

【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28年12月27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 後藤 正明
【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】	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28年6月28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>

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成28年4月末現在）

(以下略)

<訂正後>

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成28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>

(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28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。

各投資信託証券の運用会社（運用再委託先を含む）の概要

(以下略)

シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシー

(CBRE Clarion Securities, LLC 所在地：米国ペンシルバニア州ラドノー)

(以下略)

1 . T.Rowe Price Funds SICAV – U.S. Aggregate Bond Fund

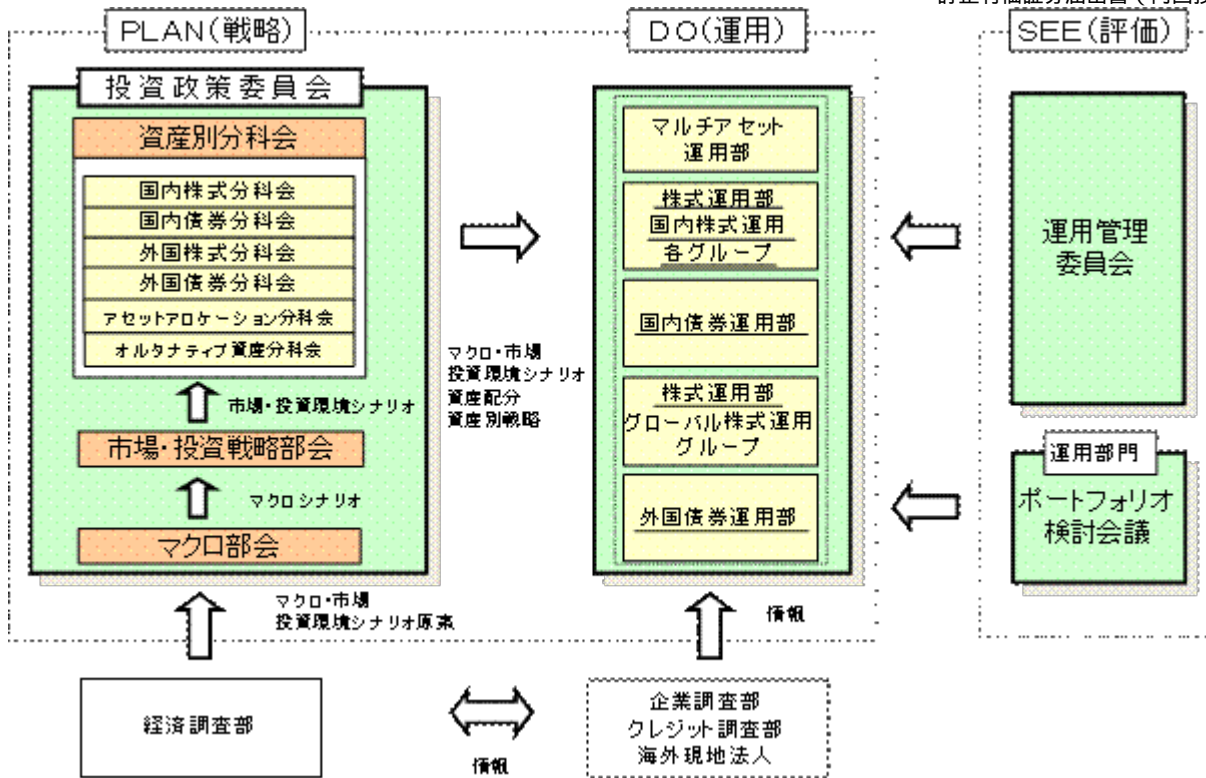
<指定投資信託証券の概要>

(以下略)

ベンチマーク	バークレイズ米国総合インデックス
	(以下略)
ベンチマークについて	バークレイズ米国総合インデックスは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーの投資銀行部門であるバークレイズが開発、算出、公表を行うインデックスであり、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はバークレイズに帰属します。

(以下略)

(3) 運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成28年4月末現在で約100名です。
(以下略)

<訂正後>

(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28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。

各投資信託証券の運用会社(運用再委託先を含む)の概要

(以下略)

シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシー
(CBRE Clarion Securities LLC 所在地: 米国ペンシルバニア州ラドノー)

(以下略)

1. T.Rowe Price Funds SICAV – U.S. Aggregate Bond Fund

<指定投資信託証券の概要>

(以下略)

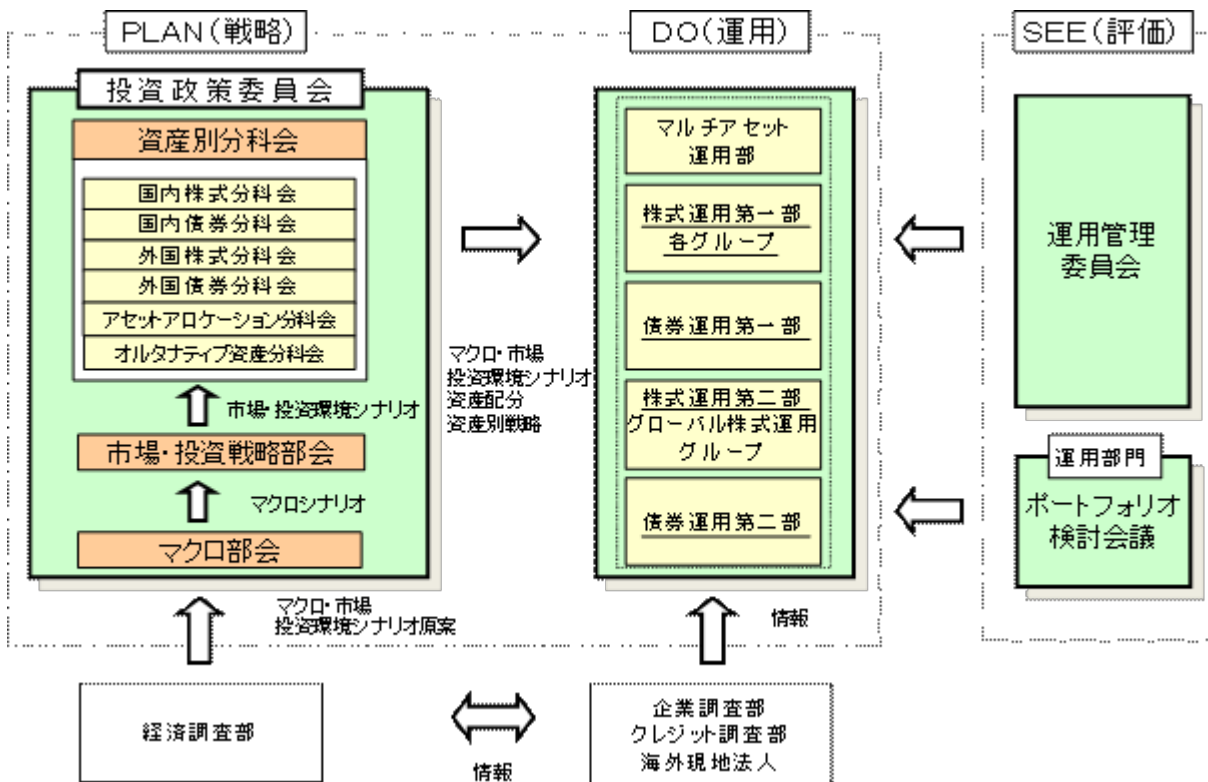
ベンチマーク	ブルームバーグ・バークレイズ米国総合インデックス
--------	--------------------------

(以下略)

ベンチマークについて	ブルームバーグ・バークレイズ米国総合インデックスとは、ブルームバーグが公表しているインデックスであり、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスを表します。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。
------------	---

(以下略)

(3)運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成28年11月1日現在で約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

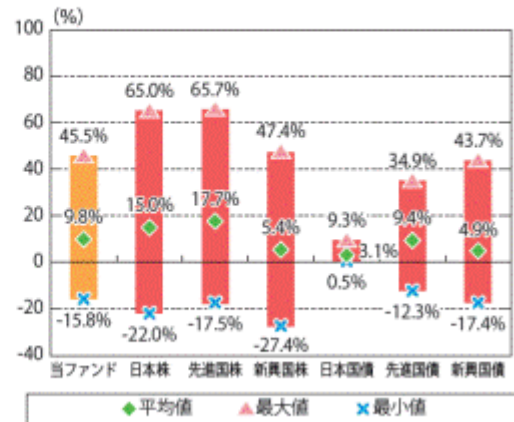
(2011年11月～2016年10月)



※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のと計算しているため、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

(2011年11月～2016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のと計算しているため、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)

* 上記の内容は平成28年4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)

< 訂正後 >

(5)課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は平成28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28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 （グローバル好配当株マザーファンド）	日本	1,610,070,060	14.77%
親投資信託受益証券 （世界REITマザーファンド）	日本	1,557,782,535	14.29%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	1,134,988,533	10.41%
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	1,090,631,905	10.00%
親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド）	日本	1,084,518,285	9.95%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	1,028,173,309	9.43%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	571,020,016	5.24%
投資証券	ルクセンブルグ	2,671,031,164	24.50%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		153,997,506	1.41%
純資産総額		10,902,213,313	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28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	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 -	1,030,444,839	1.5149 1,561,123,931	1.5625 1,610,070,060	- -	14.77%
2	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	1,615,286,744	1.0078 1,628,047,509	0.9644 1,557,782,535	- -	14.29%
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 -	839,737,003	1.2810 1,075,787,074	1.3516 1,134,988,533	- -	10.41%
4	T.Rowe Price Funds SICAV- Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,069,589	1,019 1,090,203,926	1,023 1,094,654,067	- -	10.04%
5	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 -	855,464,668	1.2369 1,058,209,794	1.2749 1,090,631,905	- -	10.00%
6	新興国債券マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	534,456,084	1.9521 1,043,365,167	2.0292 1,084,518,285	- -	9.95%
7	T.Rowe Price Funds SICAV- U.S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	922,978	1,169 1,079,124,635	1,156 1,067,522,644	- -	9.79%
8	欧州債券マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	872,516,386	1.1872 1,035,938,705	1.1784 1,028,173,309	- -	9.43%
9	コモディティ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	1,157,551,219	0.4638 536,988,010	0.4933 571,020,016	- -	5.24%
10	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	644,449	792 510,881,761	789 508,854,452	- -	4.67%

（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	74.09%
投資証券	24.50%
合計	98.59%

（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28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28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
第16特定期間末 （平成27年3月27日）	15,877	16,036	0.9468	0.9558
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10月末日	13,698	-	0.9204	-
平成27年11月末日	13,457	-	0.9156	-
平成27年12月末日	13,015	-	0.8995	-
平成28年1月末日	12,494	-	0.8658	-
平成28年2月末日	11,697	-	0.8179	-
第18特定期間末 （平成28年3月28日）	12,093	12,223	0.8482	0.8572
平成28年3月末日	12,163	-	0.8526	-
平成28年4月末日	11,840	-	0.8420	-
平成28年5月末日	11,851	-	0.8445	-
平成28年6月末日	10,950	-	0.7877	-
平成28年7月末日	11,237	-	0.8135	-
平成28年8月末日	11,125	-	0.8097	-
第19特定期間末 （平成28年9月27日）	10,719	10,843	0.7888	0.7978
平成28年9月末日	10,792	-	0.7937	-
平成28年10月末日	10,902	-	0.8064	-

（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
第18特定期間（平成27年9月29日～平成28年3月28日）	0.0090
第19特定期間（平成28年3月29日～平成28年9月27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%
第18特定期間（平成27年9月29日～平成28年3月28日）	3.6%
第19特定期間（平成28年3月29日～平成28年9月27日）	5.9%

（注）収益率 = （当特定期末分配基準価額 - 前特定期末分配基準価額） ÷ 前特定期末分配基準価額 × 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
第18特定期間（平成27年9月29日～平成28年3月28日）	48,077,011	846,917,471
第19特定期間（平成28年3月29日～平成28年9月27日）	45,281,793	712,778,081

（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28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	20,176,843,380	94.15%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,252,833,172	5.85%
純資産総額		21,429,676,552	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28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	1,074,150,000	5.01%

