
アメリカ					

24 Hour Holdings III LLC, Reg. S 8% 01/06/2022	USD	2,775,000	2,247,750	0.12
99 Cents Only Stores LLC 11% 15/12/2019	USD	2,475,000	2,252,250	0.12
Academy Ltd., 144A 9.25% 01/08/2019	USD	1,925,000	2,033,281	0.11
Acadia Healthcare Co., Inc., 144A 5.625% 15/02/2023	USD	1,700,000	1,721,250	0.10
Activision Blizzard, Inc., 144A 6.125% 15/09/2023	USD	550,000	592,625	0.03
Activision Blizzard, Inc., Reg. S 6.125% 15/09/2023	USD	2,000,000	2,155,000	0.12
Advanced Micro Devices, Inc. 6.75% 01/03/2019	USD	2,050,000	1,863,624	0.10
Advanced Micro Devices, Inc. 7.5% 15/08/2022	USD	2,100,000	1,849,533	0.10
AEP Industries, Inc. 8.25% 15/04/2019	USD	2,075,000	2,121,687	0.12
Affinia Group, Inc. 7.75% 01/05/2021	USD	1,500,000	1,575,000	0.09
Alcatel-Lucent USA, Inc., Reg. S 8.875% 01/01/2020	USD	2,175,000	2,370,750	0.13
Alcatel-Lucent USA, Inc., Reg. S 6.75% 15/11/2020	USD	1,825,000	1,923,094	0.11
Aleris International, Inc. 7.625% 15/02/2018	USD	1,750,000	1,787,161	0.10
Aleris International, Inc. 7.875% 01/11/2020	USD	4,125,000	4,289,526	0.24
Allegiant Travel Co. 5.5% 15/07/2019	USD	1,125,000	1,139,586	0.06
Alliance Data Systems Corp., Reg. S 5.375% 01/08/2022	USD	3,075,000	3,044,250	0.17
Alphabet Holding Co., Inc. 7.75% 01/11/2017	USD	3,325,000	3,342,988	0.19
AMC Entertainment, Inc., 144A 5.75% 15/06/2025	USD	6,775,000	6,622,563	0.37
AMC Networks, Inc. 4.75% 15/12/2022	USD	3,000,000	3,009,660	0.17
American Airlines Group, Inc., 144A 5.5% 01/10/2019	USD	3,600,000	3,645,000	0.20
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 Class B 144A 5.625% 15/01/2021	USD	808,577	840,920	0.05
Ancestry.com Holdings LLC, 144A 9.625% 15/10/2018	USD	1,675,000	1,710,594	0.09
Ancestry.com Holdings LLC, Reg. S 9.625% 15/10/2018	USD	2,575,000	2,629,719	0.15
Ancestry.com, Inc. 11% 15/12/2020	USD	2,850,000	3,241,875	0.18
Apex Tool Group LLC, 144A 7% 01/02/2021	USD	4,825,000	4,354,562	0.24
Argos Merger Sub, Inc., 144A 7.125% 15/03/2023	USD	3,650,000	3,845,038	0.21
A-S Co-Issuer Subsidiary, Inc., 144A 7.875% 15/12/2020	USD	4,375,000	4,637,500	0.26
Ashtead Capital, Inc., Reg. S 6.5% 15/07/2022	USD	1,450,000	1,555,125	0.09
Ashtead Capital, Inc., Reg. S 6.5% 15/07/2022	USD	1,500,000	1,605,000	0.09
Avaya, Inc., 144A 7% 01/04/2019	USD	500,000	490,000	0.03
Avaya, Inc., 144A 10.5% 01/03/2021	USD	3,050,000	2,516,250	0.14
Avon Products, Inc. 5.75% 15/03/2023	USD	3,850,000	3,307,689	0.18
Axalta Coating Systems US Holdings, Inc., 144A 7.375% 01/05/2021	USD	1,600,000	1,716,000	0.10
Bankrate, Inc., Reg. S 6.125% 15/08/2018	USD	3,125,000	3,046,875	0.17
BlueLine Rental Finance Corp., Reg. S 7% 01/02/2019	USD	2,425,000	2,479,563	0.14
BMC Software Finance, Inc., Reg. S 8.125% 15/07/2021	USD	3,350,000	2,759,562	0.15

BMC Software, Inc. 7.25% 01/06/2018	USD	1,850,000	1,726,142	0.10
Boyd Gaming Corp. 9% 01/07/2020	USD	425,000	463,352	0.03
Builders FirstSource, Inc., 144A 7.625% 01/06/2021	USD	1,875,000	1,950,000	0.11
Cable One, Inc., 144A 5.75% 15/06/2022	USD	1,650,000	1,683,000	0.09
Calpine Corp. 5.5% 01/02/2024	USD	925,000	901,278	0.05
Capella Healthcare, Inc. 9.25% 01/07/2017	USD	2,700,000	2,770,645	0.15
CCO Holdings LLC 6.625% 31/01/2022	USD	14,350,000	14,997,185	0.83
CCO Holdings LLC 5.25% 30/09/2022	USD	5,575,000	5,474,483	0.30
CCO Holdings LLC 5.75% 01/09/2023	USD	1,900,000	1,911,657	0.11
CDW LLC 6% 15/08/2022	USD	4,250,000	4,409,205	0.24
CEB, Inc., 144A 5.625% 15/06/2023	USD	8,850,000	8,916,375	0.49
Cedar Fair LP 5.25% 15/03/2021	USD	2,725,000	2,823,686	0.16
CEDC Finance Corp. International, Inc., STEP 10% 30/04/2018	USD	2,378,639	2,152,668	0.12
Cequele Communications Holdings I LLC, 144A 6.375% 15/09/2020	USD	4,750,000	4,749,287	0.26
Cequele Communications Holdings I LLC, 144A 5.125% 15/12/2021	USD	1,300,000	1,184,079	0.07
Cequele Communications Holdings I LLC, 144A 5.125% 15/12/2021	USD	4,625,000	4,202,969	0.23
Chinos Intermediate Holdings A, Inc., 144A 7.75% 01/05/2019	USD	1,975,000	1,599,750	0.09
Claire's Stores, Inc. 10.5% 01/06/2017	USD	3,338,000	2,703,780	0.15
Claire's Stores, Inc., 144A 9% 15/03/2019	USD	2,725,000	2,347,451	0.13
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 6.5% 15/11/2022	USD	4,650,000	4,834,303	0.27
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 6.5% 15/11/2022	USD	575,000	586,233	0.03
CommScope Technologies Finance LLC, 144A 6% 15/06/2025	USD	3,775,000	3,756,125	0.21
Comstock Resources, Inc., 144A 10% 15/03/2020	USD	2,150,000	1,950,222	0.11
CONSOL Energy, Inc., 144A 8% 01/04/2023	USD	3,925,000	3,723,844	0.21
Consolidated Container Co. LLC, Reg. S 10.125% 15/07/2020	USD	3,925,000	3,571,750	0.20
Corrections Corp. of America, REIT 4.625% 01/05/2023	USD	900,000	884,655	0.05
Cott Beverages, Inc., 144A 6.75% 01/01/2020	USD	2,075,000	2,142,438	0.12
Coveris Holding Corp., Reg. S 10% 01/06/2018	USD	2,325,000	2,455,781	0.14
Crimson Merger Sub, Inc., 144A 6.625% 15/05/2022	USD	3,925,000	3,454,000	0.19
CrownRock LP, 144A 7.125% 15/04/2021	USD	1,825,000	1,902,562	0.11
CrownRock LP, 144A 7.75% 15/02/2023	USD	4,175,000	4,446,375	0.25

Cumulus Media Holdings, Inc. 7.75% 01/05/2019	USD	925,000	862,118	0.05
Darling Ingredients, Inc. 5.375% 15/01/2022	USD	2,450,000	2,460,290	0.14
DBP Holding Corp., 144A 7.75% 15/10/2020	USD	3,450,000	2,846,250	0.16
Dean Foods Co., 144A 6.5% 15/03/2023	USD	3,825,000	3,920,109	0.22
DISH DBS Corp. 5.125% 01/05/2020	USD	3,675,000	3,707,579	0.21
DISH DBS Corp. 5.875% 15/07/2022	USD	3,100,000	3,039,705	0.17
DJO Finco, Inc., 144A 8.125% 15/06/2021	USD	3,700,000	3,789,429	0.21
DreamWorks Animation SKG, Inc., 144A 6.875% 15/08/2020	USD	1,952,000	1,942,240	0.11
DuPont Fabros Technology LP, REIT 5.875% 15/09/2021	USD	4,425,000	4,491,375	0.25
Dynegy, Inc., 144A 6.75% 01/11/2019	USD	3,500,000	3,657,500	0.20
E*TRADE Financial Corp. 5.375% 15/11/2022	USD	2,675,000	2,757,778	0.15
EarthLink Holdings Corp. 7.375% 01/06/2020	USD	1,425,000	1,487,671	0.08
Endo Finance LLC, 144A 6% 15/07/2023	USD	3,925,000	4,013,312	0.22
Endo Finance LLC, 144A 6% 01/02/2025	USD	2,800,000	2,859,500	0.16
Energizer Holdings, Inc., 144A 5.5% 15/06/2025	USD	1,975,000	1,945,375	0.11
Energy Future Intermediate Holding Co. LLC, 144A 11.75% 01/03/2022 **	USD	6,287,902	7,191,788	0.40
Energy XXI Gulf Coast, Inc., 144A 11% 15/03/2020	USD	3,725,000	3,305,937	0.18
Equinix, Inc., REIT 5.375% 01/01/2022	USD	2,450,000	2,457,938	0.14
Equinix, Inc., REIT 5.375% 01/04/2023	USD	3,000,000	3,001,455	0.17
Equinix, Inc., REIT 5.75% 01/01/2025	USD	1,325,000	1,320,588	0.07
Exterran Partners LP 6% 01/04/2021	USD	1,100,000	1,061,500	0.06
Exterran Partners LP 6% 01/10/2022	USD	1,850,000	1,762,125	0.10
Family Tree Escrow LLC, 144A 5.25% 01/03/2020	USD	1,325,000	1,392,933	0.08
Family Tree Escrow LLC, 144A 5.75% 01/03/2023	USD	7,825,000	8,200,796	0.45
FCA US LLC 8.25% 15/06/2021	USD	6,225,000	6,804,921	0.38
Ferrellgas LP, 144A 6.75% 15/06/2023	USD	1,250,000	1,259,375	0.07
First Data Corp., 144A 6.75% 01/11/2020	USD	5,393,000	5,703,097	0.32
First Data Corp. 12.625% 15/01/2021	USD	16,775,000	19,421,592	1.08
Gardner Denver, Inc., 144A 6.875% 15/08/2021	USD	7,100,000	6,558,625	0.36
GenOn Energy, Inc. 9.5% 15/10/2018	USD	4,775,000	4,908,604	0.27
Goodman Networks, Inc. 12.125% 01/07/2018	USD	3,600,000	3,006,000	0.17
Graton Economic Development Authority, 144A 9.625% 01/09/2019	USD	3,750,000	4,050,000	0.22
Greystar Real Estate Partners LLC, 144A 8.25% 01/12/2022	USD	1,825,000	1,934,500	0.11
Guitar Center, Inc., 144A 6.5% 15/04/2019	USD	4,125,000	3,805,313	0.21
Gulfport Energy Corp., 144A 6.625% 01/05/2023	USD	4,500,000	4,590,000	0.25
H&E Equipment Services, Inc. 7% 01/09/2022	USD	1,850,000	1,925,619	0.11
Halcon Resources Corp., 144A 8.625% 01/02/2020	USD	3,450,000	3,393,938	0.19

HD Supply, Inc., 144A 5.25% 15/12/2021	USD	3,725,000	3,791,398	0.21
Hercules Offshore, Inc., 144A 10.25% 01/04/2019	USD	100,000	33,500	-
Hercules Offshore, Inc., 144A 8.75% 15/07/2021	USD	5,575,000	1,867,625	0.10
Hexion, Inc. 8.875% 01/02/2018	USD	5,725,000	5,228,900	0.29
Hexion, Inc. 6.625% 15/04/2020	USD	3,400,000	3,116,559	0.17
Hexion, Inc. 10% 15/04/2020	USD	1,375,000	1,432,778	0.08
Hilton Worldwide Finance LLC 5.625% 15/10/2021	USD	4,200,000	4,389,210	0.24
Horizon Pharma Financing, Inc., 144A 6.625%				
01/05/2023	USD	2,350,000	2,446,938	0.14
Howard Hughes Corp. (The), Reg. S 6.875% 01/10/2021	USD	6,525,000	6,949,125	0.39
HRG Group, Inc., 144A 7.875% 15/07/2019	USD	275,000	291,500	0.02
HRG Group, Inc., 144A 7.75% 15/01/2022	USD	2,475,000	2,422,406	0.13
Hub Holdings LLC, 144A 8.125% 15/07/2019	USD	2,400,000	2,394,000	0.13
HUB International Ltd., 144A 7.875% 01/10/2021	USD	3,950,000	4,038,875	0.22
IASIS Healthcare LLC 8.375% 15/05/2019	USD	2,000,000	2,070,170	0.11
Igloo Holdings Corp., Reg. S 8.25% 15/12/2017	USD	2,250,000	2,275,312	0.13
iHeartCommunications, Inc. 10% 15/01/2018	USD	4,325,000	3,551,625	0.20
iHeartCommunications, Inc. 9% 15/12/2019	USD	5,325,000	5,070,997	0.28
Infor Software Parent LLC, 144A 7.125% 01/05/2021	USD	5,675,000	5,700,481	0.32
Infor US, Inc., 144A 6.5% 15/05/2022	USD	4,225,000	4,298,938	0.24
Interline Brands, Inc. 10.056% 15/11/2018	USD	1,288,000	1,349,180	0.07
Jaguar Holding Co. I, 144A 9.375% 15/10/2017	USD	2,450,000	2,505,664	0.14
Jaguar Holding Co. II, 144A 9.5% 01/12/2019	USD	950,000	1,020,300	0.06
JBS USA LLC, Reg. S 5.875% 15/07/2024	USD	5,225,000	5,280,072	0.29
Jefferies LoanCore LLC, 144A 6.875% 01/06/2020	USD	2,700,000	2,632,500	0.15
Jo-Ann Stores LLC, 144A 8.125% 15/03/2019	USD	4,200,000	3,979,500	0.22
Ladder Capital Finance Holdings LLLP 7.375%				
01/10/2017	USD	6,625,000	6,939,687	0.38
Ladder Capital Finance Holdings LLLP, 144A 5.875%				
01/08/2021	USD	1,875,000	1,830,469	0.10
Lamar Media Corp. 5.875% 01/02/2022	USD	1,000,000	1,037,310	0.06
Laureate Education, Inc., 144A 10% 01/09/2019	USD	7,625,000	7,129,375	0.40
Level 3 Financing, Inc. 5.375% 15/08/2022	USD	9,100,000	9,209,883	0.51
Level 3 Financing, Inc., 144A 5.625% 01/02/2023	USD	3,650,000	3,688,654	0.20
LIN Television Corp., 144A 5.875% 15/11/2022	USD	2,750,000	2,784,375	0.15
LTF Merger Sub, Inc., 144A 8.5% 15/06/2023	USD	2,925,000	2,829,937	0.16
Matador Resources Co., 144A 6.875% 15/04/2023	USD	7,500,000	7,696,875	0.43
Mediacom Broadband LLC 6.375% 01/04/2023	USD	8,250,000	8,585,032	0.48
Mercer International, Inc. 7% 01/12/2019	USD	3,200,000	3,376,000	0.19
Mercer International, Inc. 7.75% 01/12/2022	USD	1,700,000	1,848,750	0.10
MHGE Parent LLC, 144A 8.5% 01/08/2019	USD	1,125,000	1,137,656	0.06

Michaels Stores, Inc., 144A 5.875% 15/12/2020	USD	4,075,000	4,258,375	0.24
Milacron LLC, 144A 7.75% 15/02/2021	USD	3,325,000	3,424,750	0.19
Momentive Performance Materials, Inc. 3.88%				
24/10/2021	USD	5,000,000	4,512,500	0.25
Monitronics International, Inc. 9.125% 01/04/2020	USD	3,625,000	3,498,125	0.19
MPG Holdco I, Inc. 7.375% 15/10/2022	USD	4,100,000	4,376,750	0.24
MSCI, Inc., 144A 5.25% 15/11/2024	USD	2,225,000	2,258,375	0.13
Murray Energy Corp., 144A 11.25% 15/04/2021	USD	9,000,000	7,672,500	0.43
National Financial Partners Corp., 144A 9%				
15/07/2021	USD	4,300,000	4,251,625	0.24
Navient Corp. 5% 26/10/2020	USD	4,375,000	4,316,681	0.24
Navient Corp. 5.875% 25/03/2021	USD	2,400,000	2,408,496	0.13
Netflix, Inc. 5.375% 01/02/2021	USD	3,275,000	3,419,837	0.19
NRG Energy, Inc. 6.625% 15/03/2023	USD	3,100,000	3,209,399	0.18
NRG Yield Operating LLC, 144A 5.375% 15/08/2024	USD	3,300,000	3,341,250	0.19
Ocwen Financial Corp., 144A 7.125% 15/05/2019	USD	6,575,000	6,164,063	0.34
Omega US Sub LLC, 144A 8.75% 15/07/2023	USD	4,200,000	4,200,000	0.23
OneMain Financial Holdings, Inc., 144A 6.75%				
15/12/2019	USD	2,575,000	2,684,438	0.15
Opal Acquisition, Inc., Reg. S 8.875% 15/12/2021	USD	3,350,000	3,274,625	0.18
Outerwall, Inc. 6% 15/03/2019	USD	5,325,000	5,347,019	0.30
Outerwall, Inc. 5.875% 15/06/2021	USD	1,350,000	1,290,937	0.07
Outfront Media Capital LLC 5.25% 15/02/2022	USD	3,875,000	3,947,986	0.22
Outfront Media Capital LLC 5.625% 15/02/2024	USD	1,325,000	1,362,398	0.08
Par Pharmaceutical Cos, Inc. 7.375% 15/10/2020	USD	1,675,000	1,788,063	0.10
Parker Drilling Co. 7.5% 01/08/2020	USD	625,000	571,875	0.03
Parker Drilling Co. 6.75% 15/07/2022	USD	2,125,000	1,836,935	0.10
Parsley Energy LLC, 144A 7.5% 15/02/2022	USD	1,800,000	1,845,000	0.10
Parsley Energy LLC, Reg. S 7.5% 15/02/2022	USD	1,275,000	1,294,125	0.07
Parsley Energy LLC, Reg. S 7.5% 15/02/2022	USD	2,725,000	2,793,125	0.15
Peninsula Gaming LLC, 144A 8.375% 15/02/2018	USD	2,125,000	2,216,194	0.12
Penn Virginia Resource Partners LP 6.5% 15/05/2021	USD	450,000	483,878	0.03
PF Chang's China Bistro, Inc., 144A 10.25%				
30/06/2020	USD	3,275,000	3,397,812	0.19
Pittsburgh Glass Works LLC, 144A 8% 15/11/2018	USD	1,665,000	1,748,250	0.10
Platform Specialty Products Corp., 144A 6.5%				
01/02/2022	USD	4,325,000	4,498,000	0.25
Post Holdings, Inc., 144A 6.75% 01/12/2021	USD	2,625,000	2,625,000	0.15
Post Holdings, Inc., Reg. S 6% 15/12/2022	USD	1,750,000	1,688,750	0.09
PQ Corp., 144A 8.75% 01/11/2018	USD	3,325,000	3,403,969	0.19
PRA Holdings, Inc., 144A 9.5% 01/10/2023	USD	615,000	690,337	0.04

Project Homestake Merger Corp., 144A 8.875%				
01/03/2023	USD	1,325,000	1,295,188	0.07
Provident Funding Associates LP, 144A 6.75%				
15/06/2021	USD	8,850,000	8,484,937	0.47
Quicken Loans, Inc., 144A 5.75% 01/05/2025	USD	5,675,000	5,436,650	0.30
Range Resources Corp., 144A 4.875% 15/05/2025	USD	4,425,000	4,308,844	0.24
Rayonier AM Products, Inc., Reg. S 5.5% 01/06/2024	USD	4,325,000	3,903,313	0.21
Realogy Group LLC, 144A 5.25% 01/12/2021	USD	2,275,000	2,326,187	0.13
Reynolds Group Issuer, Inc. 8.25% 15/02/2021	USD	4,625,000	4,848,596	0.27
Rite Aid Corp. 6.75% 15/06/2021	USD	6,725,000	7,079,744	0.39
Rite Aid Corp., 144A 6.125% 01/04/2023	USD	4,100,000	4,228,125	0.23
Rosetta Resources, Inc. 5.875% 01/06/2022	USD	2,350,000	2,490,824	0.14
Rosetta Resources, Inc. 5.875% 01/06/2024	USD	9,900,000	10,559,340	0.59
RSI Home Products, Inc., 144A 6.5% 15/03/2023	USD	3,900,000	3,939,000	0.22
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01/02/2021	USD	3,700,000	3,786,765	0.21
Sabine Pass Liquefaction LLC 6.25% 15/03/2022	USD	1,600,000	1,659,080	0.09
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15/04/2023	USD	2,525,000	2,514,244	0.14
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/05/2024	USD	2,850,000	2,839,740	0.16
Sabre GBLB, Inc., 144A 5.375% 15/04/2023	USD	1,175,000	1,160,313	0.06
Safway Group Holding LLC, 144A 7% 15/05/2018	USD	2,155,000	2,203,487	0.12
SandRidge Energy, Inc., 144A 8.75% 01/06/2020	USD	3,125,000	2,814,719	0.16
Scientific Games International, Inc., 144A 7%				
01/01/2022	USD	2,625,000	2,720,813	0.15
Sealed Air Corp., Reg. S 5.25% 01/04/2023	USD	3,400,000	3,434,000	0.19
Seminole Hard Rock Entertainment, Inc., 144A 5.875%				
15/05/2021	USD	2,820,000	2,848,200	0.16
SFX Entertainment, Inc., 144A 9.625% 01/02/2019	USD	4,925,000	4,346,313	0.24
Shea Homes LP, 144A 5.875% 01/04/2023	USD	1,800,000	1,831,500	0.10
Shearer's Foods LLC, 144A 9% 01/11/2019	USD	2,250,000	2,435,625	0.13
Shingle Springs Tribal Gaming Authority, 144A 9.75%				
01/09/2021	USD	2,000,000	2,230,000	0.12
Sinclair Television Group, Inc. 6.125% 01/10/2022	USD	4,150,000	4,277,467	0.24
Sirius XM Radio, Inc., Reg. S 5.75% 01/08/2021	USD	2,900,000	2,990,625	0.17
Six Flags Entertainment Corp., 144A 5.25%				
15/01/2021	USD	1,325,000	1,358,125	0.08
Sonic Automotive, Inc. 5% 15/05/2023	USD	3,175,000	3,147,377	0.17
Spectrum Brands, Inc. 6.625% 15/11/2022	USD	4,050,000	4,340,426	0.24
Spectrum Brands, Inc., 144A 5.75% 15/07/2025	USD	1,650,000	1,686,515	0.09
Springleaf Finance Corp. 5.25% 15/12/2019	USD	3,575,000	3,530,831	0.20
Springs Industries, Inc. 6.25% 01/06/2021	USD	1,600,000	1,577,648	0.09
SS&C Technologies Holdings, Inc., 144A 5.875%				
15/07/2023	USD	1,975,000	1,987,344	0.11

Starz LLC 5% 15/09/2019	USD	4,600,000	4,673,669	0.26
Station Casinos LLC 7.5% 01/03/2021	USD	1,025,000	1,094,500	0.06
Summit Materials LLC 10.5% 31/01/2020	USD	2,480,000	2,728,000	0.15
Sun Products Corp. (The), 144A 7.75% 15/03/2021	USD	3,775,000	3,454,125	0.19
SunCoke Energy Partners LP, 144A 7.375% 01/02/2020	USD	2,300,000	2,348,875	0.13
SunCoke Energy Partners LP, 144A 7.375% 01/02/2020	USD	1,425,000	1,455,281	0.08
Targa Resources Partners LP, 144A 5% 15/01/2018	USD	2,325,000	2,402,271	0.13
Targa Resources Partners LP 4.25% 15/11/2023	USD	9,850,000	9,190,346	0.51
Taylor Morrison Communities, Inc., 144A 5.875% 15/04/2023	USD	2,250,000	2,221,875	0.12
Tenet Healthcare Corp., FRN, 144A 3.786% 15/06/2020	USD	1,650,000	1,674,750	0.09
Tenet Healthcare Corp., 144A 6.75% 15/06/2023	USD	4,050,000	4,105,445	0.23
TerraForm Power Operating LLC, 144A 5.875% 01/02/2023	USD	5,750,000	5,865,000	0.33
Time, Inc., Reg. S 5.75% 15/04/2022	USD	2,900,000	2,798,500	0.16
Townsquare Media, Inc., 144A 6.5% 01/04/2023	USD	2,175,000	2,161,406	0.12
TransDigm, Inc., 144A 6.5% 15/05/2025	USD	1,575,000	1,575,000	0.09
TransUnion 8.125% 15/06/2018	USD	1,675,000	1,714,614	0.09
Transworld Systems, Inc., 144A 9.5% 15/08/2021	USD	3,350,000	2,060,250	0.11
Tribune Media Co., 144A 5.875% 15/07/2022	USD	6,750,000	6,800,625	0.38
Truven Health Analytics, Inc. 10.625% 01/06/2020	USD	2,425,000	2,540,187	0.14
United Airlines, Inc., Series 2014-2 Class B 4.625% 03/09/2022	USD	725,000	739,500	0.04
United Continental Holdings, Inc. 6% 01/12/2020	USD	3,575,000	3,728,528	0.21
Univar, Inc., 144A 6.75% 15/07/2023	USD	2,475,000	2,499,750	0.14
Universal Hospital Services, Inc. 7.625% 15/08/2020	USD	4,975,000	4,614,312	0.26
Univision Communications, Inc., Reg. S 6.75% 15/09/2022	USD	829,000	883,921	0.05
Univision Communications, Inc., 144A 5.125% 15/05/2023	USD	2,550,000	2,479,875	0.14
Univision Communications, Inc., Reg. S 5.125% 15/05/2023	USD	7,650,000	7,439,625	0.41
Univision Communications, Inc., 144A 5.125% 15/02/2025	USD	3,725,000	3,589,969	0.20
US Airways Group, Inc. 6.125% 01/06/2018	USD	6,500,000	6,774,722	0.38
USG Corp. 9.75% 15/01/2018	USD	6,125,000	6,910,286	0.38
USG Corp., Reg. S 5.875% 01/11/2021	USD	1,000,000	1,045,000	0.06
USI, Inc., 144A 7.75% 15/01/2021	USD	6,200,000	6,324,000	0.35
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 6.375% 15/10/2020	USD	1,975,000	2,070,699	0.11
ViaSat, Inc. 6.875% 15/06/2020	USD	3,750,000	3,942,862	0.22
Watco Cos. LLC, 144A 6.375% 01/04/2023	USD	2,075,000	2,116,500	0.12

WaveDivision Escrow LLC, 144A 8.125% 01/09/2020	USD	1,025,000	1,081,375	0.06
Whiting Petroleum Corp., 144A 6.25% 01/04/2023	USD	7,425,000	7,480,687	0.42
WideOpenWest Finance LLC 10.25% 15/07/2019	USD	725,000	772,194	0.04
WideOpenWest Finance LLC 13.375% 15/10/2019	USD	4,400,000	4,774,000	0.26
William Lyon Homes, Inc. 8.5% 15/11/2020	USD	4,225,000	4,565,915	0.25
William Lyon Homes, Inc. 7% 15/08/2022	USD	3,800,000	3,952,000	0.22
WMG Acquisition Corp., 144A 6% 15/01/2021	USD	2,175,000	2,229,375	0.12
WMG Acquisition Corp., Reg. S 6% 15/01/2021	USD	1,547,000	1,585,675	0.09
WMG Acquisition Corp., 144A 6.75% 15/04/2022	USD	2,775,000	2,650,125	0.15
WR Grace & Co-Conn, 144A 5.125% 01/10/2021	USD	2,550,000	2,588,250	0.14
			846,493,772	46.99
債券 計			1,074,319,497	59.64
転換社債券				
バミューダ				
Central European Media Enterprises Ltd. 5%				
15/11/2015	USD	6,025,000	6,032,531	0.34
			6,032,531	0.34
アメリカ				
Alpha Natural Resources, Inc. 3.75% 15/12/2017	USD	900,000	81,563	-
			81,563	-
転換社債券 計			6,114,094	0.34
株式				
イギリス				
Sentry Holdings Class A *	GBP	3,300	3,119	-
Sentry Holdings Preference Class B *	GBP	786,348	916,693	0.05
			919,812	0.05
アメリカ				
Ally Financial, Inc. Preference, 144A 7%	USD	4,975	5,053,667	0.28
Penn Virginia Corp. Preference, 144A 6%	USD	22,854	1,142,017	0.06
			6,195,684	0.34
株式 計			7,115,496	0.39
ワラント				
イギリス				
Sentry Holdings 02/01/2024 *	GBP	237	220	-
			220	-
ワラント 計			220	-
その他の規制のある市場において取引されている有価証券 計			1,087,549,307	60.37
その他取引可能な有価証券				
債券				
アメリカ				
MMC Energy, Inc. 8.875% 15/10/2020 **	USD	5,000,000	-	-

EUR	82,008,550	USD	96,407,689	2015/7/15	(4,549,900)	(0.25)
EUR	92,044,622	USD	104,431,495	2015/8/13	(1,289,612)	(0.08)
EUR	626,380	USD	707,295	2015/9/11	(5,095)	-
EUR	5,135,589	USD	5,829,000	2015/9/15	(71,414)	(0.01)
EUR	93,674,870	USD	105,913,068	2015/11/16	(775,226)	(0.05)
EUR	78,290,526	USD	88,568,972	2015/12/15	(649,996)	(0.04)
NOK	151,393,667	USD	19,544,650	2015/7/15	(249,207)	(0.01)
NOK	162,209,377	USD	21,383,292	2015/8/13	(723,762)	(0.04)
NOK	10,000,000	USD	1,293,394	2015/9/15	(20,755)	-
NOK	16,264,062	USD	2,109,122	2015/10/15	(40,576)	-
NOK	168,728,708	USD	22,401,166	2015/11/16	(952,967)	(0.05)
NOK	171,217,535	USD	21,903,393	2015/12/15	(149,459)	(0.01)
SEK	21,214,705	USD	2,634,026	2015/7/15	(60,521)	-
SEK	997,000	USD	121,596	2015/10/15	(400)	-
SEK	3,017,000	USD	368,303	2015/11/16	(1,254)	-
SEK	24,797,135	USD	3,033,730	2015/12/15	(14,657)	-
USD	1,903,730	CHF	1,778,000	2015/8/12	(11,290)	-
USD	268,962	EUR	240,343	2015/7/15	(247)	-
USD	3,667,795	EUR	3,300,000	2015/8/13	(30,066)	-
USD	3,481,437	EUR	3,119,615	2015/9/11	(15,793)	-
USD	3,669,521	EUR	3,300,000	2015/9/15	(30,158)	-
USD	3,671,362	EUR	3,300,000	2015/10/15	(30,223)	-
USD	3,947,654	EUR	3,546,276	2015/11/16	(32,579)	-
USD	40,210,852	GBP	26,907,931	2015/7/10	(2,176,301)	(0.12)
USD	273	NOK	2,147	2015/7/15	(1)	-
USD	679,613	SEK	5,647,581	2015/7/15	(5,481)	-
USD	346,107	SEK	3,000,000	2015/8/13	(18,049)	-
USD	461,754	SEK	4,000,000	2015/9/15	(24,138)	-
為替予約取引に係る評価損 計					(11,929,127)	(0.66)
為替予約取引に係る評価損益 計					(396,934)	(0.02)

取引相手方

評価(損)益

Bank of America	2,527,576
Citibank	(701,718)
Credit Suisse	20,533
Deutsche Bank	(11,703)
Goldman Sachs	3,450,664
J.P. Morgan	(149,364)
Morgan Stanley	803,531
RBS	(5,720,893)
Skandinaviska Enskilda Banken	(567,569)
Standard Chartered	(47,991)

(396,934)

クレジット・デフォルト・スワップ

想定元本	通貨	取引相手方	参照体	買/売	満期日	評価(損) 益		対純資産比率 (%)
						評価額 (米ドル)	(米ドル)	
			TVN Finance Corp.					
625,000	EUR	Goldman Sachs	III AB 7.375% 15/12/2020	Sell	20/06/2019	119,071	119,071	-
			Wind Acquisition Finance SA					
1,425,000	EUR	Barclays	11.750% 15/07/2017	Sell	20/06/2019	174,367	174,367	0.01
			クレジット・デフォルト・スワップに係る評価益 計			293,438	293,438	0.01
			Chesapeake Energy Corp. 6.625%					
3,425,000	USD	Bank of America	15/08/2020	Sell	20/06/2020	(71,790)	(71,790)	-
		Goldman Sachs	MBIA, Inc.	Sell	20/03/2017	(500,356)	(500,356)	(0.03)
			クレジット・デフォルト・スワップに係る評価損 計			(572,146)	(572,146)	(0.03)
			クレジット・デフォルト・スワップに係る評価損益 計			(278,708)	(278,708)	(0.02)
現金						37,770,945		2.10
その他資産(負債)						22,858,633		1.27
純資産 計						1,801,483,414		100.00

国別投資比率

対純資産比率 (%)