(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28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	1,651,200	523.00 863,577,600	544.60 899,243,520	-	4.20%
2	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	159,900	4,622.00 739,057,800	4,660.00 745,134,000	-	3.48%
3	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	109,900	6,015.00 661,048,500	6,079.00 668,082,100	-	3.12%
4	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	195,400	3,060.00 597,924,000	3,144.00 614,337,600	-	2.87%
5	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	63,800	9,144.00 583,387,200	9,488.00 605,334,400	-	2.82%
6	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	142,000	4,103.00 582,626,000	4,149.00 589,158,000	-	2.75%
7	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	131,000	3,913.00 512,603,000	4,094.00 536,314,000	-	2.50%
8	アズビル 日本	株式 電気機器	153,000	3,080.00 471,240,000	3,120.00 477,360,000	-	2.23%
9	オリックス 日本	株式 その他金融業	271,600	1,455.50 395,313,800	1,665.50 452,349,800	-	2.11%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	109,800	4,185.00 459,513,000	3,994.00 438,541,200	-	2.05%
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	186,000	2,355.50 438,123,000	2,291.00 426,126,000	-	1.99%
12	三井物産 日本	株式 卸売業	250,400	1,407.00 352,312,800	1,458.00 365,083,200	-	1.70%
13	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	137,900	2,513.00 346,542,700	2,640.50 364,124,950	-	1.70%
14	東燃ゼネラル石油 日本	株式 石油・石炭製品	318,000	1,045.00 332,310,000	1,036.00 329,448,000	-	1.54%
15	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	70,300	4,626.00 325,207,800	4,597.00 323,169,100	-	1.51%
16	パナソニック 日本	株式 電気機器	290,000	1,052.50 305,225,000	1,097.00 318,130,000	-	1.48%
17	センコー 日本	株式 陸運業	408,000	701.00 286,008,000	726.00 296,208,000	-	1.38%
18	東ソー 日本	株式 化学	427,000	662.00 282,674,000	687.00 293,349,000	-	1.37%
19	西日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	42,700	6,297.00 268,881,900	6,472.00 276,354,400	-	1.29%
20	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	2,918.00 252,698,800	3,122.00 270,365,200	-	1.26%
21	アイシン精機 日本	株式 輸送用機器	56,800	4,785.00 271,788,000	4,615.00 262,132,000	-	1.22%
22	小松製作所 日本	株式 機械	109,200	2,379.50 259,841,400	2,343.00 255,855,600	-	1.19%
23	三菱ケミカルホールディングス 日本	株式 化学	364,000	654.20 238,128,800	691.00 251,524,000	-	1.17%
24	大和ハウス工業 日本	株式 建設業	85,900	2,671.50 229,481,850	2,886.00 247,907,400	-	1.16%
25	奥村組 日本	株式	390,000	569.00	606.00	-	1.10%

	日本	建設業		221,910,000	236,340,000	-	
26	マブチモーター 日本	株式 電気機器	37,000	5,920.00 219,040,000	6,110.00 226,070,000	-	1.05%
27	帝人 日本	株式 繊維製品	110,000	1,936.00 212,960,000	2,033.00 223,630,000	-	1.04%
28	旭硝子 日本	株式 ガラス・土石製 品	302,000	665.00 200,830,000	735.00 221,970,000	-	1.04%
29	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	461,000	432.70 199,474,700	466.00 214,826,000	-	1.00%
30	ディスコ 日本	株式 機械	16,500	12,390.00 204,435,000	12,700.00 209,550,000	-	0.98%

（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。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
株式	94.15%
合計	94.15%

（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）	
輸送用機器	13.27%
電気機器	9.94%
卸売業	7.72%
銀行業	7.58%
情報・通信業	6.70%
化学	5.91%
機械	5.19%
建設業	4.74%
保険業	4.54%
非鉄金属	3.79%
食料品	2.99%
陸運業	2.75%
ガラス・土石製品	2.65%
その他金融業	2.35%
医薬品	2.21%
石油・石炭製品	2.20%
小売業	1.62%
繊維製品	1.61%
不動産業	1.49%
証券、商品先物取引業	0.95%
電気・ガス業	0.84%
金属製品	0.84%
精密機器	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.42%
鉄鋼	0.41%
その他製品	0.41%
水産・農林業	0.32%
空運業	0.17%
小計	94.15%
合計	94.15%

（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28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28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 2812月	買建	77	1,042,195,000	1,074,150,000	5.01%

（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28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	496,888,787	31.90%
	日本	236,071,800	15.15%
	オーストラリア	212,898,320	13.67%
	フランス	189,803,387	12.18%
	イギリス	189,266,332	12.15%
	オランダ	71,165,614	4.57%
	シンガポール	58,116,996	3.73%
	カナダ	49,553,730	3.18%
	ドイツ	30,451,111	1.95%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		23,515,139	1.51%
純資産総額		1,557,731,216	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28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	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券 -	3,377	27,364 92,410,397	25,040 84,562,215	- -	5.43%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	4,052	21,122 85,590,389	19,176 77,704,380	- -	4.99%
3	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	12,196	7,601 92,705,471	6,310 76,962,550	- -	4.94%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券 -	9,431	7,021 66,219,064	7,177 67,692,577	- -	4.35%
5	SEGR0 PLC イギリス	投資証券 -	111,546	547 61,062,532	559 62,434,142	- -	4.01%
6	TRITAX BIG BOX REIT PLC イギリス	投資証券 -	358,365	176 63,226,135	173 62,175,639	- -	3.99%
7	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券 -	88	684,000 60,192,000	623,000 54,824,000	- -	3.52%
8	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券 -	69,182	716 49,585,063	709 49,054,742	- -	3.15%
9	VEREIT INC アメリカ	投資証券 -	50,500	989 49,958,145	965 48,770,910	- -	3.13%
10	EUROCOMMERCIAL オランダ	投資証券 -	10,661	4,636 49,425,439	4,457 47,516,471	- -	3.05%
11	GECINA SA フランス	投資証券 -	3,112	16,060 49,981,399	15,111 47,027,976	- -	3.02%
12	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資証券 -	61,792	802 49,573,694	700 43,278,622	- -	2.78%
13	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券 -	4,433	9,957 44,141,871	9,564 42,398,455	- -	2.72%
14	ICADE フランス	投資証券 -	5,481	7,624 41,789,136	7,535 41,303,582	- -	2.65%
15	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券 -	233	182,600 42,545,800	176,900 41,217,700	- -	2.65%
16	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 -	58,900	628 37,034,022	696 41,018,696	- -	2.63%
17	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券 -	118,059	344 40,686,047	331 39,088,673	- -	2.51%
18	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D アメリカ	投資証券 -	13,825	2,478 34,270,659	2,645 36,575,666	- -	2.35%
19	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券 -	60	680,000 40,800,000	607,000 36,420,000	- -	2.34%
20	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券 -	2,900	12,989 37,668,123	12,472 36,168,940	- -	2.32%
21	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券 -	60	643,000 38,580,000	590,000 35,400,000	- -	2.27%
22	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券 -	8,500	3,385 28,780,399	4,101 34,859,134	- -	2.24%
23	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	87,836	393 34,534,884	366 32,157,989	- -	2.06%
24	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券 -	22,817	1,427 32,579,433	1,334 30,451,111	- -	1.95%

25	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 -	431,500 27,616,000	475,500 30,432,000	- -	1.95% -
26	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	83,917 -	335 28,118,396	347 29,120,239	- -	1.87% -
27	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	173,046 -	150 25,961,598	163 28,234,098	- -	1.81% -
28	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT シンガポール	投資証券 -	143,605 -	181 26,041,504	179 25,739,444	- -	1.65% -
29	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券 -	107 -	271,000 28,997,000	237,900 25,455,300	- -	1.63% -
30	GENERAL GROWTH PROPERTIES アメリカ	投資証券 -	9,500 -	2,983 28,345,883	2,579 24,505,782	- -	1.57% -

(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	98.49%
合計	98.49%

(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28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28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28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	21,780,051,883	31.91%
	イギリス	6,947,919,762	10.18%
	日本	5,449,860,750	7.99%
	スイス	4,431,481,910	6.49%
	ケイマン諸島	4,008,059,432	5.87%
	オーストラリア	3,234,429,410	4.74%
	オランダ	3,142,183,784	4.60%
	香港	3,133,092,352	4.59%
	フランス	2,327,012,206	3.41%
	台湾	1,934,373,349	2.83%
	イタリア	1,490,538,455	2.18%
	韓国	1,479,792,900	2.17%
	フィンランド	1,378,185,986	2.02%
	シンガポール	1,134,121,761	1.66%
	中国	951,553,283	1.39%
	パナマ	775,990,529	1.14%
	オランダ領アンチル	765,795,935	1.12%
	ノルウェー	762,828,771	1.12%
	ドイツ	734,092,286	1.08%
パミュューダ	718,361,134	1.05%	
カナダ	644,697,881	0.94%	
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,023,491,871	1.50%
純資産総額		68,247,915,630	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28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	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	株式	3,915,000	204	306	-	1.76%

	ケイマン諸島	耐久消費財・アパレル		799,255,080	1,198,882,620	-	
2	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	254,500	4,835.00 1,230,507,500	4,597.00 1,169,936,500	-	1.71%
3	N T T ドコモ 日本	株式 情報・通信業	409,300	2,795.00 1,143,993,500	2,640.50 1,080,756,650	-	1.58%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE 台湾	株式 半導体・半導体 製造装置	1,702,131	544 926,801,818	627 1,067,653,159	-	1.56%
5	SANDS CHINA LTD ケイマン諸島	株式 消費者サービス	2,320,000	341 792,001,600	459 1,066,457,600	-	1.56%
6	アズビル 日本	株式 電気機器	331,800	2,982.00 989,427,600	3,120.00 1,035,216,000	-	1.52%
7	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	163,400	5,387 880,351,291	6,277 1,025,820,003	-	1.50%
8	ING GROEP NV オランダ	株式 銀行	734,710	992 729,479,966	1,388 1,020,257,612	-	1.49%
9	NEXTERA ENERGY INC アメリカ	株式 公益事業	76,250	13,456 1,026,072,139	13,184 1,005,283,644	-	1.47%
10	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	83,480	10,060 839,831,206	11,924 995,472,219	-	1.46%
11	NORTHROP GRUMMAN CORP アメリカ	株式 資本財	41,210	23,121 952,842,372	23,947 986,894,063	-	1.45%
12	NATIONAL GRID PLC イギリス	株式 公益事業	721,100	1,407 1,015,126,798	1,352 975,632,724	-	1.43%
13	CONOCOPHILLIPS アメリカ	株式 エネルギー	205,070	4,352 892,616,104	4,715 967,018,699	-	1.42%
14	TOTAL SA フランス	株式 エネルギー	188,230	4,837 910,628,976	5,108 961,520,250	-	1.41%
15	PETROCHINA CO LTD-H 中国	株式 エネルギー	13,082,000	71 930,329,046	72 951,553,283	-	1.39%
16	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST 香港	株式 不動産	2,870,000	338 970,060,000	325 935,137,840	-	1.37%
17	AMERICAN WATER WORKS CO INC アメリカ	株式 公益事業	122,900	8,659 1,064,232,738	7,605 934,715,433	-	1.37%
18	MERCK & CO INC 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	145,900	6,163 899,279,569	6,169 900,197,514	-	1.32%
19	AMCOR LTD オーストラリア	株式 素材	770,320	1,193 919,646,532	1,165 898,188,112	-	1.32%
20	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 資本財	698,500	1,126 787,134,062	1,285 898,097,772	-	1.32%
21	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバ コ	148,100	6,320 936,129,140	6,014 890,718,126	-	1.31%
22	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD 香港	株式 銀行	2,376,000	314 746,871,840	371 883,396,800	-	1.29%
23	ANALOG DEVICES アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	132,030	5,866 774,609,051	6,661 879,551,618	-	1.29%
24	ALTRIA GROUP INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	127,180	7,266 924,191,369	6,908 878,581,925	-	1.29%
25	DELTA ELECTRONICS INC 台湾	株式 テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	1,554,000	526 817,854,660	557 866,720,190	-	1.27%
26	TELSTRA CORP オーストラリア	株式 電気通信サービ ス	2,181,790	444 968,959,556	393 859,560,897	-	1.26%
27	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービ ス	224,200	4,435 994,456,587	3,828 858,335,934	-	1.26%
28	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	65,720	13,753 903,875,919	12,958 851,639,113	-	1.25%
29	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	株式	7,600,000	60	111	-	1.24%

	ケイマン諸島	自動車・自動車 部品		456,218,880	844,621,440	-	
30	RAYTHEON COMPANY アメリカ	株式 資本財	58,000	14,359 832,852,647	14,385 834,373,117	-	1.22%

（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	98.50%
合計	98.50%

（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）	
医薬品	1.71%
情報・通信業	1.58%
電気機器	1.52%
空運業	1.11%
輸送用機器	1.08%
建設業	0.98%
小計	7.99%
（海外）	
銀行	8.43%
食品・飲料・タバコ	7.75%
エネルギー	7.55%
公益事業	7.39%
電気通信サービス	6.72%
消費者サービス	5.81%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.49%
資本財	5.49%
半導体・半導体製造装置	4.77%
各種金融	3.94%
保険	3.27%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.73%
素材	2.54%
自動車・自動車部品	2.22%
不動産	2.19%
ヘルスケア機器・サービス	2.09%
食品・生活必需品小売り	2.09%
家庭用品・パーソナル用品	1.90%
耐久消費財・アパレル	1.76%
運輸	1.60%
ソフトウェア・サービス	1.50%
小売	1.25%
商業・専門サービス	1.13%
メディア	0.90%
小計	90.51%
合計	98.50%

（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28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28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28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	ブラジル	413,080,634	5.63%
	アルゼンチン	402,632,260	5.49%
	セルビア	397,917,432	5.42%
	ウクライナ	370,967,940	5.05%
	ジャマイカ	334,444,467	4.56%
	スリランカ	244,050,272	3.32%
	クロアチア	241,656,413	3.29%
	ドミニカ共和国	234,711,650	3.20%
	パキスタン	154,799,601	2.11%
	トルコ	150,556,231	2.05%
	ザンビア	137,891,319	1.88%
	コートジボアール	132,662,274	1.81%
	コロンビア	121,821,105	1.66%
	オマーン	121,342,681	1.65%
	エルサルバドル	120,347,822	1.64%
	インドネシア	109,483,843	1.49%
	レバノン	102,087,658	1.39%
	ロシア	90,368,348	1.23%
	ケニア	73,616,333	1.00%
	南アフリカ	71,058,639	0.97%
	ベトナム	55,643,959	0.76%
	ガボン	38,915,643	0.53%
	モロッコ	30,797,093	0.42%
	トリニダード トバゴ	21,601,160	0.29%
	メキシコ	21,401,926	0.29%
	アンゴラ	20,667,906	0.28%
ガーナ	20,132,490	0.27%	
特殊債券	メキシコ	283,956,164	3.87%
	南アフリカ	177,583,083	2.42%
	ロシア	89,325,856	1.22%
	アイルランド	22,511,554	0.31%
社債券	メキシコ	383,989,298	5.23%
	オランダ	325,262,061	4.43%
	カザフスタン	229,816,890	3.13%
	インド	167,674,338	2.28%
	インドネシア	150,856,996	2.06%
	ルクセンブルグ	146,580,962	2.00%
	トルコ	109,026,769	1.49%
	ブラジル	84,186,641	1.15%
	ケイマン諸島	83,284,216	1.13%
	イギリス領バージン諸島	75,588,750	1.03%
	トリニダード トバゴ	69,987,758	0.95%
	アルゼンチン	66,763,051	0.91%
	シンガポール	43,969,475	0.60%
	アラブ首長国連邦	34,793,827	0.47%
	スリランカ	22,721,064	0.31%
	フィリピン	21,803,120	0.30%
	イギリス	21,784,665	0.30%
	アメリカ	21,758,450	0.30%
コロンビア	21,706,020	0.30%	
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		450,983,948	6.14%
純資産総額		7,340,572,055	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28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	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	3,125,000	9,807.03 306,469,734	10,368.03 324,001,015	4.2500 2025/01/07	4.41%
2	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	2,500,000	11,908.11 297,702,783	12,068.65 301,716,299	7.2500 2021/09/28	4.11%
3	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	1,754,000	10,302.49 180,705,762	10,250.06 179,786,140	6.5000 2041/06/02	2.45%
4	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	1,500,000	10,322.02 154,830,377	10,384.28 155,764,287	7.7500 2020/09/01	2.12%

5	PERTAMINA PERSERO PT インドネシア	社債券 -	1,425,000	10,118.42 144,187,533	10,586.45 150,856,996	5.6250 2043/05/20	2.06%
6	ESKOM HOLDINGS SOC LTD 南アフリカ	特殊債券 -	1,350,000	10,040.92 135,552,522	10,766.50 145,347,756	7.1250 2025/02/11	1.98%
7	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	1,400,000	9,965.44 139,516,230	10,331.85 144,645,981	7.7500 2021/09/01	1.97%
8	REPUBLIC OF SRI LANKA スリランカ	国債証券 -	1,250,000	10,104.51 126,306,491	10,716.58 133,957,339	5.8750 2022/07/25	1.82%
9	PETROBRAS GLOBAL FINANCE オランダ	社債券 -	1,150,000	11,050.49 127,080,672	11,560.81 132,949,372	8.3750 2021/05/23	1.81%
10	IVORY COAST コートジボアール	国債証券 -	1,249,000	9,660.22 120,656,241	10,621.47 132,662,274	5.3750 2024/07/23	1.81%
11	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	1,100,000	11,142.80 122,570,854	11,335.36 124,689,026	6.8750 2021/04/22	1.70%
12	JAMAICA GOVERNMENT BOND ジャマイカ	国債証券 -	1,047,618	11,133.19 116,633,435	11,065.03 115,919,389	8.5000 2021/11/16	1.58%
13	ISLAMIC REP OF PAKISTAN パキスタン	国債証券 -	975,000	10,965.10 106,909,777	11,141.06 108,625,339	6.7500 2019/12/03	1.48%
14	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証券 -	955,000	10,459.78 99,890,946	10,826.79 103,395,892	5.5000 2025/01/27	1.41%
15	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	845,000	11,446.62 96,723,959	12,156.83 102,725,291	8.7500 2024/05/07	1.40%
16	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	885,000	11,068.80 97,958,901	11,482.17 101,617,204	7.5000 2026/04/22	1.38%
17	CROATIA クロアチア	国債証券 -	865,000	11,520.12 99,649,118	11,663.15 100,886,319	6.6250 2020/07/14	1.37%
18	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証券 -	950,000	10,502.00 99,769,047	10,551.53 100,239,606	4.7500 2026/06/15	1.37%
19	REPUBLIC OF ZAMBIA ザンビア	国債証券 -	1,050,000	7,859.74 82,527,336	9,184.05 96,432,611	5.3750 2022/09/20	1.31%
20	HAZINE MUSTESARLIGI VARL トルコ	国債証券 -	925,000	10,440.17 96,571,629	10,361.11 95,840,283	4.4890 2024/11/25	1.31%
21	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券 -	800,000	11,416.63 91,333,060	11,296.04 90,368,348	4.8750 2023/09/16	1.23%
22	CROATIA クロアチア	国債証券 -	700,000	11,475.35 80,327,478	11,849.18 82,944,260	6.0000 2024/01/26	1.13%
23	KAZMUNAIGAZ NATIONAL カザフスタン	社債券 -	700,000	11,294.92 79,064,440	11,659.27 81,614,949	7.0000 2020/05/05	1.11%
24	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO カザフスタン	社債券 -	750,000	9,149.87 68,624,054	10,557.82 79,183,718	5.7500 2043/04/30	1.08%
25	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	650,000	11,220.02 72,930,130	12,111.33 78,723,645	6.1250 2041/01/18	1.07%
26	EXPORT-IMPORT BK INDIA インド	社債券 -	700,000	10,937.94 76,565,626	11,037.24 77,260,743	4.0000 2023/01/14	1.05%
27	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	841,000	9,112.33 76,634,728	9,065.14 76,237,886	5.5000 2044/06/27	1.04%
28	REPUBLIC OF KENYA ケニア	国債証券 -	700,000	9,786.05 68,502,416	10,516.61 73,616,333	6.8750 2024/06/24	1.00%
29	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	623,906	10,957.75 68,366,201	11,796.75 73,600,738	8.2800 2033/12/31	1.00%
30	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証券 -	660,000	10,459.78 69,034,581	11,036.51 72,840,999	6.8500 2045/01/27	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。

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	57.69%
社債券	28.36%
特殊債券	7.81%
合計	93.86%

(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28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28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28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	150,253,269	14.61%
	イギリス	91,356,277	8.89%
	フランス	78,666,253	7.65%
	スペイン	45,441,258	4.42%
	ドイツ	37,989,073	3.69%
	スロヴェニア	33,530,635	3.26%
	セルビア	28,918,866	2.81%
	ベルギー	28,379,910	2.76%
	ルーマニア	21,044,570	2.05%
	キプロス	21,036,777	2.05%
	インドネシア	18,277,280	1.78%
	アイルランド	17,084,890	1.66%
	デンマーク	14,935,113	1.45%
	ロシア	14,655,011	1.43%
	イスラエル	13,327,622	1.30%
	メキシコ	13,245,936	1.29%
	アルバニア	12,679,430	1.23%
	ブルガリア	12,065,638	1.17%
	ハンガリー	10,797,917	1.05%
	ポーランド	8,582,508	0.83%
	ノルウェー	6,992,930	0.68%
	スウェーデン	5,127,015	0.50%
オーストリア	3,216,332	0.31%	
モンテネグロ	2,785,360	0.27%	
特殊債券	スペイン	25,748,750	2.50%
	国際機関	5,558,814	0.54%
社債券	オーストリア	51,714,975	5.03%
	フランス	44,229,815	4.30%
	ルクセンブルグ	37,522,982	3.65%
	アイスランド	28,084,165	2.73%
	スウェーデン	21,808,087	2.12%
	韓国	19,613,355	1.91%
	オランダ	12,035,380	1.17%
	チェコ	11,536,408	1.12%
	メキシコ	11,326,166	1.10%
	ドイツ	10,858,285	1.06%
	イギリス	6,892,818	0.67%
	デンマーク	6,792,443	0.66%
	アイルランド	6,718,229	0.65%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		37,341,030	3.63%
純資産総額		1,028,171,572	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28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	HETA ASSET RESOLUTION AG オーストリア	社債券 -	400,000	12,540.56 50,162,260	12,928.74 51,714,975	2.3750 2022/12/13	5.03%
2	UK GILT イギリス	国債証券 -	246,000	18,539.43 45,607,013	19,738.92 48,557,743	4.2500 2046/12/07	4.72%
3	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	219,000	16,237.86 35,560,920	16,482.86 36,097,481	5.9000 2026/07/30	3.51%
4	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	263,000	12,254.02 32,228,082	11,990.97 31,536,254	2.0000 2025/12/01	3.07%
5	UK GILT イギリス	国債証券 -	158,000	18,484.95 29,206,229	19,544.08 30,879,655	4.7500 2038/12/07	3.00%
6	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	250,000	11,763.82 29,409,552	11,604.74 29,011,870	0.5000 2026/05/25	2.82%
7	ISLANDSBANKI アイスランド	社債券 -	240,000	11,574.37 27,778,500	11,701.73 28,084,165	1.7500 2020/09/07	2.73%