アメリカ	70.06
ルクセンブルグ	6.15
カナダ	5.89
イギリス	3.66
オランダ	2.48
フランス	1.46
バミューダ	1.39
ケイマン諸島	0.82
ドイツ	0.79
ベルギー	0.59
アイルランド	0.58
スウェーデン	0.52
イスラエル	0.27
カザフスタン	0.25
チェコ共和国	0.18
イギリス領バージン諸島	0.18

イタリア	0.16
オーストラリア	0.13
スペイン	0.07
有価証券 計	96.63
現金その他資産（負債）	3.37
合計	100.00

通貨

CAD :	カナダ・ドル
CHF :	スイス・フラン
EUR :	ユーロ
GBP :	イギリス・ポンド
JPY :	日本円
NOK :	ノルウェー・クローネ
SEK :	スウェーデン・クローナ
USD :	米ドル

*これらの証券は公正価値で評価されている。

**当該証券は現在、デフォルトしている。

T．ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドから提供を受けた情報をもとに作成しております。

*対純資産比率は、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの純資産に対する比率

*添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表

U.S. Aggregate Bond Fund

2015年6月30日現在（未監査）

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額（米ドル）	対純資産比率 （％）
公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券				
債券				
オーストラリア				
SGSP Australia Assets Pty. Ltd., Reg. S 3.3%				
09/04/2023	USD	400,000	384,256	0.23
			384,256	0.23
バミューダ				
Bermuda Government International Bond, 144A 4.854%				
06/02/2024	USD	205,000	218,775	0.13
			218,775	0.13
カナダ				
Province of Manitoba Canada 1.3% 03/04/2017	USD	275,000	277,499	0.17
Province of Ontario Canada 2.5% 10/09/2021	USD	230,000	232,693	0.14
			510,192	0.31
ケイマン諸島				
Alibaba Group Holding Ltd., 144A 2.5% 28/11/2019	USD	370,000	366,846	0.22
Baidu, Inc. 2.75% 09/06/2019	USD	400,000	400,150	0.24
Braskem Finance Ltd. 6.45% 03/02/2024	USD	205,000	194,555	0.11
Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd., Reg. S 4.5% 14/02/2022	USD	200,000	212,900	0.13
Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd., Reg. S 3.625% 16/01/2023	USD	200,000	201,821	0.12
Tencent Holdings Ltd., 144A 3.375% 02/05/2019	USD	435,000	445,823	0.27
			1,822,095	1.09
コロンビア				
Ecopetrol SA 5.875% 28/05/2045	USD	115,000	101,869	0.06
			101,869	0.06
ドイツ				
KFW 0.5% 19/04/2016	USD	240,000	240,246	0.14
			240,246	0.14
香港				
AIA Group Ltd., 144A 3.2% 11/03/2025	USD	305,000	295,208	0.18
CRCC Yupeng Ltd., Reg. S, FRN 3.95% Perpetual	USD	350,000	357,000	0.21
			652,208	0.39
インドネシア				
Indonesia Government International Bond, 144A 4.875%				
05/05/2021	USD	200,000	212,453	0.13

Perusahaan Listrik Negara PT, Reg. S 5.5% 22/11/2021	USD	205,000	217,318	0.13
			429,771	0.26
アイルランド				
Perrigo Co. PLC 2.3% 08/11/2018	USD	200,000	200,496	0.12
			200,496	0.12
日本				
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. (The), 144A 2.35%				
08/09/2019	USD	400,000	399,666	0.24
			399,666	0.24
ジャージー				
Heathrow Funding Ltd., 144A 4.875% 15/07/2023	USD	180,000	199,489	0.12
			199,489	0.12
ルクセンブルグ				
Actavis Funding SCS 3% 12/03/2020	USD	150,000	150,556	0.09
Actavis Funding SCS 3.8% 15/03/2025	USD	55,000	54,001	0.03
Actavis Funding SCS 4.55% 15/03/2035	USD	110,000	105,038	0.07
			309,595	0.19
メキシコ				
BBVA Bancomer SA, 144A 4.375% 10/04/2024	USD	295,000	297,943	0.18
Petroleos Mexicanos, 144A 3.5% 23/07/2020	USD	45,000	45,464	0.03
			343,407	0.21
オランダ				
ING Bank NV, Reg. S, FRN 4.125% 21/11/2023	USD	240,000	247,231	0.15
LYB International Finance BV 4% 15/07/2023	USD	245,000	251,058	0.15
Petrobras Global Finance BV 5.75% 20/01/2020	USD	165,000	163,287	0.10
Shell International Finance BV 2.125% 11/05/2020	USD	245,000	244,740	0.14
Shell International Finance BV 3.25% 11/05/2025	USD	710,000	703,986	0.42
			1,610,302	0.96
南アフリカ				
South Africa Government International Bond 6.875%				
27/05/2019	USD	200,000	227,925	0.14
South Africa Government International Bond 5.5% 09/03/2020	USD	100,000	109,009	0.06
			336,934	0.20
スウェーデン				
Svensk Exportkredit AB 5.125% 01/03/2017	USD	350,000	374,985	0.22
			374,985	0.22
スイス				
Credit Suisse AG, 144A 6.5% 08/08/2023	USD	400,000	438,624	0.26
			438,624	0.26
トルコ				

Turkiye Halk Bankasi A/S, 144A 4.75% 04/06/2019	USD	205,000	207,077	0.12
			207,077	0.12
<i>イギリス</i>				
Barclays Bank PLC 5.14% 14/10/2020	USD	560,000	609,560	0.37
Lloyds Bank PLC, 144A 6.5% 14/09/2020	USD	600,000	693,351	0.42
Royal Bank of Scotland PLC (The) 6.125% 11/01/2021	USD	320,000	368,843	0.22
Standard Chartered PLC, 144A 1.7% 17/04/2018	USD	310,000	308,535	0.18
			1,980,289	1.19
<i>アメリカ</i>				
AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020	USD	315,000	312,214	0.19
AbbVie, Inc. 2.9% 06/11/2022	USD	30,000	29,085	0.02
AbbVie, Inc. 4.5% 14/05/2035	USD	330,000	324,814	0.19
Aflac, Inc. 3.625% 15/11/2024	USD	470,000	472,057	0.29
Agilent Technologies, Inc. 3.2% 01/10/2022	USD	25,000	24,282	0.01
Agilent Technologies, Inc. 3.875% 15/07/2023	USD	20,000	20,252	0.01
Alcoa, Inc. 5.72% 23/02/2019	USD	130,000	139,604	0.08
Alcoa, Inc. 5.125% 01/10/2024	USD	170,000	174,607	0.10
Alcoa, Inc. 5.95% 01/02/2037	USD	15,000	14,981	0.01
Ameriprise Financial, Inc. 7.3% 28/06/2019	USD	140,000	166,655	0.10
AmerisourceBergen Corp. 3.25% 01/03/2025	USD	370,000	357,951	0.21
Anadarko Petroleum Corp. 3.45% 15/07/2024	USD	15,000	14,811	0.01
Anthem, Inc. 4.65% 15/01/2043	USD	95,000	87,606	0.05
Arrow Electronics, Inc. 3.5% 01/04/2022	USD	85,000	83,791	0.05
Arrow Electronics, Inc. 4% 01/04/2025	USD	225,000	219,789	0.13
AT&T, Inc. 4.75% 15/05/2046	USD	110,000	100,394	0.06
Avnet, Inc. 5.875% 15/06/2020	USD	175,000	194,116	0.12
Bank of America Corp. 2% 11/01/2018	USD	250,000	251,057	0.15
Bank of America Corp. 3.3% 11/01/2023	USD	585,000	576,088	0.35
Bank of America Corp. 4.2% 26/08/2024	USD	415,000	413,879	0.25
Bank of America Corp. 6.11% 29/01/2037	USD	355,000	399,620	0.24
Boeing Co. (The) 2.5% 01/03/2025	USD	75,000	71,546	0.04
Branch Banking & Trust Co. 3.8% 30/10/2026	USD	325,000	329,233	0.20
Burlington Northern Santa Fe LLC 5.15% 01/09/2043	USD	240,000	259,343	0.16
Cardinal Health, Inc. 3.75% 15/09/2025	USD	115,000	115,019	0.07
CC Holdings GS V LLC 3.849% 15/04/2023	USD	575,000	570,245	0.34
CNA Financial Corp. 5.875% 15/08/2020	USD	300,000	341,641	0.20
CNOOC Finance 2015 USA LLC 3.5% 05/05/2025	USD	250,000	241,118	0.14
Continental Resources, Inc. 5% 15/09/2022	USD	205,000	202,019	0.12
Delphi Corp. 5% 15/02/2023	USD	285,000	304,887	0.18
Discover Financial Services 3.75% 04/03/2025	USD	120,000	114,292	0.07
Energy Transfer Partners LP 5.2% 01/02/2022	USD	15,000	15,698	0.01

Enterprise Products Operating LLC 3.35% 15/03/2023	USD	185,000	181,232	0.11
EQT Corp. 4.875% 15/11/2021	USD	115,000	121,478	0.07
Exelon Corp. 2.85% 15/06/2020	USD	85,000	85,539	0.05
Exelon Generation Co. LLC 6.25% 01/10/2039	USD	145,000	161,076	0.10
FirstEnergy Corp. 2.75% 15/03/2018	USD	65,000	65,954	0.04
FirstEnergy Corp. 4.25% 15/03/2023	USD	130,000	130,957	0.08
FirstEnergy Corp. 7.375% 15/11/2031	USD	155,000	189,346	0.11
FNMA 4.375% 15/10/2015	USD	300,000	303,661	0.18
GATX Corp. 3.5% 15/07/2016	USD	110,000	112,419	0.07
GATX Corp. 2.5% 15/03/2019	USD	150,000	148,884	0.09
GATX Corp. 2.5% 30/07/2019	USD	180,000	178,569	0.11
GATX Corp. 4.85% 01/06/2021	USD	150,000	164,646	0.10
General Motors Co. 4% 01/04/2025	USD	230,000	225,435	0.14
General Motors Co. 6.25% 02/10/2043	USD	100,000	112,030	0.07
General Motors Co. 5.2% 01/04/2045	USD	220,000	217,047	0.13
General Motors Financial Co., Inc. 6.75% 01/06/2018	USD	250,000	278,721	0.17
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 7.5% 15/02/2019	USD	175,000	205,509	0.12
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 5.75% 24/01/2022	USD	1,065,000	1,211,294	0.73
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.625% 22/01/2023	USD	695,000	695,024	0.42
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 6.75% 01/10/2037	USD	205,000	241,564	0.14
Harris Corp. 2.7% 27/04/2020	USD	40,000	39,613	0.02
Harris Corp. 3.832% 27/04/2025	USD	55,000	53,666	0.03
Humana, Inc. 3.85% 01/10/2024	USD	290,000	293,377	0.18
Humana, Inc. 4.95% 01/10/2044	USD	250,000	249,316	0.15
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 4% 15/03/2022	USD	170,000	172,666	0.10
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 3.75% 15/02/2023	USD	70,000	69,567	0.04
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 4.2% 15/04/2024	USD	285,000	289,704	0.17
J.P. Morgan Chase & Co. 4.5% 24/01/2022	USD	360,000	386,267	0.23
Life Technologies Corp. 6% 01/03/2020	USD	310,000	352,433	0.21
Lockheed Martin Corp. 3.6% 01/03/2035	USD	195,000	180,535	0.11
Lockheed Martin Corp. 3.8% 01/03/2045	USD	270,000	243,208	0.15
Marsh & McLennan Cos, Inc. 2.35% 06/03/2020	USD	170,000	169,498	0.10
Marsh & McLennan Cos, Inc. 3.5% 03/06/2024	USD	350,000	349,737	0.21
Martin Marietta Materials, Inc. 4.25% 02/07/2024	USD	350,000	353,418	0.21
Medtronic, Inc. 2.75% 01/04/2023	USD	70,000	67,904	0.04
Morgan Stanley 2.125% 25/04/2018	USD	355,000	357,755	0.21
Morgan Stanley 7.3% 13/05/2019	USD	175,000	205,871	0.12
Morgan Stanley 5.5% 28/07/2021	USD	405,000	457,245	0.27
Morgan Stanley 3.75% 25/02/2023	USD	690,000	700,526	0.42
Morgan Stanley 5% 24/11/2025	USD	240,000	252,071	0.15
Newell Rubbermaid, Inc. 2.05% 01/12/2017	USD	55,000	55,441	0.03

Newfield Exploration Co. 5.75% 30/01/2022	USD	215,000	218,603	0.13
Noble Energy, Inc. 4.15% 15/12/2021	USD	105,000	109,461	0.07
Noble Energy, Inc. 6% 01/03/2041	USD	120,000	127,169	0.08
Occidental Petroleum Corp. 3.5% 15/06/2025	USD	250,000	249,477	0.15
Omnicom Group, Inc. 3.625% 01/05/2022	USD	70,000	70,377	0.04
Omnicom Group, Inc. 3.65% 01/11/2024	USD	375,000	369,595	0.22
Oracle Corp. 4.125% 15/05/2045	USD	450,000	418,882	0.25
Reinsurance Group of America, Inc. 6.45% 15/11/2019	USD	70,000	80,749	0.05
Reinsurance Group of America, Inc. 5% 01/06/2021	USD	105,000	115,148	0.07
Reynolds American, Inc. 4% 12/06/2022	USD	115,000	117,329	0.07
Reynolds American, Inc. 3.25% 01/11/2022	USD	90,000	86,734	0.05
Reynolds American, Inc. 5.85% 15/08/2045	USD	195,000	204,331	0.12
Rowan Cos, Inc. 4.875% 01/06/2022	USD	100,000	99,264	0.06
SESI LLC 6.375% 01/05/2019	USD	315,000	323,102	0.19
SESI LLC 7.125% 15/12/2021	USD	25,000	26,625	0.02
Southwestern Energy Co. 4.95% 23/01/2025	USD	160,000	161,920	0.10
Thermo Fisher Scientific, Inc. 2.4% 01/02/2019	USD	40,000	40,010	0.02
Time Warner Cable, Inc. 6.75% 01/07/2018	USD	25,000	27,931	0.02
Time Warner Cable, Inc. 8.75% 14/02/2019	USD	10,000	11,894	0.01
Time Warner Cable, Inc. 8.25% 01/04/2019	USD	95,000	111,826	0.07
Time Warner Cable, Inc. 5% 01/02/2020	USD	40,000	43,093	0.03
Time Warner Cable, Inc. 4% 01/09/2021	USD	15,000	15,419	0.01
Time Warner Cable, Inc. 6.55% 01/05/2037	USD	80,000	83,584	0.05
Time Warner Cable, Inc. 6.75% 15/06/2039	USD	75,000	79,999	0.05
Tyson Foods, Inc. 4.5% 15/06/2022	USD	130,000	138,109	0.08
Tyson Foods, Inc. 3.95% 15/08/2024	USD	120,000	120,866	0.07
Unum Group 5.625% 15/09/2020	USD	80,000	90,246	0.05
US Bank NA 2.125% 28/10/2019	USD	500,000	500,848	0.30
US Treasury 0.375% 31/08/2015	USD	2,065,000	2,066,250	1.24
US Treasury 2.625% 30/04/2016	USD	1,475,000	1,503,607	0.90
US Treasury 0.875% 28/02/2017	USD	320,000	321,794	0.19
US Treasury 0.875% 15/01/2018	USD	4,600,000	4,601,797	2.76
US Treasury 1.25% 31/10/2018	USD	3,445,000	3,457,246	2.07
US Treasury 1.5% 31/05/2019	USD	2,405,000	2,418,340	1.45
US Treasury 1.5% 30/11/2019	USD	2,605,000	2,605,204	1.56
US Treasury 2% 31/08/2021	USD	2,030,000	2,036,661	1.22
US Treasury 5.375% 15/02/2031	USD	910,000	1,224,163	0.73
US Treasury 3.125% 15/02/2043	USD	500,000	500,859	0.30
US Treasury 3.375% 15/05/2044	USD	1,475,000	1,550,018	0.93
US Treasury 3% 15/11/2044	USD	3,880,000	3,796,944	2.27
US Treasury Inflation Indexed 2.283% 15/07/2015	USD	395,000	481,865	0.29

Verizon Communications, Inc. 4.5% 15/09/2020	USD	210,000	226,633	0.14
Verizon Communications, Inc. 5.15% 15/09/2023	USD	175,000	191,940	0.12
Verizon Communications, Inc. 6.4% 15/09/2033	USD	520,000	597,347	0.36
Western Gas Partners LP 4% 01/07/2022	USD	140,000	141,224	0.08
Williams Cos., Inc. (The) 3.7% 15/01/2023	USD	135,000	125,335	0.08
Williams Cos., Inc. (The) 4.55% 24/06/2024	USD	200,000	193,883	0.11
Williams Partners LP 6.3% 15/04/2040	USD	180,000	186,739	0.11
			49,543,337	29.67
イギリス領バージン諸島				
CCCI Treasure Ltd., Reg. S, FRN 3.5% Perpetual	USD	200,000	198,716	0.12
IFC Development Corporate Treasury Ltd., Reg. S 2.375%				
21/05/2019	USD	300,000	297,597	0.18
			496,313	0.30
債券 計			60,799,926	36.41
株式				
アメリカ				
American Tower Corp., REIT Preference 5.25%	USD	833	85,420	0.05
			85,420	0.05
株式 計			85,420	0.05
公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 計			60,885,346	36.46
その他の規制のある市場において取引されている有価証券				
債券				
オーストラリア				
APT Pipelines Ltd., 144A 3.875% 11/10/2022	USD	120,000	118,897	0.07
Origin Energy Finance Ltd., 144A 3.5% 09/10/2018	USD	405,000	414,740	0.25
SMART ABS Trust, Series 2012-4US Class A4A 1.25%				
14/08/2018	USD	265,000	264,969	0.16
SMART ABS Trust, Series 2015-1US Class A3A 1.5% 14/09/2018	USD	85,000	85,409	0.05
SMART ABS Trust, Series 2013-1US Class A4A 1.05%				
14/10/2018	USD	90,000	90,191	0.06
SMART ABS Trust, Series 2013-2US Class A4A 1.18%				
14/02/2019	USD	110,000	109,681	0.07
SMART ABS Trust, Series 2014-1US Class A4A 1.68%				
14/12/2019	USD	275,000	277,387	0.16
Telstra Corp. Ltd., 144A 3.125% 07/04/2025	USD	295,000	288,497	0.17
			1,649,771	0.99
ケイマン諸島				
HPHT Finance 15 Ltd., 144A 2.25% 17/03/2018	USD	200,000	200,288	0.12
Noble Holding International Ltd. 5.95% 01/04/2025	USD	200,000	197,191	0.12
Odebrecht Finance Ltd., 144A 7.125% 26/06/2042	USD	205,000	157,303	0.09
			554,782	0.33
チリ				

Banco Santander Chile, 144A 3.875% 20/09/2022	USD	150,000	152,851	0.09
			152,851	0.09
コロンビア				
Ecopetrol SA 4.125% 16/01/2025	USD	205,000	187,661	0.11
			187,661	0.11
フランス				
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	400,000	407,680	0.24
Credit Agricole SA, 144A 2.5% 15/04/2019	USD	250,000	251,709	0.15
Credit Agricole SA, 144A 2.75% 10/06/2020	USD	250,000	250,455	0.15
			909,844	0.54
ルクセンブルグ				
Holcim US Finance Sarl & Cie SCS, 144A 6% 30/12/2019	USD	135,000	152,804	0.09
SES SA, 144A 3.6% 04/04/2023	USD	95,000	95,884	0.06
			248,688	0.15
メキシコ				
Petroleos Mexicanos 4.875% 24/01/2022	USD	435,000	452,015	0.27
Petroleos Mexicanos 6.5% 02/06/2041	USD	145,000	151,910	0.09
			603,925	0.36
オランダ				
Airbus Group Finance BV, 144A 2.7% 17/04/2023	USD	235,000	226,045	0.14
ING Bank NV, 144A 2.45% 16/03/2020	USD	200,000	199,730	0.12
			425,775	0.26
スウェーデン				
Nordea Bank AB, 144A 4.875% 13/05/2021	USD	290,000	313,252	0.19
			313,252	0.19
イギリス				
Anglo American Capital PLC, 144A 3.625% 14/05/2020	USD	400,000	400,299	0.24
HSBC Holdings PLC, FRN 6.375% Perpetual	USD	200,000	201,634	0.12
Lanark Master Issuer PLC, FRN, Series 2013-1A Class 1A1				
144A 0.784% 22/12/2054	USD	232,242	232,351	0.14
Santander UK PLC, 144A 5% 07/11/2023	USD	470,000	483,083	0.29
WPP Finance 2010 4.75% 21/11/2021	USD	485,000	532,086	0.32
			1,849,453	1.11
アメリカ				
21st Century Fox America, Inc. 4.75% 15/09/2044	USD	195,000	191,469	0.11
Ally Auto Receivables Trust, Series 2012-A Class D 144A				
3.15% 15/10/2018	USD	70,000	71,252	0.04
Ally Master Owner Trust, Series 2014-1 Class A2 1.29%				
15/01/2019	USD	145,000	145,363	0.09
Ally Master Owner Trust, Series 2014-4 Class A2 1.43%				
17/06/2019	USD	550,000	551,816	0.33

Ally Master Owner Trust, Series 2015-3 Class A 1.63%				
15/05/2020	USD	575,000	575,505	0.34
Amazon.com, Inc. 3.8% 05/12/2024	USD	250,000	251,234	0.15
Amazon.com, Inc. 4.95% 05/12/2044	USD	410,000	403,875	0.24
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 Class				
A 4% 15/01/2027	USD	69,282	70,971	0.04
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-2 Class				
A 4.95% 15/07/2024	USD	183,168	194,616	0.12
American Airlines Pass Through Trust, Series 2014-1 Class				
B 4.375% 01/04/2024	USD	157,394	159,755	0.10
American Airlines Pass Through Trust, Series 2015-1 Class				
B 3.7% 01/11/2024	USD	50,000	49,438	0.03
American Express Credit Account Master Trust, Series 2012-				
5 Class C 144A 1.07% 15/05/2018	USD	100,000	100,109	0.06
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-1				
Class A3 1.26% 08/11/2019	USD	65,000	65,079	0.04
Anthem, Inc. 3.5% 15/08/2024	USD	290,000	278,799	0.17
Apple, Inc. 2.4% 03/05/2023	USD	500,000	478,743	0.29
Ascentium Equipment Receivables LLC, Series 2015-1A Class				
A3 144A 1.61% 13/10/2020	USD	82,000	82,311	0.05
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2013-1A				
Class A 144A 1.92% 20/09/2019	USD	270,000	269,524	0.16
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2013-2A				
Class A 144A 2.97% 20/02/2020	USD	160,000	164,556	0.10
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2014-1A				
Class A 144A 2.46% 20/07/2020	USD	280,000	282,275	0.17
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2014-2A				
Class A 144A 2.5% 20/02/2021	USD	120,000	120,038	0.07
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2015-2A				
Class A 144A 2.63% 20/12/2021	USD	255,000	254,728	0.15
Babs, Direct Subsidy 6.75% 01/08/2049	USD	150,000	213,305	0.13
Banc of America Commercial Mortgage Trust, FRN, Series				
2006-3 Class AM 5.843% 10/07/2044	USD	140,000	143,763	0.09
Banc of America Commercial Mortgage Trust, FRN, Series				
2007-4 Class AM 5.811% 10/02/2051	USD	370,000	397,944	0.24
Banc of America Commercial Mortgage Trust, Series 2006-5				
Class AM 5.448% 10/09/2047	USD	275,000	286,231	0.17
Banc of America Commercial Mortgage Trust, Series 2007-5				
Class A4 5.492% 10/02/2051	USD	106,662	112,781	0.07
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-A Class				
2A2 2.666% 25/02/2034	USD	14,554	14,501	0.01

Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-B Class 2A2 2.655% 25/03/2034	USD	79,787	80,691	0.05
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-D Class 2A2 2.708% 25/05/2034	USD	192,786	192,952	0.12
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-H Class 2A2 2.674% 25/09/2034	USD	88,902	87,604	0.05
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-I Class 3A2 2.621% 25/10/2034	USD	33,978	33,784	0.02
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J Class 2A1 2.696% 25/11/2035	USD	220,165	204,005	0.12
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J Class 3A1 2.746% 25/11/2035	USD	94,818	90,182	0.05
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2015-1 Class A 2.2% 15/12/2022	USD	100,000	100,526	0.06
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2015-2 Class A 1.56% 15/03/2021	USD	410,000	409,959	0.25
Bay Area Toll Authority 6.263% 01/04/2049	USD	155,000	203,066	0.12
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-PW17 Class A4 5.694% 11/06/2050	USD	120,000	128,297	0.08
Cabela's Credit Card Master Note Trust, Series 2012-1A Class A1 144A 1.63% 18/02/2020	USD	100,000	100,933	0.06
Cabela's Credit Card Master Note Trust, Series 2012-2A Class A1 144A 1.45% 15/06/2020	USD	500,000	502,548	0.30
Cabela's Credit Card Master Note Trust, Series 2015-1A Class A1 2.26% 15/03/2023	USD	165,000	166,443	0.10
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2013-1 Class B 1.29% 20/04/2018	USD	15,000	15,010	0.01
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2013-1 Class C 1.74% 22/10/2018	USD	20,000	20,069	0.01
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2014-1 Class C 2.84% 22/04/2019	USD	30,000	30,479	0.02
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2015-2 Class A3 1.73% 20/09/2019	USD	240,000	239,993	0.14
Capital One Multi-Asset Execution Trust, Series 2015-A1 Class A 1.39% 15/01/2021	USD	230,000	229,746	0.14
CarMax Auto Owner Trust, Series 2012-1 Class A4 1.25% 15/06/2017	USD	230,401	231,036	0.14
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 Class B 1.69% 15/08/2019	USD	25,000	25,063	0.02
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 Class C 1.93% 15/11/2019	USD	35,000	35,059	0.02

Celgene Corp. 3.625% 15/05/2024	USD	400,000	401,430	0.24
Celgene Corp. 5.25% 15/08/2043	USD	110,000	116,325	0.07
Celgene Corp. 4.625% 15/05/2044	USD	290,000	279,438	0.17
Chase Issuance Trust, Series 2013-A8 Class A8 1.01%				
15/10/2018	USD	145,000	145,257	0.09
Chase Issuance Trust, Series 2015-A2 Class A2 1.59%				
18/02/2020	USD	265,000	266,702	0.16
Chicago Metropolitan Water Reclamation 5.72% 01/12/2038	USD	110,000	130,078	0.08
Chicago O Hare International Airport 6.395% 01/01/2040	USD	170,000	210,741	0.13
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2014-GC25				
Class A4 3.635% 10/10/2047	USD	705,000	726,113	0.43
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC27				
Class A5 3.137% 10/02/2048	USD	225,000	221,953	0.13
City of Los Angeles Department of Airports 7.053%				
15/05/2040	USD	70,000	93,636	0.06
City of New York 6.271% 01/12/2037	USD	165,000	210,205	0.13
CNH Equipment Trust, Series 2013-D Class A3 0.77%				
15/10/2018	USD	150,000	149,878	0.09
CNH Equipment Trust, Series 2012-D Class B 1.27%				
15/05/2020	USD	105,000	105,290	0.06
COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2007-C3				
Class AM 5.765% 15/05/2046	USD	150,000	160,545	0.10
Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2006-C7 Class AM				
5.775% 10/06/2046	USD	160,000	165,962	0.10
Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2014-TWC Class A				
144A 1.03% 13/02/2032	USD	100,000	99,775	0.06
Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2014-UBS2 Class C				
4.983% 10/03/2047	USD	110,000	116,411	0.07
Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2014-UBS4 Class C				
4.625% 10/08/2047	USD	150,000	147,688	0.09
Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LC21 Class B				
4.313% 10/07/2048	USD	170,000	175,588	0.11
Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LC21 Class C				
4.313% 10/07/2048	USD	95,000	92,694	0.06
Commercial Mortgage Trust, Series 2007-GG9 Class AM 5.475%				
10/03/2039	USD	150,000	156,885	0.09
Commercial Mortgage Trust, Series 2007-GG9 Class AMFX				
5.475% 10/03/2039	USD	220,000	230,851	0.14
Commercial Mortgage Trust, Series 2014-CR20 Class A4 3.59%				
10/11/2047	USD	655,000	671,767	0.40
Commercial Mortgage Trust, Series 2014-LC17 Class A5				
3.917% 10/10/2047	USD	300,000	316,142	0.19

Commercial Mortgage Trust, Series 2014-UBS5 Class A4				
3.838% 10/09/2047	USD	395,000	412,625	0.25
Commercial Mortgage Trust, Series 2014-UBS6 Class A5				
3.644% 10/12/2047	USD	580,000	596,549	0.36
Commonwealth of Massachusetts 4.5% 01/08/2031	USD	160,000	173,416	0.10
Commonwealth of Virginia Transportation Board 5.35%				
15/05/2035	USD	130,000	149,373	0.09
Continental Airlines Pass Through Trust, Series 2010-1				
Class A 4.75% 12/07/2022	USD	55,950	59,587	0.04
Continental Airlines Pass Through Trust, Series 2012-1				
Class A 4.15% 11/10/2025	USD	40,570	41,534	0.02
Continental Airlines Pass Through Trust, Series 2012-2				
Class A 4.625% 03/12/2026	USD	103,875	109,004	0.07
Credit Suisse Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2008-				
C1 Class A3 5.97% 15/02/2041	USD	385,000	417,181	0.25
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.663% 15/05/2025	USD	255,000	249,543	0.15
Crown Castle Towers LLC, 144A 6.113% 15/01/2040	USD	113,000	128,983	0.08
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.222% 15/05/2042	USD	25,000	24,602	0.01
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C2 Class B				
4.208% 15/06/2057	USD	85,000	87,120	0.05
CSMC, FRN, Series 2014-ICE Class A 144A 1.05% 15/04/2027	USD	100,000	99,786	0.06
DB Master Finance LLC, Series 2015-1A Class A2I 144A				
3.262% 20/02/2045	USD	89,775	90,254	0.05
Delta Air Lines Pass Through Trust Class A 5.3% 15/10/2020	USD	41,587	44,680	0.03
Delta Air Lines Pass Through Trust Class A 4.95%				
23/11/2020	USD	44,145	46,877	0.03
Denver City & County School 4.242% 15/12/2037	USD	70,000	68,500	0.04
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2013-2 Class A 144A				
2.27% 20/05/2026	USD	58,700	59,015	0.04
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2014-1 Class A 144A				
2.54% 20/05/2027	USD	107,504	107,904	0.06
Discover Bank 3.1% 04/06/2020	USD	250,000	250,345	0.15
District of Columbia 5.591% 01/12/2034	USD	60,000	71,581	0.04
Domino's Pizza Master Issuer LLC, Series 2012-1A Class A2				
144A 5.216% 25/01/2042	USD	289,875	299,739	0.18
East Bay Municipal Utility District Water System 5.874%				
01/06/2040	USD	115,000	142,935	0.09
Elara HGV Timeshare Issuer LLC, Series 2014-A Class A 144A				
2.53% 25/02/2027	USD	78,832	78,720	0.05
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2013-2 Class A2				
144A 1.06% 20/03/2019	USD	99,960	100,130	0.06

Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2015-1 Class A2				
144A 1.3% 20/09/2020	USD	585,000	586,034	0.35
Exelon Generation Co. LLC 2.95% 15/01/2020				
	USD	580,000	582,111	0.35
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2014-2A Class				
A 144A 1.06% 15/08/2018	USD	22,056	22,032	0.01
FHLMC A26586 6% 01/09/2034	USD	5,186	5,897	-
FHLMC A71375 6% 01/01/2038	USD	5,470	6,237	-
FHLMC A71803 6% 01/01/2038	USD	2,453	2,791	-
FHLMC A90053 4.5% 01/12/2039	USD	79,081	86,146	0.05
FHLMC A91947 5% 01/04/2040	USD	20,780	23,038	0.01
FHLMC A93451 4.5% 01/08/2040	USD	300,879	325,644	0.20
FHLMC A94185 4% 01/10/2040	USD	3,366	3,570	-
FHLMC A94251 4% 01/10/2040	USD	2,534	2,688	-
FHLMC A94576 4% 01/10/2040	USD	1,564	1,658	-
FHLMC A94713 4% 01/11/2040	USD	2,636	2,795	-
FHLMC A95734 4% 01/12/2040	USD	21,949	23,351	0.01
FHLMC A96312 4% 01/01/2041	USD	101,605	107,775	0.06
FHLMC A97620 4.5% 01/03/2041	USD	3,767	4,071	-
FHLMC C01787 6% 01/02/2034	USD	79,426	90,701	0.05
FHLMC C04238 3.5% 01/09/2042	USD	473,264	487,467	0.29
FHLMC C09036 3.5% 01/03/2043	USD	288,474	297,061	0.18
FHLMC C09042 3.5% 01/05/2043	USD	216,394	222,727	0.13
FHLMC E01341 5.5% 01/03/2018	USD	9,860	10,306	0.01
FHLMC E01497 5.5% 01/11/2018	USD	3,470	3,672	-
FHLMC G01777 6% 01/02/2035	USD	75,288	86,272	0.05
FHLMC G01899 6% 01/09/2035	USD	26,436	30,290	0.02
FHLMC G02712 6% 01/12/2028	USD	12,813	14,657	0.01
FHLMC G03551 6% 01/11/2037	USD	108,342	122,855	0.07
FHLMC G04814 5.5% 01/10/2038	USD	373,462	418,466	0.25
FHLMC G05535 4.5% 01/07/2039	USD	204,432	221,013	0.13
FHLMC G05659 4.5% 01/10/2039	USD	279,817	302,478	0.18
FHLMC G05955 5% 01/08/2040	USD	208,552	230,997	0.14
FHLMC G05958 5% 01/08/2040	USD	481,017	534,450	0.32
FHLMC G06231 4% 01/12/2040	USD	166,237	176,300	0.11
FHLMC G06252 4% 01/02/2041	USD	4,247	4,512	-
FHLMC G06506 4% 01/12/2040	USD	845	896	-
FHLMC G07543 4.5% 01/08/2041	USD	42,209	45,992	0.03
FHLMC G07972 4.5% 01/10/2044	USD	398,907	432,717	0.26
FHLMC G08016 6% 01/10/2034	USD	397,889	455,562	0.27
FHLMC G08534 3% 01/06/2043	USD	403,933	402,136	0.24
FHLMC G08633 4% 01/03/2045	USD	1,715,604	1,817,905	1.09