8	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	157,000	16,674.90 26,179,601	16,873.80 26,491,878	3.2500 2045/05/25	2.58%
9	DEXIA CREDIT LOCAL フランス	社債券 -	200,000	12,885.23 25,770,469	12,889.45 25,778,901	1.8750 2017/07/17	2.51%
10	INSTITUT CREDITO OFICIAL スペイン	特殊債券 -	200,000	12,837.96 25,675,927	12,874.37 25,748,750	1.8750 2017/12/15	2.50%
11	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	173,000	14,896.60 25,771,129	14,584.65 25,231,459	5.5000 2022/09/01	2.45%
12	REPUBLIKA SLOVENIJA スロヴェニア	国債証券 -	143,000	15,527.26 22,203,986	16,062.24 22,969,011	5.1250 2026/03/30	2.23%
13	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	134,000	17,085.84 22,895,032	16,181.55 21,683,280	4.7500 2044/09/01	2.11%
14	BUNDESobligation ドイツ	国債証券 -	175,000	11,823.34 20,690,850	11,733.71 20,534,008	0.0000 2021/10/08	2.00%
15	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	175,000	11,725.55 20,519,713	11,668.25 20,419,447	0.7000 2020/05/01	1.99%
16	EXPORT-IMPORT BK KOREA 韓国	社債券 -	160,000	12,156.29 19,450,076	12,258.34 19,613,355	2.0000 2020/04/30	1.91%
17	SERBIA TREASURY BONDS セルビア	国債証券 -	18,000,000	105.37 18,967,336	105.80 19,044,360	10.0000 2019/08/21	1.85%
18	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	149,000	11,822.76 17,615,924	12,266.63 18,277,280	2.8750 2021/07/08	1.78%
19	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	123,000	13,333.14 16,399,767	13,024.00 16,019,526	4.2500 2020/03/01	1.56%
20	REPUBLIC OF CYPRUS キプロス	国債証券 -	130,000	11,739.48 15,261,324	12,032.15 15,641,806	3.8750 2022/05/06	1.52%
21	RUSSIA GOVT BOND - OFZ ロシア	国債証券 -	9,200,000	159.19 14,645,848	159.29 14,655,011	7.5000 2021/08/18	1.43%
22	IRISH GOVT TREASURY アイルランド	国債証券 -	90,000	16,155.78 14,540,203	16,129.43 14,516,491	5.4000 2025/03/13	1.41%
23	ROMANIA GOVERNMENT BOND ルーマニア	国債証券 -	460,000	3,019.27 13,888,647	3,023.73 13,909,191	5.8500 2023/04/26	1.35%
24	STATE OF ISRAEL イスラエル	国債証券 -	100,000	13,120.18 13,120,186	13,327.62 13,327,622	2.8750 2024/01/29	1.30%
25	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券 -	100,000	12,386.39 12,386,398	13,245.93 13,245,936	3.6250 2029/04/09	1.29%
26	ALTICE FINCO SA ルクセンブルグ	社債券 -	100,000	12,922.99 12,922,991	13,066.80 13,066,803	9.0000 2023/06/15	1.27%
27	REPUBLIC OF ALBANIA アルバニア	国債証券 -	100,000	12,094.63 12,094,631	12,679.43 12,679,430	5.7500 2020/11/12	1.23%
28	LOXAM SAS フランス	社債券 -	100,000	12,027.78 12,027,787	12,520.20 12,520,201	7.0000 2022/07/23	1.22%
29	LSF9 BALTA ISSUER SA ルクセンブルグ	社債券 -	100,000	12,154.80 12,154,802	12,443.46 12,443,462	7.7500 2022/09/15	1.21%
30	SKANDINAVISKA ENSKILDA スウェーデン	社債券 -	1,000,000	1,208.17 12,081,709	1,224.76 12,247,669	1.5000 2020/06/17	1.19%

（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	67.15%
社債券	26.18%
特殊債券	3.04%
合計	96.37%

（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28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28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28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	92,250,940	8.46%
	マレーシア	75,966,626	6.97%
	香港	57,857,488	5.30%
	シンガポール	54,757,147	5.02%
特殊債券	国際機関	476,167,874	43.66%
	ドイツ	186,596,015	17.11%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		147,070,866	13.48%
純資産総額		1,090,666,956	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28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	8,138.95 325,558,119	8,161.55 326,462,262	3.5000 2018/07/25	29.93%
2	LANDWIRTSCH. RENTENBANK ドイツ	特殊債券 -	2,400,000	7,765.17 186,364,094	7,774.83 186,596,015	4.0000 2020/01/30	17.11%
3	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	900,000,000	10.34 93,092,557	10.25 92,250,940	4.2500 2021/06/10	8.46%
4	EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	1,000,000	8,082.18 80,821,897	7,904.57 79,045,781	7.5000 2017/12/15	7.25%
5	MALAYSIA GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	3,000,000	2,547.57 76,427,148	2,532.22 75,966,626	3.8000 2023/08/17	6.97%
6	NORDIC INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	900,000	7,921.58 71,294,244	7,851.09 70,659,831	4.8750 2019/01/22	6.48%
7	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	4,000,000	1,439.01 57,560,588	1,446.43 57,857,488	2.4400 2020/12/07	5.30%
8	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	700,000	7,858.59 55,010,189	7,822.44 54,757,147	2.5000 2019/06/01	5.02%

(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	60.77%
国債証券	25.75%
合計	86.52%

(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28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28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28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	558,037,236	97.73%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,982,860	2.27%
純資産総額		571,020,096	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28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	9,297.16 520,641,224	9,964.95 558,037,236	0.8500 2017/10/20	97.73%

(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	97.73%
合計	97.73%

（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28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

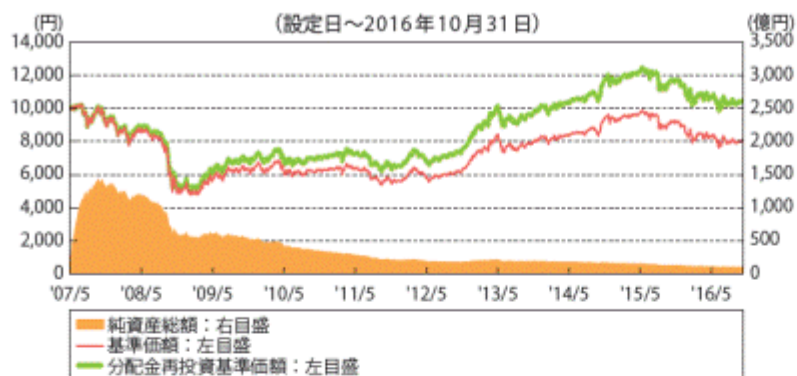
（平成28年10月末現在）

該当事項はありません。

（参考情報）

2016年10月31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

2016年9月	30円
2016年7月	30円
2016年5月	30円
2016年3月	30円
2016年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	1,850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
グローバル好配当株マザーファンド	14.8%
世界REITマザーファンド	14.3%
日本好配当株マザーファンド	10.4%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	10.0%
アジア・オセアニア債券マザーファンド	10.0%
新興国債券マザーファンド	9.9%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	9.8%
欧州債券マザーファンド	9.4%
コモディティ・マザーファンド	5.2%
T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	4.7%

* 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、2016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28年3月29日から平成28年9月27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28年3月28日現在 金額（円）	当期 平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,876,312	1,659,305
金銭信託	230,337,932	-
コール・ローン	34,028,354	147,871,554
投資証券	2,998,997,242	2,633,550,903
親投資信託受益証券	8,910,129,810	7,939,460,190
派生商品評価勘定	-	559,277
未収入金	-	79,448,643
流動資産合計	12,175,369,650	10,802,549,872
資産合計	12,175,369,650	10,802,549,872
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	42,771,812	40,769,323
未払解約金	7,455,110	12,738,472
未払受託者報酬	860,709	806,327
未払委託者報酬	30,125,276	28,222,111
その他未払費用	489,492	462,065
流動負債合計	81,702,399	82,998,298
負債合計	81,702,399	82,998,298
純資産の部		
元本等		
元本	14,257,270,857	13,589,774,569
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,163,603,606	2,870,222,995
（分配準備積立金）	620,848,154	591,863,615
元本等合計	12,093,667,251	10,719,551,574
純資産合計	12,093,667,251	10,719,551,574
負債純資産合計	12,175,369,650	10,802,549,872

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成27年9月29日 至 平成28年3月28日 金額（円）	当期 自 平成28年3月29日 至 平成28年9月27日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	64,427,557	56,710,328
受取利息	42,912	613
有価証券売買等損益	236,103,355	329,285,362

為替差損益	180,740,080	343,760,812
営業収益合計	352,372,966	616,335,233
営業費用		
支払利息	-	56,234
受託者報酬	2,747,648	2,455,639
委託者報酬	96,169,153	85,949,269
その他費用	706,020	668,108
営業費用合計	99,622,821	89,129,250
営業利益又は営業損失()	451,995,787	705,464,483
経常利益又は経常損失()	451,995,787	705,464,483
当期純利益又は当期純損失()	451,995,787	705,464,483
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()	1,864,311	11,556,942
期首剰余金又は期首欠損金()	1,669,477,300	2,163,603,606
剰余金増加額又は欠損金減少額	92,032,237	119,431,327
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	92,032,237	119,431,327
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,768,069	7,761,492
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,768,069	7,761,492
分配金	130,258,998	124,381,683
期末剰余金又は期末欠損金()	2,163,603,606	2,870,222,995

[次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 平成28年 3月29日	至 平成28年 9月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準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 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落日において、確定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	(1)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。 (2)当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年3月29日から平成28年9月27日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期		当期	
	平成28年 3月28日現在		平成28年 9月27日現在	
1. 元本状況				
期首元本額		15,056,111,317円		14,257,270,857円
期中追加設定元本額		48,077,011円		45,281,793円
期中一部解約元本額		846,917,471円		712,778,081円
2. 受益権の総数		14,257,270,857口		13,589,774,569口
3. 元本の欠損		2,163,603,606円		2,870,222,995円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期		当期	
	自 平成27年 9月29日	至 平成28年 3月28日	自 平成28年 3月29日	至 平成28年 9月27日
1. 親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額		8,464,702円		7,548,918円
2. 分配金の計算過程 第51期計算期間末（平成27年11月27日）に、投資信託約款に基づき計算した746,600,319円（1万口当たり506.48円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い144,222,799円（1万口当たり30円）を分配しております。				第54期計算期間末（平成28年5月27日）に、投資信託約款に基づき計算した735,571,036円（1万口当たり524.30円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い142,088,959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）		67,024,640円		59,881,318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		0円
収益調整金		66,567,048円		65,408,270円
分配準備積立金		613,008,631円		610,281,448円
分配可能額		746,600,319円		735,571,036円
（1万口当たり分配可能額）		(506.48円)		(524.30円)
収益分配金		44,222,799円		42,088,959円
（1万口当たり収益分配金）		(30円)		(30円)

第52期計算期間末（平成28年1月27日）に、投資信託約款に基づき計算した720,224,763円（1万口当たり499.41円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い43,264,387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）	33,059,135円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	65,856,424円
分配準備積立金	621,309,204円
分配可能額	720,224,763円
（1万口当たり分配可能額）	(499.41円)
収益分配金	43,264,387円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第53期計算期間末（平成28年3月28日）に、投資信託約款に基づき計算した729,401,584円（1万口当たり511.60円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い42,771,812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）	60,140,494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	65,781,618円
分配準備積立金	603,479,472円
分配可能額	729,401,584円
（1万口当たり分配可能額）	(511.60円)
収益分配金	42,771,812円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第55期計算期間末（平成28年7月27日）に、投資信託約款に基づき計算した717,355,190円（1万口当たり518.28円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い41,523,401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）	33,184,392円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	65,171,108円
分配準備積立金	618,999,690円
分配可能額	717,355,190円
（1万口当たり分配可能額）	(518.28円)
収益分配金	41,523,401円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第56期計算期間末（平成28年9月27日）に、投資信託約款に基づき計算した697,305,022円（1万口当たり513.11円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い40,769,323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）	33,742,077円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	64,672,084円
分配準備積立金	598,890,861円
分配可能額	697,305,022円
（1万口当たり分配可能額）	(513.11円)
収益分配金	40,769,323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28年3月29日 至 平成28年9月27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。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	当期
	平成28年9月27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)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

前期（平成28年3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	75,365,292
投資証券	141,910,737
合計	217,276,029

当期（平成28年9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	230,476,476
投資証券	30,897,752
合計	199,578,724

（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

前期（平成28年3月28日現在）

該当事項はありません。

（通貨関連）

区分	種類	当期 平成28年9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	80,000,000	-	79,440,723	559,277
	合計	-	-	79,440,723	559,277

（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。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成28年3月29日 至 平成28年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成28年3月28日現在	当期 平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.8482円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,482円）」	1口当たり純資産額 0.7888円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,888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	839,737,003	1,075,787,074	
	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	1,615,286,744	1,628,047,509	
	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	1,030,444,839	1,561,123,931	

	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	534,456,084	1,043,365,167	
	親投資信託 受益証券	欧州債券マザーファンド	872,516,386	1,035,938,705	
	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	855,464,668	1,058,209,794	
	親投資信託 受益証券	コモディティ・マザーファンド	1,157,551,219	536,988,010	
	小計(日本) 7 銘柄		6,905,456,943	7,939,460,190	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	746,169.650	5,641,042.550	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	1,063,844.970	10,340,573.100	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	921,066.240	10,269,888.570	
	小計(アメリカ・ドル) 3 銘柄		2,731,080.860	26,251,504.220 (2,633,550,903)	
合計				10,573,011,093 (2,633,550,903)	

- (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	24.56%	24.91%

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](#)

<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28年3月28日現在 金額（円）	平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,063,759,694	-
コール・ローン	157,151,675	1,166,832,200
株式	21,138,339,840	19,405,821,890
派生商品評価勘定	16,074,077	4,454,684
未収入金	14,745,060	174,737,351
未収配当金	25,085,950	5,828,200
前払金	-	6,930,000
差入委託証拠金	51,600,000	46,200,000
流動資産合計	22,466,756,296	20,810,804,325
資産合計	22,466,756,296	20,810,804,325
負債の部		
流動負債		
前受金	4,640,000	-
未払金	-	144,979,345
未払解約金	11,278,419	16,511,000
流動負債合計	15,918,419	161,490,345
負債合計	15,918,419	161,490,345
純資産の部		
元本等		
元本	17,053,651,284	16,119,012,756
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,397,186,593	4,530,301,224
元本等合計	22,450,837,877	20,649,313,980
純資産合計	22,450,837,877	20,649,313,980
負債純資産合計	22,466,756,296	20,810,804,325

[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28年 3月29日 至 平成28年 9月27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28年 3月28日現在	平成28年 9月27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	17,932,438,573円	17,053,651,284円
期中追加設定元本額	239,354,068円	101,566,455円
期中一部解約元本額	1,118,141,357円	1,036,204,983円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	16,149,893,794円	15,279,275,753円
グローバル資産分散オープン	903,757,490円	839,737,003円
合計	17,053,651,284円	16,119,012,756円
2. 受益権の総数	17,053,651,284口	16,119,012,756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28年 3月29日 至 平成28年 9月27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28年 9月27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28年3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	1,030,277,101
合計	1,030,277,101

「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10月9日から平成28年3月28日まで)を指しております。

(平成28年9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	1,011,388,520
合計	1,011,388,520

「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28年4月9日から平成28年9月27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28年3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	1,075,525,923	-	1,091,600,000	16,074,077
	合計	-	-	1,091,600,000	16,074,077

区分	種類	平成28年9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	1,026,960,316	-	1,031,415,000	4,454,684
	合計	-	-	1,031,415,000	4,454,684

(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28年3月29日 至 平成28年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成28年3月28日現在	平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.3165円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,165円)」	1口当たり純資産額 1.2811円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,811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	1,844.00	62,696,000	
	西松建設	267,000	477.00	127,359,000	
	奥村組	390,000	581.00	226,590,000	
	大東建託	8,100	16,745.00	135,634,500	
	日成ビルド工業	87,000	491.00	42,717,000	
	大和ハウス工業	85,900	2,817.00	241,980,300	
	積水ハウス	112,600	1,724.50	194,178,700	
	中電工	35,600	2,071.00	73,727,600	
	協和エクシオ	66,000	1,473.00	97,218,000	
	キリンホールディングス	100,000	1,667.00	166,700,000	
	日本たばこ産業	109,800	4,066.00	446,446,800	
	ゲンゼ	314,000	328.00	102,992,000	
	帝人	550,000	403.00	221,650,000	
	ワコールホールディングス	71,000	1,140.00	80,940,000	
	東ソー	427,000	643.00	274,561,000	
	東亜合成	9,000	1,094.00	9,846,000	
	デンカ	170,000	453.00	77,010,000	
	三菱瓦斯化学	122,000	735.00	89,670,000	
	三菱ケミカルホールディングス	285,000	653.20	186,162,000	
	アイカ工業	20,000	2,731.00	54,620,000	
	宇部興産	560,000	192.00	107,520,000	
	太陽ホールディングス	43,600	3,580.00	156,088,000	
	D I C	39,200	3,220.00	126,224,000	
	武田薬品工業	32,100	4,896.00	157,161,600	
	大塚ホールディングス	70,300	4,678.00	328,863,400	
	東燃ゼネラル石油	318,000	990.00	314,820,000	
	J Xホールディングス	343,900	404.10	138,969,990	
	旭硝子	302,000	661.00	199,622,000	
	日本電気硝子	339,000	524.00	177,636,000	
	フジミインコーポレーテッド	31,000	1,477.00	45,787,000	
	ニチアス	158,000	897.00	141,726,000	
	丸一鋼管	26,100	3,540.00	92,394,000	
	日本軽金属ホールディングス	760,000	220.00	167,200,000	
	三井金属鉱業	800,000	209.00	167,200,000	
	古河機械金属	384,000	159.00	61,056,000	
	古河電気工業	112,000	267.00	29,904,000	
	住友電気工業	101,800	1,455.50	148,169,900	
	リョービ	164,000	448.00	73,472,000	
	アサヒホールディングス	62,000	1,761.00	109,182,000	
	三和ホールディングス	171,000	991.00	169,461,000	
	アイダエンジニアリング	52,400	806.00	42,234,400	
	ディスコ	16,500	11,610.00	191,565,000	
	島精機製作所	25,000	2,698.00	67,450,000	
	やまびこ	33,200	899.00	29,846,800	
	小松製作所	109,200	2,284.00	249,412,800	
	C K D	85,000	1,235.00	104,975,000	
	アマノ	51,100	1,623.00	82,935,300	
	マックス	69,000	1,226.00	84,594,000	
	T H K	44,000	1,986.00	87,384,000	
	日清紡ホールディングス	48,000	1,017.00	48,816,000	
	マブチモーター	37,000	5,390.00	199,430,000	
	日本信号	121,600	857.00	104,211,200	
	パナソニック	290,000	1,032.00	299,280,000	
スミダコーポレーション	138,000	970.00	133,860,000		
アズビル	153,000	3,045.00	465,885,000		
日本セラミック	29,000	1,877.00	54,433,000		
ニチコン	20,000	792.00	15,840,000		
K O A	47,000	850.00	39,950,000		
スター精密	73,000	1,207.00	88,111,000		
東京エレクトロン	63,800	9,120.00	581,856,000		
デンソー	25,300	4,107.00	103,907,100		
東海理化電機製作所	47,000	1,988.00	93,436,000		
日産自動車	177,700	1,028.00	182,675,600		
トヨタ自動車	109,900	6,014.00	660,938,600		
武蔵精密工業	16,000	2,366.00	37,856,000		
太平洋工業	104,000	1,196.00	124,384,000		
アイシン精機	56,800	4,700.00	266,960,000		

本田技研工業	195,400	2,972.00	580,728,800
富士重工業	131,000	3,924.00	514,044,000
ヤマハ発動機	49,500	2,003.00	99,148,500
愛三工業	86,400	809.00	69,897,600
東京精密	40,400	2,764.00	111,665,600
大日本印刷	19,000	1,025.00	19,475,000
リンテック	9,000	2,052.00	18,468,000
中国電力	54,700	1,358.00	74,282,600
沖縄電力	46,500	2,304.00	107,136,000
西日本旅客鉄道	42,700	6,439.00	274,945,300
センコー	408,000	717.00	292,536,000
日本航空	19,200	3,073.00	59,001,600
住友倉庫	162,000	549.00	88,938,000
伊藤忠テクノソリューションズ	14,100	2,642.00	37,252,200
ネットワンシステムズ	72,000	702.00	50,544,000
日本電信電話	159,900	4,800.00	767,520,000
KDDI	47,700	3,219.00	153,546,300
NTTドコモ	137,900	2,623.00	361,711,700
ジャステック	36,400	1,058.00	38,511,200
ダイワボウホールディングス	461,000	238.00	109,718,000
第一興商	24,000	4,135.00	99,240,000
伊藤忠商事	77,600	1,287.00	99,871,200
三井物産	250,400	1,368.00	342,547,200
住友商事	146,100	1,134.00	165,677,400
三菱商事	186,000	2,164.50	402,597,000
サンゲツ	26,500	1,961.00	51,966,500
伊藤忠エネクス	87,000	789.00	68,643,000
三信電気	46,000	926.00	42,596,000
東陽テクニカ	70,000	1,031.00	72,170,000
日鉄住金物産	105,000	368.00	38,640,000
パルグループホールディングス	34,400	2,403.00	82,663,200
エディオン	44,200	874.00	38,630,800
DCMホールディングス	43,000	884.00	38,012,000
AOKIホールディングス	59,000	1,176.00	69,384,000
青山商事	74,700	3,635.00	271,534,500
あおぞら銀行	407,000	363.00	147,741,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,617,000	526.20	850,865,400
りそなホールディングス	461,000	449.30	207,127,300
三井住友トラスト・ホールディングス	496,000	344.60	170,921,600
武蔵野銀行	15,000	2,756.00	41,340,000
ふくおかフィナンシャルグループ	211,000	440.00	92,840,000
池田泉州ホールディングス	110,000	469.00	51,590,000
野村ホールディングス	323,000	458.50	148,095,500
極東証券	22,000	1,345.00	29,590,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	86,600	3,022.00	261,705,200
第一生命保険	74,000	1,408.00	104,192,000
東京海上ホールディングス	142,000	4,051.00	575,242,000
ジャックス	49,000	403.00	19,747,000
日立キャピタル	13,100	2,277.00	29,828,700
オリックス	271,600	1,529.00	415,276,400
大京	850,000	184.00	156,400,000
スターツコーポレーション	66,000	1,859.00	122,694,000
合計 119銘柄	18,805,500	-	19,405,821,890

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)で記載しており、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28年3月28日現在 金額（円）	平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	20,783,200	36,205,674
金銭信託	9,197,432	-
コール・ローン	1,358,757	30,090,061
投資証券	1,706,055,552	1,573,723,685
未収配当金	5,990,313	6,835,384
流動資産合計	1,743,385,254	1,646,854,804
資産合計	1,743,385,254	1,646,854,804
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	101
未払金	-	18,779,936
流動負債合計	-	18,780,037
負債合計	-	18,780,037
純資産の部		
元本等		
元本	1,615,286,744	1,615,286,744
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	128,098,510	12,788,023
元本等合計	1,743,385,254	1,628,074,767
純資産合計	1,743,385,254	1,628,074,767
負債純資産合計	1,743,385,254	1,646,854,804

[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28年 3月29日 至 平成28年 9月27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28年 3月28日現在	平成28年 9月27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	1,859,107,127円	1,615,286,744円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	243,820,383円	-
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,615,286,744円	1,615,286,744円
合計	1,615,286,744円	1,615,286,744円
2. 受益権の総数	1,615,286,744口	1,615,286,744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28年 3月29日 至 平成28年 9月27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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年9月27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28年3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	94,973,106
合計	94,973,106

「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28年3月28日まで）を指しております。

(平成28年9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	45,684,527
合計	45,684,527

「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28年3月29日から平成28年9月27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28年3月28日現在)

該当事項はありません。

(通貨関連)

区分	種類	平成28年9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	10,090,000	-	10,089,899	101
	合計	-	-	10,089,899	101