FHLMC G18465 2.5% 01/05/2028	USD	166,487	169,912	0.10
FHLMC J03640 6% 01/10/2021	USD	41,561	44,873	0.03
FHLMC J15139 4% 01/05/2026	USD	79,662	85,189	0.05
FHLMC Q04674 4% 01/12/2041	USD	65,340	69,263	0.04
FHLMC Q14426 3% 01/01/2043	USD	576,572	574,337	0.34
FHLMC V80025 3% 01/04/2043	USD	43,593	43,415	0.03
FHLMC, FRN, Series 2014-HQ2 Class M2 2.385% 25/09/2024	USD	250,000	248,466	0.15
FHLMC, FRN, Series 2015-DN1 Class M2 2.585% 25/01/2025	USD	250,000	251,033	0.15
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA1 Class M2 2.037% 25/10/2027	USD	250,000	245,951	0.15
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA2 Class M2 2.787% 25/12/2027	USD	250,000	250,635	0.15
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ1 Class M2 2.385% 25/03/2025	USD	250,000	248,439	0.15
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ2 Class M2 2.135% 25/05/2025	USD	250,000	246,146	0.15
FHLMC, Series K025 Class A1 1.875% 25/04/2022	USD	114,689	115,161	0.07
FHLMC, Series K502 Class A2 1.426% 25/08/2017	USD	75,000	75,641	0.05
FirstEnergy Transmission LLC, 144A 4.35% 15/01/2025	USD	480,000	490,687	0.29
Florida Hurricane Catastrophe Fund Finance Corp. 1.298% 01/07/2016	USD	125,000	125,910	0.08
Florida Hurricane Catastrophe Fund Finance Corp. 2.995% 01/07/2020	USD	140,000	143,375	0.09
FNMA 190360 5% 01/08/2035	USD	41,324	45,657	0.03
FNMA 190399 5.5% 01/11/2039	USD	377,955	424,198	0.25
FNMA 254140 5.5% 01/01/2017	USD	5,945	6,096	-
FNMA 254903 5% 01/10/2033	USD	24,583	27,334	0.02
FNMA 545759 6.5% 01/07/2032	USD	39,469	45,999	0.03
FNMA 555526 5.5% 01/05/2018	USD	7,922	8,236	-
FNMA 569097 6.5% 01/03/2016	USD	5,319	5,371	-
FNMA 670373 6.5% 01/09/2017	USD	21,281	21,990	0.01
FNMA 7.125% 15/01/2030	USD	100,000	147,860	0.09
FNMA 725027 5% 01/11/2033	USD	25,569	28,355	0.02
FNMA 725229 6% 01/03/2034	USD	127,248	145,581	0.09
FNMA 725232 5% 01/03/2034	USD	10,508	11,654	0.01
FNMA 725238 5% 01/03/2034	USD	44,394	49,233	0.03
FNMA 735061 6% 01/11/2034	USD	15,222	17,405	0.01
FNMA 735115 6% 01/12/2034	USD	4,711	5,388	-
FNMA 735141 5.5% 01/01/2035	USD	81,360	91,796	0.05
FNMA 735318 4.5% 01/11/2019	USD	16,105	16,826	0.01
FNMA 735500 5.5% 01/05/2035	USD	28,470	32,094	0.02
FNMA 735502 6% 01/04/2035	USD	8,860	10,133	0.01
FNMA 735575 5.5% 01/12/2018	USD	7,686	7,951	-
FNMA 735578 5% 01/06/2035	USD	70,893	78,389	0.05
FNMA 735579 5% 01/06/2035	USD	10,957	12,145	0.01

FNMA 735580 5% 01/06/2035	USD	6,191	6,864	-
FNMA 735591 5% 01/06/2035	USD	3,067	3,400	-
FNMA 735667 5% 01/07/2035	USD	20,430	22,661	0.01
FNMA 735669 5% 01/04/2035	USD	16,460	18,256	0.01
FNMA 735997 5.5% 01/11/2035	USD	26,278	29,602	0.02
FNMA 745428 5.5% 01/01/2036	USD	172,978	194,888	0.12
FNMA 745458 6% 01/04/2036	USD	479	546	-
FNMA 745947 6.5% 01/10/2036	USD	7,867	9,045	0.01
FNMA 750412 6.5% 01/11/2033	USD	17,244	19,826	0.01
FNMA 888223 5.5% 01/01/2036	USD	31,658	35,680	0.02
FNMA 888284 5.5% 01/04/2037	USD	134,582	151,114	0.09
FNMA 888430 5% 01/11/2033	USD	26,138	28,988	0.02
FNMA 888437 5.5% 01/11/2036	USD	488,416	550,130	0.33
FNMA 889298 5% 01/12/2036	USD	92,395	102,117	0.06
FNMA 889307 5% 01/07/2037	USD	31,469	34,902	0.02
FNMA 889579 6% 01/05/2038	USD	7,049	8,014	-
FNMA 889829 5% 01/07/2035	USD	278,488	309,445	0.19
FNMA 890527 4.5% 01/09/2042	USD	124,142	134,714	0.08
FNMA 890565 3% 01/11/2043	USD	263,161	262,795	0.16
FNMA 900724 5.5% 01/08/2021	USD	5,756	6,267	-
FNMA 901646 6.5% 01/12/2036	USD	2,366	2,720	-
FNMA 902382 6.5% 01/11/2036	USD	10,638	12,234	0.01
FNMA 906064 6% 01/01/2037	USD	1,397	1,590	-
FNMA 933051 6.5% 01/10/2037	USD	66,523	78,606	0.05
FNMA 942477 6% 01/08/2022	USD	3,965	4,318	-
FNMA 948410 6% 01/08/2022	USD	4,540	4,876	-
FNMA 995024 5.5% 01/08/2037	USD	366,278	412,855	0.25
FNMA 995051 6% 01/03/2037	USD	114,270	130,313	0.08
FNMA 995112 5.5% 01/07/2036	USD	55,553	62,648	0.04
FNMA 995203 5% 01/07/2035	USD	156,511	173,588	0.10
FNMA 995388 5.5% 01/08/2037	USD	17,467	19,654	0.01
FNMA 995434 5% 01/09/2023	USD	100,932	108,601	0.07
FNMA 995629 6.5% 01/12/2032	USD	44,957	52,414	0.03
FNMA AB6317 3.5% 01/09/2042	USD	32,341	33,391	0.02
FNMA AB6491 3% 01/10/2042	USD	74,091	73,988	0.04
FNMA AB6633 3.5% 01/10/2042	USD	221,248	228,411	0.14
FNMA AB6670 3% 01/10/2042	USD	58,834	58,752	0.04
FNMA AB6768 3% 01/10/2042	USD	94,354	94,222	0.06
FNMA AB7143 2.5% 01/12/2027	USD	234,183	238,180	0.14
FNMA AB7728 2.5% 01/01/2043	USD	122,942	117,931	0.07
FNMA AB7733 3% 01/01/2043	USD	280,102	279,661	0.17

FNMA AB7846 3% 01/02/2043	USD	154,244	154,030	0.09
FNMA AB8700 3% 01/03/2043	USD	991,224	989,668	0.59
FNMA AB8898 3% 01/04/2043	USD	292,765	292,146	0.17
FNMA AC9580 4.5% 01/02/2040	USD	1,347,817	1,460,114	0.87
FNMA AC9582 5.5% 01/01/2040	USD	79,734	89,619	0.05
FNMA AE0624 4% 01/11/2040	USD	139,087	147,900	0.09
FNMA AE0698 4.5% 01/12/2040	USD	55,004	59,562	0.04
FNMA AE5471 4.5% 01/10/2040	USD	44,172	47,842	0.03
FNMA AH1111 4% 01/12/2040	USD	606,825	644,024	0.39
FNMA AL0065 4.5% 01/04/2041	USD	193,390	209,451	0.13
FNMA AL0251 5% 01/07/2037	USD	6,021	6,677	-
FNMA AL0546 5% 01/07/2041	USD	257,373	285,094	0.17
FNMA AL1105 4.5% 01/12/2040	USD	148,839	161,223	0.10
FNMA AL1524 4.5% 01/12/2040	USD	39,820	43,167	0.03
FNMA AL1577 5% 01/01/2042	USD	42,691	47,199	0.03
FNMA AL1697 4% 01/10/2041	USD	484,291	515,208	0.31
FNMA AL1938 4% 01/12/2026	USD	74,105	78,838	0.05
FNMA AL1950 4% 01/06/2042	USD	113,146	120,634	0.07
FNMA AL2462 2.5% 01/10/2027	USD	269,028	274,109	0.16
FNMA AL2579 4% 01/12/2026	USD	257,876	274,343	0.16
FNMA AL2645 4.5% 01/01/2027	USD	282,043	301,911	0.18
FNMA AL2661 4% 01/10/2026	USD	29,804	31,719	0.02
FNMA AL3192 5% 01/05/2042	USD	197,593	218,662	0.13
FNMA AL3318 3.5% 01/03/2043	USD	26,170	27,060	0.02
FNMA AL4301 4.5% 01/04/2042	USD	94,148	101,991	0.06
FNMA AL5224 5% 01/02/2038	USD	22,185	24,570	0.01
FNMA AL5590 5.5% 01/09/2041	USD	15,517	17,499	0.01
FNMA AL6078 5% 01/03/2042	USD	54,011	59,734	0.04
FNMA AL6549 5% 01/07/2042	USD	495,859	547,953	0.33
FNMA AL6966 6.5% 01/08/2038	USD	60,000	69,139	0.04
FNMA A07977 3% 01/06/2027	USD	426,276	442,409	0.26
FNMA A09944 3.5% 01/07/2042	USD	387,382	399,420	0.24
FNMA AP7539 3% 01/09/2027	USD	143,134	148,556	0.09
FNMA AP9785 2.5% 01/10/2027	USD	236,314	240,785	0.14
FNMA AQ0535 3% 01/11/2042	USD	57,620	57,539	0.03
FNMA AQ8653 2.5% 01/12/2042	USD	8,655	8,303	-
FNMA AQ9316 2.5% 01/01/2043	USD	78,262	75,069	0.04
FNMA AR9188 2.5% 01/03/2043	USD	75,081	72,024	0.04
FNMA AS2275 4.5% 01/04/2044	USD	188,968	204,404	0.12
FNMA AS2751 4.5% 01/06/2044	USD	55,681	60,186	0.04
FNMA AS3855 3.5% 01/11/2044	USD	33,704	34,803	0.02

FNMA AS4794 3.5% 01/04/2045	USD	1,178,771	1,217,781	0.73
FNMA AS4864 2.5% 01/05/2030	USD	897,263	908,915	0.54
FNMA AT2016 3% 01/04/2043	USD	1,027,617	1,025,450	0.61
FNMA AT2060 2.5% 01/04/2028	USD	226,192	230,057	0.14
FNMA AT2717 2.5% 01/05/2043	USD	327,308	313,990	0.19
FNMA AU4288 4% 01/09/2043	USD	42,567	45,369	0.03
FNMA AX1336 4% 01/09/2044	USD	183,872	194,873	0.12
FNMA AX2509 3% 01/10/2029	USD	296,168	307,347	0.18
FNMA AX4923 2.5% 01/12/2029	USD	434,251	439,947	0.26
FNMA MA0907 4% 01/11/2041	USD	49,753	52,876	0.03
FNMA MA0971 4% 01/02/2042	USD	73,561	78,186	0.05
FNMA MA1086 3.5% 01/06/2042	USD	80,432	83,042	0.05
FNMA, FRN 763199 1.737% 01/10/2033	USD	19,804	20,732	0.01
FNMA, FRN 848522 1.861% 01/12/2035	USD	18,468	19,461	0.01
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2014-C04 Class 1M1 2.135% 25/11/2024	USD	97,325	98,080	0.06
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2014-C04 Class 2M1 2.285% 25/11/2024	USD	50,108	50,537	0.03
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2015-C01 Class 1M1 1.685% 25/02/2025	USD	34,378	34,426	0.02
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2015-C01 Class 2M1 1.685% 25/02/2025	USD	14,850	14,864	0.01
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2012-D Class D 1.97% 15/05/2019	USD	270,000	272,573	0.16
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2013-B Class D 1.82% 15/11/2019	USD	380,000	383,331	0.23
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2014-C Class A4 1.56% 15/02/2020	USD	40,000	40,301	0.02
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2014-1 Class A 144A 2.26% 15/11/2025	USD	600,000	608,335	0.36
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2014-K41 Class B 144A 3.83% 25/11/2047	USD	165,000	164,099	0.10
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K43 Class B 144A 3.735% 25/02/2048	USD	155,000	155,830	0.09
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K45 Class B 144A 3.714% 25/04/2048	USD	110,000	104,144	0.06
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K46 Class B 144A 3.696% 25/04/2048	USD	195,000	186,704	0.11
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K718 Class B 144A 3.669% 25/02/2022	USD	205,000	203,821	0.12
General Motors Financial Co., Inc. 4% 15/01/2025	USD	175,000	171,755	0.10

Gilead Sciences, Inc. 3.5% 01/02/2025	USD	95,000	95,246	0.06
GNMA 3306 5.5% 20/11/2032	USD	139,203	158,973	0.10
GNMA 3490 6.5% 20/12/2033	USD	129,403	154,111	0.09
GNMA 3611 6% 20/09/2034	USD	77,945	90,509	0.05
GNMA 4060 6% 20/12/2037	USD	10,477	11,911	0.01
GNMA 4498 6% 20/07/2039	USD	11,446	13,216	0.01
GNMA 4558 4.5% 20/10/2039	USD	225,361	246,164	0.15
GNMA 4559 5% 20/10/2039	USD	50,231	55,930	0.03
GNMA 4577 4.5% 20/11/2039	USD	23,203	25,345	0.02
GNMA 4618 5% 20/01/2040	USD	54,845	61,070	0.04
GNMA 4800 4% 20/09/2040	USD	98,815	105,781	0.06
GNMA 4801 4.5% 20/09/2040	USD	93,588	102,228	0.06
GNMA 4834 4.5% 20/10/2040	USD	74,717	81,615	0.05
GNMA 4854 4.5% 20/11/2040	USD	77,392	84,704	0.05
GNMA 4882 4% 20/12/2040	USD	160,154	171,445	0.10
GNMA 4946 4.5% 20/02/2041	USD	300,914	328,696	0.20
GNMA 4978 4.5% 20/03/2041	USD	82,917	90,573	0.05
GNMA 4979 5% 20/03/2041	USD	198,381	221,167	0.13
GNMA 5054 4% 20/05/2041	USD	133,332	142,692	0.09
GNMA 783403 3.5% 15/09/2041	USD	130,992	135,967	0.08
GNMA 784012 5.5% 15/10/2038	USD	16,400	18,968	0.01
GNMA AD1732 2.5% 15/02/2043	USD	78,206	75,616	0.05
GNMA MA0221 4% 20/07/2042	USD	249,093	264,986	0.16
GNMA MA0318 3.5% 20/08/2042	USD	154,162	160,224	0.10
GNMA MA0623 2.5% 20/12/2042	USD	129,430	125,082	0.07
GNMA MA0624 3% 20/12/2042	USD	160,391	162,701	0.10
GNMA MA0697 2.5% 20/01/2043	USD	515,117	497,814	0.30
GNMA MA1012 3.5% 20/05/2043	USD	800,100	831,728	0.50
GNMA MA1088 2.5% 20/06/2043	USD	191,678	185,234	0.11
GNMA MA1155 2.5% 20/07/2043	USD	121,788	117,692	0.07
GNMA MA2222 3% 20/09/2044	USD	366,830	370,554	0.22
GNMA MA2226 5% 20/09/2044	USD	52,963	57,689	0.03
GNMA MA2374 5% 20/11/2044	USD	632,642	690,180	0.41
GNMA MA2444 3% 20/12/2044	USD	413,903	417,851	0.25
GNMA MA2448 5% 20/12/2044	USD	70,339	76,772	0.05
GNMA MA2524 5% 20/01/2045	USD	32,405	35,297	0.02
GNMA MA2602 4% 20/02/2045	USD	871,186	922,543	0.55
GNMA MA2678 3.5% 20/03/2045	USD	747,662	778,815	0.47
GNMA MA2679 4% 20/03/2045	USD	908,867	967,944	0.58
GNMA MA2754 3.5% 20/04/2045	USD	1,486,298	1,548,420	0.93
GNMA, IO, Series 2010-92 Class PI 4.5% 20/11/2037	USD	186,814	11,723	0.01

GNMA, IO, Series 2010-103 Class IN 4.5% 20/02/2039	USD	59,934	3,718	-
GNMA, IO, Series 2011-41 Class AI 4.5% 20/12/2039	USD	325,571	36,872	0.02
GNMA, IO, Series 2011-88 Class EI 4.5% 20/11/2039	USD	56,444	6,016	-
GNMA, IO, Series 2012-94 Class BI 4% 20/05/2037	USD	208,004	34,033	0.02
GNMA, IO, Series 2013-24 Class OI 4% 20/02/2043	USD	97,004	18,445	0.01
Grain Spectrum Funding LLC, 144A 4% 10/10/2018	USD	195,000	200,669	0.12
GS Mortgage Securities Corp. II, Series 2012-GCJ9 Class A3 2.773% 10/11/2045	USD	135,000	134,347	0.08
GS Mortgage Securities Trust, Series 2015-GC28 Class A5 3.396% 10/02/2048	USD	500,000	502,958	0.30
GS Mortgage-Backed Securities Trust, FRN, Series 2014-EB1A Class 2A1 144A 2.501% 25/07/2044	USD	99,259	99,713	0.06
GSAA Trust, FRN, Series 2005-8 Class A3 0.617% 25/06/2035	USD	76,605	72,778	0.04
GTP Acquisition Partners I LLC 144A 2.35% 15/06/2045	USD	455,000	449,918	0.27
Hilton Grand Vacations Trust, Series 2014-AA Class A 144A 1.77% 25/11/2026	USD	112,019	111,254	0.07
HOA Funding LLC, Series 2014-1A Class A2 144A 4.846% 20/08/2044	USD	98,500	97,547	0.06
Honda Auto Receivables Owner Trust, Series 2014-4 Class A4 1.46% 15/10/2020	USD	30,000	30,058	0.02
Huntington Auto Trust, Series 2011-1A Class C 144A 2.53% 15/03/2017	USD	155,000	155,133	0.09
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2015-B Class A4 144A 1.66% 15/07/2019	USD	310,000	309,969	0.19
INVISTA Finance LLC, 144A 4.25% 15/10/2019	USD	60,000	59,366	0.04
J.P. Morgan Chase & Co. 3.875% 10/09/2024	USD	185,000	182,099	0.11
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2006-LDP8 Class AJ 5.48% 15/05/2045	USD	30,000	31,080	0.02
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2006-LDP9 Class A3 5.336% 15/05/2047	USD	153,369	160,315	0.10
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2007-CB18 Class A4 5.44% 12/06/2047	USD	160,450	168,423	0.10
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8 Class A3 2.829% 15/10/2045	USD	185,000	185,591	0.11
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-LC11 Class A5 2.96% 15/04/2046	USD	145,000	144,959	0.09
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-CB19 Class A4 5.697% 12/02/2049	USD	144,619	153,663	0.09
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-CB19 Class AM 5.697% 12/02/2049	USD	325,000	344,994	0.21

J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-LD12 Class A4 5.882% 15/02/2051	USD	210,000	223,647	0.13
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-LD12 Class AM 6.011% 15/02/2051	USD	200,000	215,211	0.13
JM Smucker Co. (The), 144A 2.5% 15/03/2020	USD	375,000	374,235	0.22
JobsOhio Beverage System Class B 4.532% 01/01/2035	USD	155,000	162,102	0.10
John Deere Owner Trust, Series 2015-A Class A4 1.65% 15/12/2021	USD	115,000	115,600	0.07
Kubota Credit Owner Trust, Series 2015-1A Class A3 144A 1.54% 15/03/2019	USD	585,000	586,286	0.35
LB-UBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2007-C2 Class AM 5.493% 15/02/2040	USD	225,000	236,389	0.14
LB-UBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2007-C6 Class AM 6.114% 15/07/2040	USD	160,000	171,507	0.10
LB-UBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2008-C1 Class AM 6.15% 15/04/2041	USD	110,000	119,770	0.07
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.85% 01/08/2044	USD	485,000	469,691	0.28
Marsh & McLennan Cos, Inc. 3.5% 10/03/2025	USD	75,000	74,473	0.04
Maryland State Transportation Authority 5.754% 01/07/2041	USD	85,000	102,431	0.06
Maryland State Transportation Authority 5.888% 01/07/2043	USD	165,000	206,568	0.12
Medtronic, Inc., 144A 3.5% 15/03/2025	USD	705,000	705,060	0.42
Medtronic, Inc., 144A 4.625% 15/03/2045	USD	265,000	268,793	0.16
Mercedes Benz Auto Lease Trust, Series 2013-B Class A4 0.76% 15/07/2019	USD	135,000	135,102	0.08
Mercedes Benz Auto Lease Trust, Series 2015-A Class A4 1.21% 15/10/2020	USD	150,000	150,324	0.09
Merrill Lynch Mortgage Trust, Series 2008-C1 Class A4 5.69% 12/02/2051	USD	76,329	82,410	0.05
Metropolitan Transportation Authority 7.336% 15/11/2039	USD	80,000	115,396	0.07
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2014-AA Class A4 144A 1.59% 08/02/2022	USD	110,000	109,686	0.07
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2015-AA Class A4 144A 1.93% 16/07/2021	USD	100,000	100,093	0.06
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C22 Class A4 3.306% 15/04/2048	USD	100,000	99,756	0.06
Morgan Stanley Capital I, Inc., FRN, Series 2015-MS1 Class AS 0% 15/05/2048	USD	20,000	20,573	0.01
Morgan Stanley Capital I, Inc., FRN, Series 2015-MS1 Class B 0% 15/05/2048	USD	55,000	54,772	0.03
Morgan Stanley Capital I, Inc., Series 2015-MS1 Class A4 3.779% 15/05/2048	USD	150,000	154,495	0.09

MWV Owner Trust, Series 2013-1A Class A 144A 2.15%				
22/04/2030	USD	54,674	54,884	0.03
MWV Owner Trust, Series 2014-1A Class A 144A 2.25%				
22/09/2031	USD	84,227	84,209	0.05
Navistar Financial Dealer Note Master Trust, FRN, Series				
2013-2 Class A 144A 0.865% 25/09/2018	USD	145,000	145,066	0.09
NBCUniversal Media LLC 2.875% 15/01/2023	USD	130,000	126,380	0.08
New York City Transitional Finance Authority 5.508%				
01/08/2037	USD	175,000	209,272	0.13
New York City Water and Sewer System 5.952% 15/06/2042	USD	120,000	151,687	0.09
Nissan Auto Lease Trust, Series 2013-B Class A3 0.75%				
15/06/2016	USD	32,364	32,378	0.02
Nissan Master Owner Trust, Series 2015-A Class A2 1.44%				
15/01/2020	USD	185,000	185,258	0.11
Nordstrom Credit Card Master Note Trust II, Series 2011-1A				
Class A 144A 2.28% 15/11/2019	USD	385,000	391,246	0.23
O'Reilly Automotive, Inc. 4.875% 14/01/2021	USD	175,000	192,203	0.12
Philadelphia Authority for Industrial Development 3.964%				
15/04/2026	USD	85,000	84,071	0.05
Port Authority of New York and New Jersey 4.458%				
01/10/2062	USD	330,000	325,076	0.19
Priceline Group, Inc. (The) 3.65% 15/03/2025	USD	365,000	357,817	0.22
Principal Financial Group, Inc., FRN 4.7% 15/05/2055	USD	220,000	219,394	0.13
QVC, Inc. 3.125% 01/04/2019	USD	335,000	334,250	0.20
QVC, Inc. 5.125% 02/07/2022	USD	55,000	56,650	0.03
QVC, Inc. 4.375% 15/03/2023	USD	15,000	14,756	0.01
QVC, Inc. 4.85% 01/04/2024	USD	260,000	258,951	0.16
San Diego County Water Authority Financing Corp. Class B				
6.138% 01/05/2049	USD	70,000	88,496	0.05
SBA Tower Trust 144A 2.898% 15/10/2019	USD	175,000	175,367	0.11
SBA Tower Trust, 144A 2.933% 15/12/2042	USD	150,000	152,313	0.09
SBA Tower Trust 144A 3.869% 15/10/2049	USD	150,000	151,814	0.09
Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 2010-H1 Class A1				
1.992% 25/02/2040	USD	2,938	2,919	-
Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 2013-6 Class A1 2.5%				
25/05/2043	USD	161,831	152,283	0.09
Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 2013-7 Class A2 3%				
25/06/2043	USD	85,461	82,740	0.05
Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2012-1A				
Class A 144A 2.84% 20/11/2028	USD	155,285	157,696	0.09
Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2014-1A				
Class A 144A 2.07% 20/03/2030	USD	94,757	95,307	0.06

Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2015-1A					
Class A 144A 2.4% 22/03/2032	USD	170,580	170,959	0.10	
Sirius XM Radio, Inc., 144A 5.25% 15/08/2022	USD	360,000	375,750	0.23	
SMB Private Education Loan Trust Class A2A, 144A 2.49%					
15/06/2027	USD	130,000	129,194	0.08	
South Carolina State Public Service Authority Class D					
4.77% 01/12/2045	USD	162,000	158,796	0.10	
Southern California Gas Co. 3.2% 15/06/2025	USD	335,000	331,925	0.20	
SunTrust Auto Receivables Trust, Series 2015-1A Class A4					
144A 1.78% 15/01/2021	USD	495,000	494,852	0.30	
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-2					
Class A 2.22% 15/01/2022	USD	300,000	303,600	0.18	
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-6					
Class A 1.36% 17/08/2020	USD	250,000	250,063	0.15	
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-7					
Class A 1.76% 15/09/2022	USD	315,000	311,433	0.19	
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2013-1					
Class B 1.69% 15/03/2021	USD	205,000	204,311	0.12	
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2014-1					
Class C 1.91% 15/11/2020	USD	135,000	135,623	0.08	
United Airlines, Inc., Series 2014-2 Class B 4.625%					
03/09/2022	USD	440,000	448,800	0.27	
University of North Carolina at Chapel Hill 3.847%					
01/12/2034	USD	210,000	211,814	0.13	
US Airways Pass Through Trust, Series 2013-1 Class A 3.95%					
15/05/2027	USD	117,132	117,717	0.07	
US Treasury 3% 15/05/2045	USD	160,000	156,863	0.09	
US Treasury Inflation Indexed 0.634% 15/01/2024	USD	2,715,000	2,805,861	1.68	
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/07/2024	USD	120,000	116,907	0.07	
US Treasury Inflation Indexed 0.25% 15/01/2025	USD	715,000	702,906	0.42	
Utah Transit Authority Class B 5.937% 15/06/2039	USD	65,000	81,949	0.05	
Utility Debt Securitization Authority Class T1 0%					
15/06/2021	USD	100,000	100,850	0.06	
Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust, Series 2007-C30					
Class AM 5.383% 15/12/2043	USD	315,000	331,446	0.20	
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C29					
Class A4 3.637% 15/06/2048	USD	275,000	281,876	0.17	
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-					
LC20 Class C 4.056% 15/04/2050	USD	105,000	102,121	0.06	
Wendys Funding LLC, Series 2015-1A Class A2I 144A 3.371%					
15/06/2045	USD	445,000	445,102	0.27	

WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C13 Class A4						
3.001%	15/05/2045	USD	185,000	186,167	0.11	
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2014-C24 Class A5						
3.607%	15/11/2047	USD	285,000	293,968	0.18	
Wheels SPV 2 LLC, Series 2015-1A Class A2 144A 1.27%						
22/04/2024		USD	200,000	200,281	0.12	
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2015-A Class A3						
1.34%	15/05/2020	USD	190,000	190,557	0.11	
				85,179,412	51.00	
債券 計				92,075,414	55.13	
その他の規制のある市場において取引されている有価証券 計				92,075,414	55.13	
有価証券 計				152,960,760	91.59	

TBA取引

評価損益

国	銘柄名	通貨	（米ドル）		評価額 （米ドル）	対純資産比率 （%）	
			想定元本	（米ドル）			
United States of America	FHLMC, 4%, 15/07/2045	USD	160,000	169,025	(500)	0.10	
United States of America	FNMA, 3%, 25/07/2045	USD	370,000	368,208	(2,255)	0.22	
United States of America	FNMA, 3.5%, 25/07/2045	USD	3,395,000	3,496,320	(14,158)	2.09	
United States of America	FNMA, 4%, 25/07/2045	USD	785,000	830,996	(1,121)	0.50	
United States of America	FNMA, 4.5%, 25/07/2045	USD	575,000	621,449	(994)	0.37	
United States of America	FNMA, 5%, 25/07/2045	USD	60,000	66,272	(253)	0.04	
United States of America	GNMA, 3%, 15/07/2044	USD	3,120,000	3,146,812	10,289	1.89	
United States of America	GNMA, 3.5%, 15/07/2045	USD	515,000	533,910	(196)	0.32	
TBA取引買付 計					9,232,992	(9,188)	5.53
TBA取引 計					9,232,992	(9,188)	5.53

為替予約取引

買い	金額	売り	金額	決済日	評価（損）益	
					（米ドル）	対純資産比率 （%）
EUR	23,129,723	USD	25,311,432	2015/7/31	602,047	0.36
EUR	24,585,158	USD	26,822,038	2015/8/31	734,358	0.44
EUR	24,955,625	USD	27,907,550	2015/9/30	77,063	0.05
為替予約取引に係る評価益 計					1,413,468	0.85
為替予約取引						
EUR	1,036,106	USD	1,167,555	2015/7/31	(6,750)	-
EUR	1,490,502	USD	1,679,066	2015/8/31	(8,430)	(0.01)
為替予約取引に係る評価損 計					(15,180)	(0.01)
為替予約取引に係る評価損益 計					1,398,288	0.84

取引相手方	評価(損)益
Deutsche Bank	568,255
J.P. Morgan	19,518
Morgan Stanley	733,722
Westpac Banking	76,793
	1,398,288

先物取引

国	銘柄名	契約数	通貨	グローバル	評価(損)益 (米ドル)	対純資産比率 (%)
				エクスポージャー (米ドル)		
United States of America	US 10 Year Note, 21/09/2015	(59)	USD	(7,443,219)	41,414	0.03
United States of America	US 5 Year Note, 30/09/2015	13	USD	1,550,047	109	-
United States of America	US Long Bond, 21/09/2015	(2)	USD	(301,750)	7,641	-
				先物取引に係る評価益	49,164	0.03
				先物取引に係る評価損益 計	49,164	0.03
現金					12,894,137	7.72
その他資産(負債)					1,148,727	0.69
純資産 計					167,003,624	100.00

国別投資比率	対純資産比率(%)
アメリカ	80.72
イギリス	2.30
ケイマン諸島	1.42
オランダ	1.22
オーストラリア	1.22
メキシコ	0.57
フランス	0.54
スウェーデン	0.41
香港	0.39
ルクセンブルグ	0.34
カナダ	0.31
イギリス領バージン諸島	0.30
スイス	0.26
インドネシア	0.26

日本	0.24
南アフリカ	0.20
コロンビア	0.17
ドイツ	0.14
バミューダ	0.13
トルコ	0.12
アイルランド	0.12
ジャージー	0.12
チリ	0.09
有価証券 計	91.59
現金その他資産（負債）	8.41
合計	100.00

通貨

USD :	米ドル
EUR :	ユーロ

T.ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドから提供を受けた情報をもとに作成しております。

* 対純資産比率は、USアグリゲート・ボンド・ファンドの純資産に対する比率

* 添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

財務諸表に関する注記（抜粋）

2015年6月30日現在（未監査）

重要な会計方針

a) 一般的事項

当財務諸表は、ルクセンブルグ大公国において一般に公正妥当と認められる会計基準に従って作成されている。

b) 有価証券の評価

信託財産の組入資産の評価において、上場されている有価証券は、上場している取引所における計算日の最終相場で評価されている。

未上場の有価証券、上場されているが計算日において取引所の最終相場がない有価証券、および最終相場で評価することが適当でない有価証券は、取締役会によりまたは取締役会の監督の下で合理的と認める売買価格に基づき評価される。

購入時点で、1年以内に償還を迎える短期債については、利息を考慮すると公正価値に近似するため、償却原価で評価される。しかし、償却原価が公正価値を反映していないと見なされる場合は、その有価証券は取締役会によりまたは取締役会の監督の下で合理的と認める公正価格に基づき評価される。

c) 外貨換算

各ファンドの帳簿および記録は、そのファンドの基準通貨建で行われている。基準通貨以外の通貨建の金額は、次の基準で基準通貨に換算される。

() 当初、他通貨で表示された投資評価額ならびにその他の資産および負債は、各営業日に当該各営業日の実勢為替レートをを用いて基準通貨に換算される。

() 外国有価証券の購入および売却、収益ならびに費用支出は、当該各取引日の実勢為替レートをを用いて基準通貨に換算される。

外国為替取引に係わる実現損益は、() 外貨の保有および売却に伴う為替差損益、() 証券取引に係わる約定日と決済日間に発生した損益、および() 受取配当金および受取利息に関して計上時点と実際の受取時点における差額から生じる損益を表す。各ファンドでは、当年度に保有していた有価証券の市場価格の変動により生じる損益から、当該証券に係わる外国為替レートの変動による損益を独立させて表示することを行わない。