(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28年3月29日 至 平成28年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成28年3月28日現在	平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.0793円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,793円)」	1口当たり純資産額 1.0079円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,079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	29,568,000	
	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	42	11,911,200	
	投資証券	日本ビルファンド投資法人	88	55,792,000	
	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	60	36,360,000	
	投資証券	日本リテールファンド投資法人	107	26,750,000	
	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	233	42,825,400	
	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	60	37,860,000	
		小計（日本）7銘柄		654	241,066,600
アメリカ・ドル	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-D	7,289.000	193,887.400	
	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	13,825.000	358,344.000	
	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	2,900.000	403,361.000	
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	12,196.000	786,520.040	
	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	9,500.000	272,270.000	
	投資証券	HERSHA HOSPITALITY TRUST-D	6,230.000	158,865.000	
	投資証券	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,500.000	354,620.000	
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,052.000	870,207.520	
	投資証券	SUNSTONE HOTEL INVESTORS-F	5,242.000	137,183.140	
	投資証券	VEREIT INC	50,500.000	522,170.000	
	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	4,433.000	460,899.010	
	投資証券	WELLTOWER INC	9,431.000	724,300.800	
	小計（アメリカ・ドル）12銘柄		134,098.000	5,242,627.910 (525,940,432)	
カナダ・ドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,905.000	206,873.800	
	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,663.000	265,635.870	
	投資証券	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500.000	193,435.000	
	小計（カナダ・ドル）3銘柄		22,068.000	665,944.670 (50,372,055)	
オーストラリア・ドル	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	58,900.000	535,990.000	
	投資証券	GPT GROUP	87,836.000	445,328.520	
	投資証券	MIRVAC GROUP	173,046.000	387,623.040	
	投資証券	SCENTRE GROUP	118,059.000	566,683.200	
	投資証券	STOCKLAND	83,917.000	396,088.240	
	投資証券	WESTFIELD CORP	61,792.000	611,740.800	
	小計（オーストラリア・ドル）6銘柄		583,550.000	2,943,453.800 (225,262,519)	
シンガポール・ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	143,605.000	353,268.300	
	投資証券	CAPITALAND MALL TRUST	119,356.000	255,421.840	
	投資証券	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	175,520.000	189,561.600	
	小計（シンガポール・ドル）3銘柄		438,481.000	798,251.740 (58,815,188)	
イギリス・ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	19,341.000	120,977.950	
	投資証券	HAMMERSON PLC	69,182.000	405,060.610	
	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	45,949.000	480,626.540	
	投資証券	SEGRO PLC	81,030.000	362,366.160	
	投資証券	TRITAX BIG BOX REIT PLC	86,016.000	124,723.200	
	小計（イギリス・ポンド）5銘柄		301,518.000	1,493,754.460 (194,143,267)	
ユーロ	投資証券	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	22,817.000	285,212.500	
	投資証券	EUROCOMMERCIAL	10,661.000	433,902.700	
	投資証券	GECINA SA	1,295.000	180,782.000	
	投資証券	ICADE	5,481.000	379,285.200	
	投資証券	KLEPIERRE	3,933.000	160,427.070	
	投資証券	NSI NV	57,498.000	211,592.640	
	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,377.000	814,870.100	
	小計（ユーロ）7銘柄		105,062.000	2,466,072.210 (278,123,624)	
合計				1,573,723,685 (1,332,657,085)	

- (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 12銘柄	32.30%	33.42%

カナダ・ドル	投資証券	3 銘柄	3.09%	3.20%
オーストラリア・ドル	投資証券	6 銘柄	13.84%	14.31%
シンガポール・ドル	投資証券	3 銘柄	3.61%	3.74%
イギリス・ポンド	投資証券	5 銘柄	11.93%	12.34%
ユーロ	投資証券	7 銘柄	17.08%	17.67%

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](#)

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28年3月28日現在 金額（円）	平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	4,063,267,403	1,106,233,852
金銭信託	484,208,223	-
コール・ローン	71,533,198	403,183,523
株式	72,982,343,874	65,442,435,757
派生商品評価勘定	2,934,252	108,217
未収入金	351,556,942	-
未収配当金	186,537,744	179,055,233
流動資産合計	78,142,381,636	67,131,016,582
資産合計	78,142,381,636	67,131,016,582
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,114,518	65,312
未払解約金	78,210,751	28,678,679
流動負債合計	80,325,269	28,743,991
負債合計	80,325,269	28,743,991
純資産の部		
元本等		
元本	47,550,784,621	44,290,929,056
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	30,511,271,746	22,811,343,535
元本等合計	78,062,056,367	67,102,272,591
純資産合計	78,062,056,367	67,102,272,591
負債純資産合計	78,142,381,636	67,131,016,582

[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28年 3月29日 至 平成28年 9月27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 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28年 3月28日現在	平成28年 9月27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	51,228,992,457円	47,550,784,621円
期中追加設定元本額	255,689,196円	237,361,064円
期中一部解約元本額	3,933,897,032円	3,497,216,629円
元本の内訳		
グローバル好配当株オープン	46,457,902,219円	43,260,484,217円
グローバル資産分散オープン	1,092,882,402円	1,030,444,839円
合計	47,550,784,621円	44,290,929,056円
2. 受益権の総数	47,550,784,621口	44,290,929,056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28年 3月29日 至 平成28年 9月27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28年9月27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28年3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	1,778,391,443
合計	1,778,391,443

「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28年1月9日から平成28年3月28日まで）を指しております。

(平成28年9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	1,505,594,272
合計	1,505,594,272

「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28年7月9日から平成28年9月27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28年3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	399,806,146	-	402,613,617	2,807,471
	売建 オーストラリア・ドル	17,635,895	-	17,520,587	115,308
	香港・ドル	8,721,069	-	8,805,447	84,378
	スイス・フラン	23,781,883	-	23,938,696	156,813
	ユーロ	349,667,299	-	351,529,153	1,861,854
	合計	-	-	804,407,500	819,734

区分	種類	平成28年9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	25,985,555	-	25,920,243	65,312
	売建 オーストラリア・ドル	25,985,555	-	25,877,338	108,217
合計	-	-	51,797,581	42,905	

(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28年3月29日 至 平成28年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成28年3月28日現在	平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.6417円 「1口 = 1円(10,000口 = 16,417円)」	1口当たり純資産額 1.5150円 「1口 = 1円(10,000口 = 15,150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	大和ハウス工業	232,700	2,817.00	655,515,900	
	大塚ホールディングス	254,500	4,678.00	1,190,551,000	
	アズビル	331,800	3,045.00	1,010,331,000	
	日産自動車	690,000	1,028.00	709,320,000	
	日本航空	243,900	3,073.00	749,504,700	
	N T T ドコモ	409,300	2,623.00	1,073,593,900	
	小計(日本)6銘柄	2,162,200	-	5,388,816,500	
アメリカ ・ドル	ALTRIA GROUP INC	127,180	63.030	8,016,155.400	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	122,900	76.680	9,423,972.000	
	ANALOG DEVICES	132,030	62.280	8,222,828.400	
	APPLE INC	83,480	112.880	9,423,222.400	
	AT&T INC	224,200	41.140	9,223,588.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB	134,770	55.480	7,477,039.600	
	BROADCOM LTD	29,000	166.690	4,834,010.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	150,540	46.960	7,069,358.400	
	CARDINAL HEALTH INC	110,340	76.880	8,482,939.200	
	CARNIVAL CORP	152,740	46.470	7,097,827.800	
	CONOCOPHILLIPS	205,070	40.020	8,206,901.400	
	CONSOLIDATED EDISON INC	79,000	78.660	6,214,140.000	
	EXXON MOBIL CORPORATION	87,000	83.060	7,226,220.000	
	FIRST REPUBLIC BANK/CA	83,000	77.030	6,393,490.000	
	HOME DEPOT INC	65,720	125.450	8,244,574.000	
	JM SMUCKER CO/THE	20,510	137.720	2,824,637.200	
	JPMORGAN CHASE & CO	96,380	65.780	6,339,876.400	
	MCDONALDS CORP	51,800	116.530	6,036,254.000	
	MERCK & CO INC	145,900	62.150	9,067,685.000	
	MICROSOFT CORP	163,400	56.900	9,297,460.000	
	NEXTERA ENERGY INC	76,250	126.230	9,625,037.500	
	NORTHERN TRUST CORP	81,500	67.460	5,497,990.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	41,210	217.000	8,942,570.000	
	NVIDIA CORP	106,900	64.340	6,877,946.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	90,810	99.140	9,002,903.400	
	RAYTHEON COMPANY	58,000	138.540	8,035,320.000	
	SCHLUMBERGER LTD	92,210	75.580	6,969,231.800	
	STARBUCKS CORP	128,290	54.040	6,932,791.600	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	44,000	139.720	6,147,680.000	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	77,000	80.680	6,212,360.000	
	WELLS FARGO & COMPANY	87,840	44.880	3,942,259.200	
小計(アメリカ・ドル)31銘柄	3,148,970	-	227,308,268.700 (22,803,565,515)		
カナダ ・ドル	TORONTO-DOMINION BANK	136,380	57.820	7,885,491.600	
	小計(カナダ・ドル)1銘柄	136,380	-	7,885,491.600 (596,458,584)	
オースト ラリア・ ドル	AMCOR LTD	770,320	15.150	11,670,348.000	
	AMP LTD	1,731,600	5.320	9,212,112.000	
	TELSTRA CORP	2,181,790	5.190	11,323,490.100	

	WESTPAC BANKING CORPORATION	345,559	30.350	10,487,715.650	
	小計(オーストラリア・ドル)4銘柄	5,029,269	-	42,693,665.750 (3,267,346,239)	
香港 ・ドル	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	3,915,000	20.300	79,474,500.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,376,000	26.200	62,251,200.000	
	CHINA MOBILE LTD	633,000	95.200	60,261,600.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,870,000	26.700	76,629,000.000	
	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	9,338,000	4.730	44,168,740.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	698,500	99.200	69,291,200.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	7,600,000	6.800	51,680,000.000	
	PETROCHINA CO LTD-H	13,082,000	4.980	65,148,360.000	
	SANDS CHINA LTD	2,320,000	32.300	74,936,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	360,000	116.700	42,012,000.000	
	小計(香港・ドル)10銘柄	43,192,500	-	625,852,600.000 (8,092,274,118)	
シンガ ポール ・ドル	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,108,000	3.960	8,347,680.000	
	小計(シンガポール・ドル)1銘柄	2,108,000	-	8,347,680.000 (615,057,062)	
台湾 ・ドル	DELTA ELECTRONICS INC	1,554,000	166.000	257,964,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	1,702,131	183.000	311,489,973.000	
	小計(台湾・ドル)2銘柄	3,256,131	-	569,453,973.000 (1,810,863,634)	
イギリス ・ポンド	ASTRAZENECA PLC	111,900	50.990	5,705,781.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,100	48.850	7,234,685.000	
	BUNZL PLC	162,000	22.870	3,704,940.000	
	EASYJET PLC	718,700	10.160	7,301,992.000	
	IMPERIAL BRANDS PLC	153,710	39.725	6,106,129.750	
	ITV PLC	2,809,000	1.834	5,151,706.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,666,900	2.186	5,829,843.400	
	NATIONAL GRID PLC	721,100	10.790	7,780,669.000	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	76,300	71.830	5,480,629.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	266,680	19.250	5,133,590.000	
	小計(イギリス・ポンド)10銘柄	7,834,390	-	59,429,965.150 (7,724,112,570)	
スイス・ フラン	GIVAUDAN-REG	4,100	1,989.000	8,154,900.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	167,000	39.740	6,636,580.000	
	NOVARTIS AG-REG	89,490	78.000	6,980,220.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,500	242.100	7,868,250.000	
	SWISS RE AG	71,600	88.000	6,300,800.000	
	UBS GROUP AG	472,570	13.060	6,171,764.200	
	小計(スイス・フラン)6銘柄	837,260	-	42,112,514.200 (4,356,539,594)	
ノル ウェー ・クロー ネ	TELENOR ASA	458,200	133.400	61,123,880.000	
	小計(ノルウェー・クローネ)1銘柄	458,200	-	61,123,880.000 (755,491,156)	
韓国・ ウォン	KIA MOTORS CORPORATION	178,000	43,750.000	7,787,500,000.000	
	KT&G CORP	78,300	119,000.000	9,317,700,000.000	
	小計(韓国・ウォン)2銘柄	256,300	-	17,105,200,000.000 (1,546,310,080)	
ユーロ	ACCOR SA	189,880	34.980	6,642,002.400	
	ATLANTIA SPA	270,000	22.560	6,091,200.000	
	DEUTSCHE TELEKOM AG	427,800	14.970	6,404,166.000	
	ING GROEP NV	734,710	10.815	7,945,888.650	
	KONE OYJ-B	118,660	46.400	5,505,824.000	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	325,945	20.520	6,688,391.400	
	RELX NV	430,082	15.670	6,739,384.940	
	SAMPO OYJ-A SHS	167,470	40.480	6,779,185.600	
	SNAM SPA	1,435,170	4.860	6,974,926.200	
	SOCIETE GENERALE	73,000	30.950	2,259,350.000	
	TOTAL SA	188,230	41.730	7,854,837.900	
	UNILEVER NV-CVA	131,900	40.600	5,355,140.000	
	小計(ユーロ)12銘柄	4,492,847	-	75,240,297.090 (8,485,600,705)	
	合計	72,912,447	-	65,442,435,757 (60,053,619,257)	