当社の報告書の表示通貨は米ドルである。米ドル以外の基準通貨建のファンドおよび投資証券クラスに関しては、財務諸表上の項目は次の基準に基づき、米ドルに換算されている。() 資産および負債は、財務諸表日付における実勢為替レートで換算される。() 損益および純資産変動計算書の残高は、当期間中の平均為替レートで換算される。かかる換算において用いられた、1ドルの等価額として表示された為替レートは次のとおりである。

通貨	2015年6月30日 現在のレート	2015年6月30日に終了した 期間の平均レート
ユーロ	0.8929	0.8954
ノルウェー・クローネ	7.8437	NA
スウェーデン・クローナ	8.2456	NA
日本円	122.29	NA
英ポンド	0.6348	NA

d) 有価証券取引および収益について

有価証券に係わる取引は約定日基準で認識される。実現損益は、売却有価証券の平均原価に基づいて算定される。

受取配当金は、配当落ち日に計上される。受取利息および支払利息は、発生基準で認識される。債券のプレミアムまたはディスカウント部分については、定額法で損益として認識される。

現金預金は、一定の信用基準を充足する各種金融機関における翌日物から3カ月物の定期預金の現金残高を含んでいる。各ファンドの取引先金融機関が預金の払い戻しを履行できない場合には、かかる預金価額の回収の遅滞、および元利金の減価の可能性がある。手数料控除後の収益は受取利息として日次ベースで計上され、当座借越費用は、損益および純資産変動計算書の「その他費用」の項目に含まれている。

e) クラス別会計および設定費の処理

各クラスに個別に発生する費用は、関連するクラスに直接割り当てられる。すべてのクラスに共通の費用、収益ならびに実現損益および未実現損益は、計上日における各クラスの純資産額の比率に基づき按分される。

新ファンドの設定費用および新株発行費用は、当該ファンド資産に対して、公平な基準に基づき取締役会が決定した金額で各期間において繰り延べ、5年を超えない期間にわたり、償却される場合がある。

f) 担保

2015年6月30日現在、下記の通り為替取引および店頭デリバティブ取引のために、ブローカーや取引相手方から現金担保を受け入れ、または差し入れている。

ファンド名	通貨	ブローカー /取引相手方	担保の タイプ	受入担保額	差入担保額
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Bank of America	現金	2,380,000	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Citibank	現金	-	716,358
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Morgan Stanley	現金	767,889	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Goldman Sachs	現金	3,160,000	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	The Royal Bank of Scotland	現金	-	5,970,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Deutsche Bank	現金	1,200,000	-
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Goldman Sachs	現金	-	100,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	JP Morgan	現金	160,000	-
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Morgan Stanley	現金	720,208	-

3. 投資に係わる取引

a) デリバティブ

各ファンドは、為替予約取引、金融先物、オプションおよびスワップに係わる契約を締結することがある。かかる契約は、オプションの買いの場合を除き、貸借対照表に表示された金額を超える市場リスクを持つ。表示された契約額は、契約の対象となる資産に投資している該当ファンドの契約額である。為替予約取引および先物取引は、それぞれ実勢先物為替レートおよび最新の決済価格を用いて日々評価される。オプション契約およびスワップ契約は、独立したプライシング・サービスを利用して日々評価される。契約額の変動は、契約の終了または期日まで、未実現損益として日々計上される。スワップ契約に伴って必要とされる定期的な差額の支払いまたは受取りは、スワップ取引に係る受取利息または支払利息として日々計上される。

かかる契約に関連する市場リスクは、為替レート、金利、信用力、指数、およびかかる商品の原資産となる証券価額の変動の可能性により生じる。その他の市場リスクおよび信用リスクには、当該契約に対して流動性のある市場が存在しない可能性、契約の価額の変動とヘッジされている通貨、指数、証券の価格変動が直接的に連動しない可能性、または当該契約の相手方が契約条件に基づく義務を履行できない可能性が含まれている。各ファンドの各クラスに係わる全ての未決済契約が、各ファンドの有価証券明細書に反映されている。

ファンドは先物取引の証拠金としてまた将来の各種の証拠金取引に備えてブローカーの口座に現金を預けることがある。ブローカーに預けられた預金は、貸借対照表の委託証拠金に含まれる。

b) 中国A株

2015年6月30日現在、アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンドとグローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンドは、中国外の投資家には保有が制限されている中国株式(A株)に投資した。当ファンドは、T・ロウ・プライスが投資会社として関与している全ファンド(各関係ファンド)のために登録済み適格外国機関投資家(QFII)として機能するT・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクを通じてA株市場に投資できる。QFIIを通じてのA株に対する投資判断は、各関係ファンドに固有のものであり、また各ファンドはA株に対する所有や取引の結果として生じる経済的效果を負担する。当ファンドが、QFIIを通じて保有するA株に関する投資活動から得られる現金を環流するには、中国政府から一定の制限と事務手続きが課せられている。したがって、政府の要件を順守しなかった場合、当ファンドは自らの資産の確保が大幅に遅れ、あるいは損失を計上する場合がある。2014年11月、中国の税務当局は、QFIIが計上した実現利益に対するキャピタル・ゲイン課税の遡及的および将来に向かっての適用に関する指針を発行した。このガイドラインでとりわけ明確になったのは、租税条約に基づき非課税とならない限り、2014年11月17日に「一時的免税」が有効になる前に売却された有価証券に対しては、中国の税務当局は徴税する、という点である。租税条約上の権利が適用されるかどうかは現時点では不明確なため、2014年11月17日以前に獲得された実現利益に発生した未払税金を添付の財務諸表で認識している。

本ファンドは、中国本土及び香港市場において相互に証券市場への参加を認めるように計画された相互共同証券取引及び決済プログラムである上海・香港相互株式交換制度(株式コネクト)を通じて、上海上場証券(株式コネクト証券)に投資する場合がある。

c) TBA 購入確約

特定のファンドでは、To Be Announced(以下「TBA」)取引を行う場合がある。これは、決められた単価で、モーゲージ担保証券を購入することに合意するもので、その支払いや引渡しは、かかるモーゲージ担保証券の通常の決済期間を超えた将来の日に予定されている。TBA取引では、取引日時点において具体的な引渡し証券が特定されていない。しかし、引き渡される有価証券は、発行体、利率やローン期間などの点で指定条件を充足している必要があり、かつ、業界内の「適法受け渡し」の基準に合致するものでなければなら

い。ファンドがTBA取引を実行する場合は一般的に、原モーゲージ証券を所有する目的をもって行われる。ファンドは決済日までTBAの決済に充てる十分な現金準備金と流動資産を確保している。

d) ポートフォリオ回転率

「CSSF」が定める方法に従って算出された、2015年6月30日に終了した期間におけるポートフォリオの回転率は以下のとおりである。

ファンド名	ポートフォリオ回転率
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	102.91
USアグリゲート・ボンド・ファンド	491.52
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド*	48.31
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	36.26
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	72.61
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	17.09

* 当ファンドの旧称は、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド。

4. 配当金

当社は、配当型投資証券に係わる純利益については、実質的にその全額に相当する配当金を公表し支払う意向である。かかる投資証券に関する配当金は、通常、年一回支払われ、当該クラスの基準通貨で公表される。これらの配当金は権利落日に計上される。該当する任意のファンドの配当型投資証券に係わる中間配当に関しては、取締役会が決議した頻度および間隔で、帰属する純利益および実現キャピタル・ゲインから支払われる場合がある。

2015年6月30日に終了した期間に支払われた配当金は下表のとおりである。

ファンド名	クラス	通貨	一口当たり 配当金	権利落日
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.058292	2015年 1月21日
	Jd	米ドル	0.053571	2015年 2月20日
	Jd	米ドル	0.068137	2015年 3月24日
	Jd	米ドル	0.048432	2015年 4月21日
	Jd	米ドル	0.051500	2015年 5月21日
	Jd	米ドル	0.053398	2015年 6月22日
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.027390	2015年 1月21日
	Jd	米ドル	0.023129	2015年 2月20日
	Jd	米ドル	0.025128	2015年 3月24日
	Jd	米ドル	0.020191	2015年 4月21日
	Jd	米ドル	0.022972	2015年 5月21日
	Jd	米ドル	0.023341	2015年 6月22日
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド*	Jd	米ドル	0.019569	2015年 2月20日
	Jd	米ドル	0.031739	2015年5月21日

* 当ファンドの旧称は、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド。

5. カストディーフィー

ファンドは、年間のカストディーフィーを負担する。当該費用は、カストディーに保管された資産価値に応じて0.025%から0.01%まで逡減する。この費用は日々計算されて積み上げられ、月次で支払われる。

6. 管理会社報酬

損益および純資産変動計算書における管理会社報酬は、名義書換代理人報酬および管理費用等を含む。

ファンドは、年間の管理費用を負担する。当該費用は、ファンドの純資産額に応じて0.07%から0.01%まで逡減する。しかしながら、サブファンドは年間最低40,000米ドルの管理費用を負担する。この費用は日々計算されて積み上げられ、月次で支払われる。

7. 課税

現行の法規および慣行では、当社はルクセンブルグの法人税が課されていない。また、当社より支払われる配当金は、ルクセンブルグ国内での源泉税の対象となっていない。さらに、当社資産に係わる実現または未実現の評価益に対しても、ルクセンブルグの税金は課されていない。

a) 年次税

2014年12月31日に終了した年度において、当社には関係するルクセンブルグ法に基づき年次税(「Taxe d'Abonnement」)が課せられている。クラスA及びクラスQ投資証券(アドバイザーズクラス)については年率0.05%、クラスI、J、SおよびZ投資証券(インスティテューショナルクラス)については年率0.01%の年次

税がそれぞれ課せられた。なお、年次税は、各四半期末における各クラスの純資産額に基づき四半期毎課税される。

b) 外国税引当金

各ファンドは、投資先となる一部の国により課される外国法人税の課税対象となっている。外国法人税は収益の減少として計上される。投資先の国で発行された有価証券の処分によって実現したキャピタル・ゲインは、当該国のキャピタル・ゲイン税の課税対象となっている。税額はすべて、適用される外国税法に従って計算され、キャピタル・ロス、許容される最大範囲まで、キャピタル・ゲインを相殺するために使用される。保有期間に応じて税率が変わる場合、その範囲内において、各ファンドについて、適用最低税率を用いた繰延税金負債を計上している。

純キャピタル・ゲインに課される当期の税金費用および繰延税金費用は、それぞれ実現損益、未実現損益の一部としての適格払戻金を控除した額をもとにして計上されている。2015年6月30日に終了した期間においては、損益および純資産変動計算書に表示されている通り、アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド、グローバル・フォーカス・グロース・エクイティ・ファンドおよびグローバル・グロース・エクイティ・ファンドの実現損益および未実現損益について、インドのキャピタル・ゲインに起因する税額は控除されていない。

2015年6月30日現在、インドの有価証券に係る未実現利益へのキャピタル・ゲイン税に関する繰延税金負債を有するファンドはない。また、将来のインドの有価証券の実現損益に係るキャピタル・ゲイン税と相殺するためにキャピタル・ロスを繰り越しているファンドは次の通りである。

アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	14,262,339米ドル
グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	4,753,431米ドル
グローバル・フォーカス・グロース・エクイティ・ファンド	23,070,928米ドル
グローバル・グロース・エクイティ・ファンド	495,038米ドル

繰り越しされたキャピタル・ロスは、当初発生した時から8年間、実現益と相殺することが認められている。

8. 関連当事者との取引

a) 事務管理会社報酬

ファンドは、T.ロウ・プライス(ルクセンブルグ)・マネジメント S.a.r.l.(以下「運用会社」)により運用されている。運用会社は運用者に対して運用報酬から支払いを行う。運用報酬は日次ベースで算定され、月次ベースで支払われる。その額は、下表の年間料率に従って各ファンドの日次純資産額に基づいて計算される。

ファンド名	クラスA 証券*	クラスI 証券**	クラスQ 証券***
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	1.15%	0.60%	0.60%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	0.90%	0.40%	0.40%
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド****	1.90%	1.00%	1.00%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%	0.65%
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%	0.65%
USラージキャップ・バリュース・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%	0.65%

* Ad, Adh(米ドル)、Ah(ユーロ)、Ah(ノルウェー・クローネ)およびAh(スウェーデン・クローナ)投資証券を含む。

** Id, Ih(ユーロ)、Ih(米ドル)およびI(英ポンド)投資証券を含む。

***Q(ユーロ)およびQ(英ポンド)投資証券を含む

**** 当ファンドの旧称は、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド。

クラスS、クラスJ及びクラスZ投資証券には運用報酬はない。

b) 運用報酬等の権利放棄

運用報酬等の権利放棄は契約で定められた条項ではなく、今後も継続することが保証されたものではないが、2015年6月30日に終了した期間において、以下の上限経費率が一定のクラスに適用された。

ファンド名	クラス	総経費率*	上限経費率
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	Jd	0.05	-
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	0.08	-
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド**	Jd	0.14	-
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	J	0.08	-
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	J	0.06	-
USラージキャップ・バリュース・エクイティ・ファンド	J	0.06	-

* 総経費率は、2015年6月30日に終了した期間に、各クラスが負担した支払報酬および費用から権利放棄された費用を控除した額の当該クラスの平均純資産に対する比率を表す。

** 当ファンドの旧称は、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド。

c) 株主等による保有比率

運用会社またはその関係会社は、新ファンドの設立のための当初資金を提供する(「直接投資」)目的で、ファンドが十分な純資産を有するまで投資を継続することがある。さらに、運用会社またはその関係会社が管理するその他のファンドまたは口座の資金が、当ファンドに投資されることがある(「関係会社勘定」)。しかし、いかなる関係会社も、当ファンドまたは当社に対する運営権または支配権を行使する目的で投資を行うことは認められない。2015年6月30日現在、運用会社またはその関係会社により保有されるファンド(対純資産の比率)は下表のとおりである。

ファンド名	比率
関係会社による保有比率	
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	3%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	36%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	8%
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	3%
USラージキャップ・バリュアブル・エクイティ・ファンド	8%

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成27年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

資産総額	13,728,538,327	円
負債総額	29,969,333	円
純資産総額(-)	13,698,568,994	円
発行済数量	14,882,594,903	口
1単位当り純資産額(/)	0.9204	円

(参考)日本好配当株マザーファンド

資産総額	26,112,466,040	円
負債総額	155,546,608	円
純資産総額(-)	25,956,919,432	円
発行済数量	17,745,079,748	口
1単位当り純資産額(/)	1.4628	円

(参考)世界REITマザーファンド

資産総額	2,129,572,944	円
負債総額	0	円
純資産総額(-)	2,129,572,944	円
発行済数量	1,859,107,127	口
1単位当り純資産額(/)	1.1455	円

(参考)グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	92,984,420,762	円
負債総額	2,004,977,086	円
純資産総額(-)	90,979,443,676	円
発行済数量	50,646,987,291	口
1単位当り純資産額(/)	1.7963	円

(参考)新興国債券マザーファンド

資産総額	12,671,710,150	円
負債総額	23,454,663	円
純資産総額(-)	12,648,255,487	円
発行済数量	6,062,561,149	口
1単位当り純資産額(/)	2.0863	円

(参考)欧州債券マザーファンド

資産総額	1,356,248,729	円
負債総額	10,659,856	円
純資産総額(-)	1,345,588,873	円
発行済数量	1,015,818,098	口
1単位当り純資産額(/)	1.3246	円

(参考)アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	1,302,459,901	円
負債総額	0	円
純資産総額(-)	1,302,459,901	円
発行済数量	946,421,994	口
1単位当り純資産額(/)	1.3762	円

(参考)コモディティ・マザーファンド

資産総額	658,316,908	円
負債総額	0	円
純資産総額(-)	658,316,908	円
発行済数量	1,157,528,386	口
1単位当り純資産額(/)	0.5687	円

[前へ](#)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

1 委託会社等の概況

(1) 資本金の額

資本金の額：20億円（平成27年10月末現在）

会社が発行する株式総数：12,800,000株

発行済株式総数：3,850,000株

最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社は、8名以内で構成される取締役により運営されます。取締役は、株主総会の決議によって選任されます。取締役の選任は、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上を有する株主が出席し、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上をもってこれを行います。