(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	33.98%	34.85%
カナダ・ドル	外国株式 1銘柄	0.89%	0.91%
オーストラリア・ドル	外国株式 4銘柄	4.87%	4.99%
香港・ドル	外国株式 10銘柄	12.06%	12.37%
シンガポール・ドル	外国株式 1銘柄	0.92%	0.94%
台湾・ドル	外国株式 2銘柄	2.70%	2.77%
イギリス・ポンド	外国株式 10銘柄	11.51%	11.80%
スイス・フラン	外国株式 6銘柄	6.49%	6.66%
ノルウェー・クローネ	外国株式 1銘柄	1.13%	1.15%
韓国・ウォン	外国株式 2銘柄	2.30%	2.36%
ユーロ	外国株式 12銘柄	12.64%	12.97%

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28年3月28日現在 金額（円）	平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	173,552,787	257,802,613
金銭信託	130,733,966	-
コール・ローン	19,313,630	150,089,962
国債証券	6,163,294,204	4,451,232,108
特殊債券	647,226,518	602,718,860
社債券	2,862,738,517	2,219,467,857
派生商品評価勘定	6,029,725	13,045,423
未収利息	147,267,622	97,406,643
前払費用	13,136,574	17,496,840
流動資産合計	10,163,293,543	7,809,260,306
資産合計	10,163,293,543	7,809,260,306
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,793,339	5,028,756
未払金	-	40,179,966
流動負債合計	15,793,339	45,208,722
負債合計	15,793,339	45,208,722
純資産の部		
元本等		
元本	5,090,888,206	3,977,082,619
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,056,611,998	3,786,968,965
元本等合計	10,147,500,204	7,764,051,584
純資産合計	10,147,500,204	7,764,051,584
負債純資産合計	10,163,293,543	7,809,260,306

[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28年3月29日 至 平成28年9月27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28年3月28日現在	平成28年9月27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	6,120,077,528円	5,090,888,206円
期中追加設定元本額	198,848,256円	36,835,829円
期中一部解約元本額	1,228,037,578円	1,150,641,416円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	581,436,301円	534,456,084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）	2,012,771,894円	1,806,580,778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）	2,496,680,011円	1,636,045,757円
合計	5,090,888,206円	3,977,082,619円
2. 受益権の総数	5,090,888,206口	3,977,082,619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28年3月29日 至 平成28年9月27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28年9月27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28年3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	69,466,180
特殊債証券	4,567,578
社債証券	4,318,088
合計	60,580,514

「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11月10日から平成28年3月28日まで）を指しております。

(平成28年9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	221,256,129
特殊債証券	17,309,918
社債証券	88,081,557
合計	326,647,604

「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28年5月10日から平成28年9月27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28年3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	364,007,457	-	366,351,760	2,344,303
	売建 メキシコ・ペソ ユーロ	248,300,888	-	262,352,537	14,051,649
		115,706,569	-	113,762,837	1,943,732
合計		-	-	742,467,134	9,763,614

区分	種類	平成28年9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	155,838,990	-	152,342,166	3,496,824
	メキシコ・ペソ	23,186,709	-	21,654,777	1,531,932
	売建 アメリカ・ドル メキシコ・ペソ ユーロ	25,186,709	-	24,808,916	377,793
		114,760,800	-	102,465,000	12,295,800
		41,078,190	-	40,706,360	371,830
合計		-	-	341,977,219	8,016,667

(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28年3月29日 至 平成28年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成28年3月28日現在	平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.9933円 「1口 = 1円(10,000口 = 19,933円)」	1口当たり純資産額 1.9522円 「1口 = 1円(10,000口 = 19,522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	ANGOL 9.5 11/12/25	400,000.000	402,000.000	
	国債証券	ARGON 8.75 05/07/24	845,000.000	978,848.000	
	国債証券	ARGENT 6.875 04/22/21	500,000.000	544,500.000	
	国債証券	ARGENT 7.5 04/22/26	885,000.000	994,297.500	
	国債証券	ARGENT 8.28 12/31/33	623,906.910	719,988.560	
	国債証券	BRAZIL 4.25 01/07/25	3,125,000.000	3,105,468.750	
	国債証券	BRAZIL 5 01/27/45	759,000.000	692,587.500	
	国債証券	BRAZIL 6 04/07/26	400,000.000	443,500.000	
	国債証券	COLOM 5 06/15/45	400,000.000	425,000.000	
	国債証券	COLOM 6.125 01/18/41	650,000.000	775,125.000	
	国債証券	CROATI 5.5 04/04/23	250,000.000	278,485.000	
	国債証券	CROATI 6 01/26/24	700,000.000	805,084.000	
	国債証券	CROATI 6.375 03/24/21	250,000.000	281,820.000	
	国債証券	CROATI 6.625 07/14/20	865,000.000	971,654.500	
	国債証券	DOMREP 5.5 01/27/25	955,000.000	1,017,075.000	
	国債証券	DOMREP 6.85 01/27/45	660,000.000	745,800.000	
	国債証券	DOMREP 7.45 04/30/44	300,000.000	359,250.000	
	国債証券	DOMREP 7.5 05/06/21	400,000.000	450,000.000	
	国債証券	ELSALV 5.875 01/30/25	460,000.000	461,150.000	
	国債証券	ELSALV 6.375 01/18/27	450,000.000	459,000.000	
	国債証券	ELSALV 6.375 01/18/27	240,000.000	244,800.000	
	国債証券	GABON 6.375 12/12/24	300,000.000	276,750.000	
	国債証券	GABON 6.95 06/16/25	400,000.000	371,808.000	
	国債証券	GHANA 7.875 08/07/23	200,000.000	187,576.000	
	国債証券	GHANA 9.25 09/15/22	200,000.000	205,410.000	
	国債証券	INDOIS 4.35 09/10/24	600,000.000	645,780.000	
	国債証券	INDON 4.625 04/15/43	390,000.000	415,252.500	
	国債証券	INDON 4.875 05/05/21	750,000.000	826,732.500	
	国債証券	INDON 5.25 01/17/42	200,000.000	228,508.000	
	国債証券	IVYCST 5.375 07/23/24	1,249,000.000	1,261,465.020	
	国債証券	IVYCST 6.375 03/03/28	200,000.000	210,984.000	
	国債証券	JAMAN 6.75 04/28/28	500,000.000	573,750.000	
	国債証券	JAMAN 7.625 07/09/25	550,000.000	649,000.000	
	国債証券	JAMAN 7.875 07/28/45	400,000.000	474,000.000	
	国債証券	JAMAN 8 03/15/39	445,000.000	538,450.000	
	国債証券	JMGB 8.5 11/16/21	1,047,618.640	1,110,496.710	
	国債証券	KENINT 6.875 06/24/24	700,000.000	693,875.000	
	国債証券	LEBAN 5.8 04/14/20	200,000.000	198,340.000	
	国債証券	LEBAN 6.6 11/27/26	350,000.000	347,462.500	
	国債証券	LEBAN 8.25 04/12/21	400,000.000	436,892.000	
国債証券	MEX 3.6 01/30/25	200,000.000	206,100.000		
国債証券	MOROC 4.25 12/11/22	275,000.000	293,317.750		
国債証券	OMANIB 4.75 06/15/26	200,000.000	204,870.000		
国債証券	PKSTAN 6.75 12/03/19	975,000.000	1,040,890.500		
国債証券	PKSTAN 7.25 04/15/19	200,000.000	212,038.000		

国債証券	PKSTAN 8.25 09/30/25	200,000.000	226,440.000
国債証券	RUSSIA 4.875 09/16/23	1,000,000.000	1,101,380.000
国債証券	SERBIA 5.875 12/03/18	340,000.000	361,491.400
国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	2,500,000.000	2,928,800.000
国債証券	SERBIA FL 11/01/24	549,027.470	555,000.870
国債証券	SLOVEN 5.25 02/18/24	495,000.000	579,907.350
国債証券	SOAF 4.665 01/17/24	948,000.000	1,011,686.640
国債証券	SOAF 5.875 09/16/25	300,000.000	345,321.000
国債証券	SRILAN 5.875 07/25/22	1,250,000.000	1,291,887.500
国債証券	SRILAN 6.25 07/27/21	600,000.000	629,892.000
国債証券	SRILAN 6.25 10/04/20	200,000.000	209,970.000
国債証券	SRILAN 6.85 11/03/25	200,000.000	215,190.000
国債証券	TRITOB 4.5 08/04/26	200,000.000	207,000.000
国債証券	TURKEY 6.25 09/26/22	250,000.000	276,750.000
国債証券	TURKEY 6.875 03/17/36	100,000.000	118,961.000
国債証券	TURKSK 4.489 11/25/24	925,000.000	924,047.250
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/20	1,500,000.000	1,482,525.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/21	1,400,000.000	1,375,920.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/25	700,000.000	673,064.000
国債証券	VIETNM 4.8 11/19/24	600,000.000	642,084.000
国債証券	ZAMBIN 5.375 09/20/22	1,050,000.000	931,875.000
国債証券	ZAMBIN 8.97 07/30/27	400,000.000	400,000.000
特殊債券	BNCE FL 08/11/26	200,000.000	199,090.000
特殊債券	ESKOM 6.75 08/06/23	300,000.000	311,250.000
特殊債券	ESKOM 7.125 02/11/25	1,350,000.000	1,404,000.000
特殊債券	GAZPRU 7.288 08/16/37	250,000.000	295,805.000
特殊債券	PEMEX 5.5 06/27/44	1,385,000.000	1,220,046.500
特殊債券	PEMEX 6.5 06/02/41	1,754,000.000	1,718,937.540
特殊債券	VEBBNK 6.8 11/22/25	200,000.000	221,894.000
特殊債券	VEBBNK 6.902 07/09/20	525,000.000	572,423.250
社債券	ADTIN 4 08/03/26	200,000.000	201,624.000
社債券	AKBNK 5.125 03/31/25	200,000.000	196,500.000
社債券	ALFAA 6.875 03/25/44	200,000.000	214,500.000
社債券	ALRSRU 7.75 11/03/20	200,000.000	228,982.000
社債券	ANGSJ 5.125 08/01/22	90,000.000	92,587.500
社債券	ANGSJ 5.375 04/15/20	110,000.000	114,785.000
社債券	AVALCB 4.75 09/26/22	200,000.000	199,500.000
社債券	BANBOG 6.25 05/12/26	200,000.000	212,500.000
社債券	BEEFBZ 7.75 01/31/23	200,000.000	212,000.000
社債券	BHIP 9.75 11/30/20	225,000.000	255,937.500
社債券	BRADES 5.75 03/01/22	200,000.000	209,000.000
社債券	BRADES 5.9 01/16/21	100,000.000	104,750.000
社債券	BRASKM 7.125 07/22/41	200,000.000	212,500.000
社債券	BRSRBZ 7.375 02/02/22	200,000.000	197,000.000
社債券	CBVS 6.5 06/15/21	150,000.000	157,875.000
社債券	CEMEX 7.75 04/16/26	400,000.000	439,880.000
社債券	CHGRID 3.125 05/22/23	500,000.000	525,865.000
社債券	CIKLIS 4.95 09/14/26	200,000.000	202,820.000
社債券	CSANBZ 7 01/20/27	400,000.000	422,000.000
社債券	DLLTD 8.25 09/30/20	200,000.000	180,000.000
社債券	DPWDU 6.85 07/02/37	290,000.000	338,505.400
社債券	EMAAR 3.635 09/15/26	200,000.000	198,896.000
社債券	EMAAR 4.564 06/18/24	200,000.000	214,250.000
社債券	EXIMBK 3.375 08/05/26	200,000.000	202,852.000
社債券	EXIMBK 4 01/14/23	700,000.000	745,164.000
社債券	FRES 5.5 11/13/23	200,000.000	221,000.000
社債券	GALIAR 8.25 07/19/26	200,000.000	219,262.000
社債券	GALIAR 8.25 07/19/26	200,000.000	219,262.000
社債券	GAZPRU 4.95 07/19/22	200,000.000	209,382.000
社債券	GCCAMM 8.125 02/08/20	200,000.000	212,500.000
社債券	HKHKD 3.875 04/08/23	200,000.000	205,490.000
社債券	HSBKKZ 7.25 01/28/21	200,000.000	218,020.000
社債券	ICTPM 5.875 09/17/25	200,000.000	219,750.000
社債券	IRCPAR 8.75 03/23/23	200,000.000	223,000.000
社債券	ISRELE 6.875 06/21/23	350,000.000	419,520.500
社債券	ITAU 5.65 03/19/22	200,000.000	206,000.000
社債券	KZOKZ 5.75 04/30/43	750,000.000	765,705.000