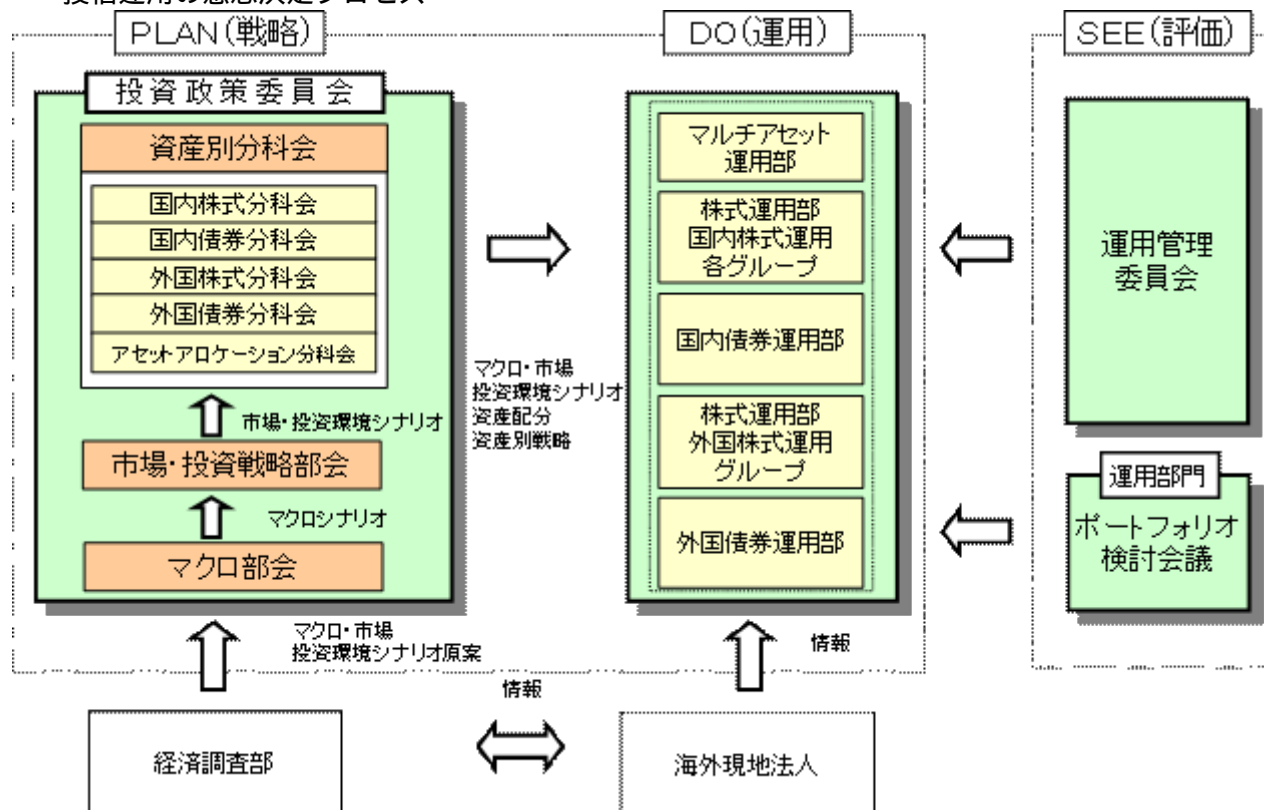
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、取締役会の決議によって取締役の中から取締役社長、取締役副社長各1名、専務取締役および常務取締役若干名を選定することができます。また代表取締役は2名とし、取締役社長および取締役副社長がこれに就任します。ただし、取締役副社長を置かない場合、専務取締役から代表取締役1名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、代表取締役が招集し、招集通知は3日前までにこれを発します。ただし、緊急の必要があるときは、この期間を短縮することができます。

取締役会は、法令または定款に定める事項の他、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の6名以上が出席し、その出席取締役の過半数をもって行います。

< 投信運用の意思決定プロセス >



2 事業の内容及び営業の概況

委託会社は、株式会社住友銀行（現株式会社三井住友フィナンシャルグループ）および大和証券株式会社（現株式会社大和証券グループ本社）の戦略的提携により平成11年4月1日付で、大和投資顧問株式会

社と住銀投資顧問株式会社およびエス・ビー・アイ・エム投信株式会社の三社が合併して設立された会社です。

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

平成27年10月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、309本であり、その純資産総額は、約3,550,699百万円です（なお、親投資信託112本は、ファンド数及び純資産総額からは除いております。）。

種類	ファンド数	純資産総額
単位型株式投資信託	27	189,314百万円
追加型株式投資信託	260	3,216,499百万円
単位型公社債投資信託	22	144,885百万円
合計	309	3,550,699百万円

[次へ](#)

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

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

(1) 受託会社

名称	資本金の額（百万円） 平成27年3月末現在	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考：再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）の概要>

- ・資本金：51,000百万円（平成27年3月末現在）
- ・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に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成27年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。

以上

3 委託会社等の経理状況

- 1 . 委託会社の財務諸表は、「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8月6日内閣府令第52号。）により作成しております。
- 2 . 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- 3 . 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第43期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

(単位:千円)

		第42期 (平成26年3月31日)	第43期 (平成27年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		17,588,077	19,107,074
前払費用		149,868	198,366
未収委託者報酬		2,410,896	3,278,499
未収運用受託報酬		895,204	1,001,357
未収収益		15,769	15,862
繰延税金資産		490,240	559,646
その他		13,019	7,378
流動資産計		21,563,076	24,168,184
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	162,431	135,473
器具備品	1	68,912	48,230
土地		710	710
リース資産	1	9,490	6,166
有形固定資産計		241,544	190,580
無形固定資産			
ソフトウェア		173,597	105,376
ソフトウェア仮勘定		3,150	-
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		189,454	118,082
投資その他の資産			
投資有価証券		5,381,370	5,298,347
関係会社株式		1,169,774	1,169,774
従業員長期貸付金		2,299	3,738
長期差入保証金		511,366	510,636
出資金		132,660	82,660
繰延税金資産		611,818	561,097
その他		2,209	2,190
貸倒引当金		70,650	20,750
投資その他の資産計		7,740,848	7,607,693
固定資産計		8,171,846	7,916,356
資産合計		29,734,923	32,084,541

(単位：千円)

	第42期 (平成26年3月31日)	第43期 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,558	3,042
未払金	39,085	53,907
未払手数料	1,109,332	1,519,563
未払費用	1,020,908	1,178,272
未払法人税等	1,316,049	1,515,891
未払消費税等	118,950	620,431
賞与引当金	955,000	1,220,900
役員賞与引当金	80,000	87,600
その他	21,473	29,244
流動負債計	4,664,357	6,228,853
固定負債		
リース債務	6,569	3,527
退職給付引当金	1,391,001	1,459,244
役員退職慰労引当金	116,430	148,160
固定負債計	1,514,000	1,610,931
負債合計	6,178,358	7,839,785

(単位：千円)

	第42期 (平成26年3月31日)	第43期 (平成27年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		

別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	19,953,563	20,569,363
利益剰余金合計	21,397,294	22,013,094
株主資本合計	23,553,563	24,169,363
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,001	75,392
評価・換算差額等合計	3,001	75,392
純資産合計	23,556,565	24,244,756
負債純資産合計	29,734,923	32,084,541

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第42期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	3,557,574	3,613,731
委託者報酬	27,766,163	30,077,141
その他営業収益	69,161	54,133
営業収益計	31,392,899	33,745,007
営業費用		
支払手数料	13,355,205	14,599,540
広告宣伝費	204,927	172,450
公告費	269	-
調査費		
調査費	1,191,119	1,225,517
委託調査費	3,772,225	3,858,570
委託計算費	145,854	166,866
営業雑経費		
通信費	35,588	35,132
印刷費	495,807	465,810
協会費	26,478	23,810
諸会費	2,206	2,207
その他	34,597	48,630
営業費用計	19,264,279	20,598,538
一般管理費		
給料		
役員報酬	201,630	201,630
給料・手当	2,983,202	2,893,443

賞与	92,691	99,464
退職金	5,583	4,787
福利厚生費	614,668	644,228
交際費	19,862	17,830
旅費交通費	167,353	149,324
租税公課	74,265	91,224
不動産賃借料	618,978	627,983
退職給付費用	222,235	225,474
固定資産減価償却費	77,093	58,879
賞与引当金繰入額	939,093	1,174,402
役員退職慰労引当金繰入額	38,530	38,530
役員賞与引当金繰入額	87,400	86,300
諸経費	290,905	250,480
一般管理費計	6,433,492	6,563,983
営業利益	5,695,126	6,582,484
営業外収益		
受取配当金	34,957	18,215
受取利息	3,291	3,072
投資有価証券売却益	68,331	71,459
為替差益	1,706	397
その他	11,918	12,418
営業外収益計	120,205	105,563
営業外費用		
投資有価証券売却損	23,470	764
営業外費用計	23,470	764
経常利益	5,791,861	6,687,284
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	-	400
特別利益計	-	400
特別損失		
固定資産除却損	1,884	95
割増退職金	-	7,785
特別損失計	1,884	7,881
税引前当期純利益	5,789,977	6,679,803
法人税、住民税及び事業税	2,321,531	2,602,339
法人税等調整額	49,846	53,385
法人税等合計	2,271,684	2,548,953
当期純利益	3,518,293	4,130,849

(3) 株主資本等変動計算書

第42期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期末首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	19,981,120
当期変動額						
剰余金の配当						3,545,850
当期純利益						3,518,293
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計						27,556
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	19,953,563

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期末首残高	21,424,851	23,581,120	59,183	59,183	23,640,304
当期変動額					
剰余金の配当	3,545,850	3,545,850			3,545,850
当期純利益	3,518,293	3,518,293			3,518,293
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			56,182	56,182	56,182
当期変動額合計	27,556	27,556	56,182	56,182	83,739
当期末残高	21,397,294	23,553,563	3,001	3,001	23,556,565

第43期（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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期末首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	19,953,563
当期変動額						
剰余金の配当						3,515,050
当期純利益						4,130,849
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計						615,799
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	20,569,363

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
利益剰余金 合計					
当期末首残高	21,397,294	23,553,563	3,001	3,001	23,556,565
当期変動額					
剰余金の配当	3,515,050	3,515,050			3,515,050
当期純利益	4,130,849	4,130,849			4,130,849
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)			72,391	72,391	72,391
当期変動額合計	615,799	615,799	72,391	72,391	688,190
当期末残高	22,013,094	24,169,363	75,392	75,392	24,244,756

[前へ](#) [次へ](#)

注記事項

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。）を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 15～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、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> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p>
<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> <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。</p>

表示方法の変更

（貸借対照表関係）

前事業年度において、「流動負債」の「未払金」に含めていた「未払消費税等」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払金」に表示していた158,035千円は、「未払金」39,085千円、「未払消費税等」118,950千円として組み替えております。

（貸借対照表関係）

第42期 (平成26年3月31日)		第43期 (平成27年3月31日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	389,326千円	建物	416,284千円
器具備品	282,257千円	器具備品	241,990千円
リース資産	10,890千円	リース資産	10,452千円
2.保証債務		2.保証債務	
被保証者	従業員	被保証者	従業員
被保証債務の内容	住宅ローン	被保証債務の内容	住宅ローン
金額	11,273千円	金額	7,139千円

（株主資本等変動計算書関係）

第42期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	3,545,850	921	平成25年3月31日	平成25年6月25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	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月24日 定時株主総会	普通 株式	3,515,050	利益 剰余金	913	平成26年3月31日	平成26年6月25日

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

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24日 定時株主総会	普通株式	3,515,050	913	平成26年3月31日	平成26年6月25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	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月24日 定時株主総会	普通 株式	2,063,600	利益 剰余金	536	平成27年3月31日	平成27年6月25日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(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、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

また、デリバティブ取引についても行っておりません。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（注2）を参照ください）。

第42期(平成26年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	17,588,077	17,588,077	-
(2) 未収委託者報酬	2,410,896	2,410,896	-
(3) 未収運用受託報酬	895,204	895,204	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,330,234	5,330,234	-
資産計	26,224,413	26,224,413	-
(1) 未払手数料	1,109,332	1,109,332	-
(2) 未払費用(*1)	752,915	752,915	-
負債計	1,862,248	1,862,248	-

(*1) 金融商品に該当するものを表示しております。

第43期(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	19,107,074	19,107,074	-
(2) 未収委託者報酬	3,278,499	3,278,499	-
(3) 未収運用受託報酬	1,001,357	1,001,357	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,247,212	5,247,212	-
資産計	28,634,143	28,634,143	-
(1) 未払手数料	1,519,563	1,519,563	-
(2) 未払費用(*1)	926,569	926,569	-
負債計	2,446,132	2,446,132	-

(*1) 金融商品に該当するものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(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

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 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の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	第42期(平成26年3月31日)	第43期(平成27年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	1,169,774	1,169,774
(3) 長期差入保証金	511,366	510,636

これらについては、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時価開示の対象としておりません。このため、(1) その他有価証券の非上場株式については

2. (4) 投資有価証券には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第42期（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	17,588,077	-	-	-
未収委託者報酬	2,410,896	-	-	-
未収運用受託報酬	895,204	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	1,141,800	1,960,844	1,113,993	-
合計	22,035,978	1,960,844	1,113,993	-

第43期（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	19,107,074	-	-	-
未収委託者報酬	3,278,499	-	-	-
未収運用受託報酬	1,001,357	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期のあるもの	428,800	2,113,200	149,744	-
合計	23,815,730	2,113,200	149,744	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第42期（平成26年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 1,169,774千円）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、記載しておりません。

第43期（平成27年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 1,169,774千円）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、記載しておりません。

2. その他有価証券

第42期（平成26年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	3,171,477	3,105,800	65,677
小計	3,171,477	3,105,800	65,677
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	2,158,757	2,219,774	61,017
小計	2,158,757	2,219,774	61,017
合計	5,330,234	5,325,574	4,660

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第43期（平成27年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	3,086,552	2,925,460	161,092
小計	3,086,552	2,925,460	161,092
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	2,160,660	2,210,000	49,340
小計	2,160,660	2,210,000	49,340
合計	5,247,212	5,135,460	111,752

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第42期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	2,506,861	68,331	23,470

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	2,494,198	71,459	764

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	第42期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）	第43期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	1,268,146	1,391,001
退職給付費用	162,502	162,604
退職給付の支払額	76,988	122,316
その他	37,340	27,955
退職給付引当金の期末残高	1,391,001	1,459,244

（注）その他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

（2）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	第42期 (平成26年3月31日)	第43期 (平成27年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,391,001	1,459,244
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,391,001	1,459,244
退職給付引当金	1,391,001	1,459,244
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,391,001	1,459,244

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第42期 162,502千円 第43期 162,604千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第42期は59,733千円、第43期は62,870千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	第42期 (平成26年3月31日)	第43期 (平成27年3月31日)
(1) 流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	89,569	107,110
賞与引当金	339,980	404,117
社会保険料	33,038	33,528
未払事業所税	4,961	4,550
その他	22,690	19,871
繰延税金資産合計	490,240	569,179
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	9,532
繰延税金負債合計	-	9,532
繰延税金資産の純額	490,240	559,646
(2) 固定資産		
繰延税金資産		
退職給付引当金	495,196	471,999
投資有価証券	2,469	2,243
ゴルフ会員権	32,333	11,618
役員退職慰労引当金	41,449	48,561
その他	76,831	67,362
繰延税金資産小計	648,280	601,785
評価性引当額	34,803	13,861
繰延税金資産合計	613,477	587,924
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	1,659	26,826
繰延税金負債合計	1,659	26,826

繰延税金資産の純額	611,818	561,097
-----------	---------	---------

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差異の原因となった主な項目別の内訳

	第42期 (平成26年3月31日)	第43期 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.56%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.02%
住民税均等割等	-	0.06%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	1.22%
過年度法人税等	-	0.20%
特定外国子会社等留保課税	-	0.46%
その他	-	0.08%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	38.16%

(注) 前事業年度は、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。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

「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定実効税率が引き下げられることとなりました。

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33.10%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32.34%となります。

その結果、繰延税金資産の金額が97,507千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が100,931千円、その他有価証券評価差額金が3,424千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」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42期(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	27,766,163	3,557,574	69,161	31,392,899

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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

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

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	30,077,141	3,613,731	54,133	33,745,007

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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

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

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

第42期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事 者 との関係	取引の内 容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証 券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	5,613,672	未払 手数料 料	488,758

その他の関係会社の子会社	株式会社 三井住友銀行	東京都 千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,142,899	未払手数料	277,360
--------------	----------------	-------------	--------	-----	---	-------------------	---------------------	-----------	-------	---------

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	5,383,745	未払手数料	555,261
その他の関係会社の子会社	株式会社 三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	2,695,822	未払手数料	344,291

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

（1株当たり情報）

	第42期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	6,118円59銭	6,297円34銭
1株当たり当期純利益金額	913円84銭	1,072円95銭

(注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第42期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(千円)	3,518,293	4,130,849
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	3,518,293	4,130,849
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

4 利害関係人との取引制限

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

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)および(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)および(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 その他

- (1) 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項
当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

- (2) 訴訟事件その他重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えると予想される訴訟事件等は発生していません。

委託会社の営業年度は、毎年4月1日より翌年3月31日までとし、営業年度末に決算を行います。

[前へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成27年11月6日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル資産分散オープンの平成27年3月28日から平成27年9月28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、グローバル資産分散オープンの平成27年9月28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

大和住銀投信投資顧問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、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月12日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩 司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳 樹 印

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」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第43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、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態並びに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、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。