社債券	KZOKZ 6.375 04/09/21	400,000.000	441,560.000	
社債券	KZOKZ 7 05/05/20	900,000.000	1,010,070.000	
社債券	MABEMX 7.875 10/28/19	250,000.000	280,625.000	
社債券	MEXCAT 4.25 10/31/26	400,000.000	402,344.000	
社債券	MRFGBZ 8 06/08/23	200,000.000	203,940.000	
社債券	MRFGBZ 9.5 05/04/20	200,000.000	207,000.000	
社債券	NSBLK 8.875 09/18/18	200,000.000	215,864.000	
社債券	OMGRID 3.958 05/07/25	200,000.000	194,042.000	
社債券	PDLLN 8.25 05/31/20	200,000.000	201,000.000	
社債券	PEMEX 4.25 01/15/25	300,000.000	290,250.000	
社債券	PEMEX 4.625 09/21/23	75,000.000	74,406.750	
社債券	PEMEX 5.625 01/23/46	355,000.000	309,258.250	
社債券	PEMEX 6.375 01/23/45	200,000.000	192,000.000	
社債券	PEMEX 6.875 08/04/26	500,000.000	556,995.000	
社債券	PERTIJ 5.625 05/20/43	1,425,000.000	1,502,035.500	
社債券	PETBRA 5.375 01/27/21	175,000.000	174,562.500	
社債券	PETBRA 6.75 01/27/41	215,000.000	187,050.000	
社債券	PETBRA 6.85 06/05/15	379,000.000	321,676.250	
社債券	PETBRA 8.375 05/23/21	1,150,000.000	1,264,091.500	
社債券	PETBRA 8.75 05/23/26	250,000.000	276,562.500	
社債券	PETRTT 9.75 08/14/19	600,000.000	667,500.000	
社債券	RILIN 4.125 01/28/25	250,000.000	262,480.000	
社債券	SAFTRA 4 07/26/22	200,000.000	195,240.000	
社債券	SBERRU 5.125 10/29/22	200,000.000	204,506.000	
社債券	SBERRU 6.125 02/07/22	300,000.000	331,875.000	
社債券	SISETI 4.25 05/09/20	200,000.000	198,502.000	
社債券	SMPM 4.25 10/17/19	200,000.000	208,976.000	
社債券	SOLUIJ 6.25 02/24/20	400,000.000	424,076.000	
社債券	TBIGIJ 5.25 02/10/22	200,000.000	207,978.000	
社債券	TCZIRA 4.75 04/29/21	450,000.000	449,109.000	
社債券	TELVIS 6.125 01/31/46	200,000.000	223,352.000	
社債券	VIP 6.25 04/26/20	200,000.000	210,672.000	
社債券	VIP 7.25 04/26/23	200,000.000	217,618.000	
社債券	VOTORA 7.25 04/05/41	400,000.000	397,500.000	
	小計(アメリカ・ドル) 146銘柄	67,759,553.020	71,321,703.740 (7,154,993,319)	
メキシコ ・ペソ	国債証券	MBONO 10 12/05/24	3,500,000.000	4,395,300.000
	国債証券	MBONO 7.75 11/13/42	8,573,000.000	9,786,079.500
	特殊債券	PEMEX 7.19 09/12/24	1,400,000.000	1,284,192.000
	小計(メキシコ・ペソ) 3銘柄	13,473,000.000	15,465,571.500 (77,946,480)	
ユーロ	国債証券	ALBANI 5.75 11/12/20	325,000.000	358,920.250
		小計(ユーロ) 1銘柄	325,000.000	358,920.250 (40,479,026)
合計			7,273,418,825 (7,273,418,825)	

- (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	92.16%	98.37%
	特殊債券		
	社債券		
メキシコ・ペソ	国債証券	1.00%	1.07%
	特殊債券		
ユーロ	国債証券	0.52%	0.56%

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](#)

欧州債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成28年3月28日現在 金額（円）	平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	43,999,204	28,304,203
金銭信託	400,630	-
コール・ローン	59,185	448,930
国債証券	761,258,776	700,086,165
特殊債券	38,474,491	31,934,598
社債券	341,926,759	265,344,016
派生商品評価勘定	1,930,027	3,346,398
未収入金	7,021,583	-
未収利息	14,257,735	9,502,794
前払費用	2,522,263	401,784
流動資産合計	1,211,850,653	1,039,368,888
資産合計	1,211,850,653	1,039,368,888
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,513,699	3,408,835
未払金	6,663,539	-
流動負債合計	10,177,238	3,408,835
負債合計	10,177,238	3,408,835
純資産の部		
元本等		
元本	939,072,127	872,516,386
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	262,601,288	163,443,667
元本等合計	1,201,673,415	1,035,960,053
純資産合計	1,201,673,415	1,035,960,053
負債純資産合計	1,211,850,653	1,039,368,888

[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28年3月29日 至 平成28年9月27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28年3月28日現在	平成28年9月27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	1,015,818,098円	939,072,127円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	76,745,971円	66,555,741円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	939,072,127円	872,516,386円
合計	939,072,127円	872,516,386円
2. 受益権の総数	939,072,127口	872,516,386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28年3月29日 至 平成28年9月27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28年9月27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28年3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	4,714,473
特殊債券	48,422
社債券	3,754,621
合計	1,008,274

「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28年3月28日まで）を指しております。

(平成28年9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	31,037,768
特殊債券	416,417
社債券	6,315,033
合計	37,769,218

「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28年3月29日から平成28年9月27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28年3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	14,291,654	-	13,279,170	1,012,484
	スイス・フラン	18,846,461	-	18,921,040	74,579
	デンマーク・クローネ	2,857,779	-	2,800,050	57,729
	スウェーデン・クローナ	12,003,748	-	12,003,200	548
	ポーランド・ズロチ	10,719,382	-	11,140,880	421,498
	ユーロ	118,760,105	-	118,192,830	567,275
	売建				
	イギリス・ポンド	26,138,270	-	25,758,390	379,880
	ノルウェー・クローネ	1,106,280	-	1,116,360	10,080
	スウェーデン・クローナ	39,068,620	-	39,528,720	460,100
	セルビア・ディナール	21,244,895	-	21,725,568	480,673
	ルーマニア・レイ	20,316,840	-	20,206,200	110,640
	ポーランド・ズロチ	10,885,200	-	11,140,880	255,680
	ユーロ	58,719,024	-	58,444,724	274,300
	合計	-	-	354,258,012	1,583,672

区分	種類	平成28年9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	21,073,546	-	20,768,443	305,103
	スイス・フラン	5,244,049	-	5,175,500	68,549
	スウェーデン・クローナ	6,338,715	-	6,201,836	136,879
	セルビア・ディナール	1,638,907	-	1,634,122	4,785
	ルーマニア・レイ	3,716,027	-	3,700,581	15,446
	ロシア・ルーブル	530,784	-	533,324	2,540
	ポーランド・ズロチ	18,975,228	-	18,902,270	72,958
	ユーロ	162,487,817	-	159,687,752	2,800,065
	売建				
	イギリス・ポンド	27,180,960	-	26,734,680	446,280
	デンマーク・クローネ	7,698,920	-	7,625,520	73,400
	ノルウェー・クローネ	1,239,270	-	1,244,320	5,050
	スウェーデン・クローナ	20,270,210	-	19,870,620	399,590
	セルビア・ディナール	30,948,309	-	30,511,613	436,696
	ルーマニア・レイ	25,205,400	-	25,056,900	148,500
	ロシア・ルーブル	15,397,428	-	14,573,023	824,405
	ポーランド・ズロチ	34,547,320	-	34,047,300	500,020
	ユーロ	57,517,256	-	57,002,289	514,967
	合計	-	-	433,270,093	62,437

(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28年3月29日 至 平成28年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成28年3月28日現在	平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.2796円 「1口 = 1円 (10,000口 = 12,796円)」	1口当たり純資産額 1.1873円 「1口 = 1円 (10,000口 = 11,873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 12/07/46	246,000.000	417,981.060	
	国債証券	UKT 4.75 12/07/38	158,000.000	261,614.820	
	国債証券	UKT 5 03/07/25	71,000.000	97,103.860	
	特殊債券	ICO 1.875 12/15/17	200,000.000	202,032.000	
	社債券	DEXGRP 1.875 07/17/17	200,000.000	202,118.000	
	小計(イギリス・ポンド) 5銘柄		875,000.000	1,180,849.740 (153,475,041)	
デンマ ーク・ク ローネ	国債証券	DGB 1.75 11/15/25	600,000.000	697,836.000	
	国債証券	DGB 4.5 11/15/39	161,000.000	303,544.570	
	社債券	RDKRE 2 04/01/24	400,000.000	445,416.000	
	小計(デンマーク・クローネ) 3銘柄		1,161,000.000	1,446,796.570 (21,890,032)	
ノル ウェー・ クローネ	国債証券	NGB 4.25 05/19/17	541,000.000	553,984.000	
	小計(ノルウェー・クローネ) 1銘柄		541,000.000	553,984.000 (6,847,242)	
スウェ ーデン・ク ローナ	国債証券	SGB 3.5 03/30/39	300,000.000	450,351.000	
	特殊債券	EIB 1.75 11/12/26	450,000.000	483,930.000	
	社債券	NDASS 1 04/08/22	800,000.000	822,840.000	
	社債券	SEB 1.5 06/17/20	1,000,000.000	1,054,350.000	
	小計(スウェーデン・クローナ) 4銘柄		2,550,000.000	2,811,471.000 (32,978,555)	
セルビア	国債証券	SERBGB 10 08/21/19	18,000,000.000	20,456,460.000	

・ディ ナール	国債証券	SERBGB 6 02/22/19	10,210,000.000	10,580,010.400
	小計(セルビア・ディナール) 2 銘柄		28,210,000.000	31,036,470.400 (28,426,303)
ルーマニ ア・レイ	国債証券	ROMGB 5.8 07/26/27	230,000.000	286,826.100
	国債証券	ROMGB 5.85 04/26/23	460,000.000	551,682.600
	小計(ルーマニア・レイ) 2 銘柄		690,000.000	838,508.700 (21,247,811)
ロシア・ ルーブル	国債証券	RFLB 7.5 08/18/21	9,200,000.000	8,929,520.000
	小計(ロシア・ルーブル) 1 銘柄		9,200,000.000	8,929,520.000 (14,019,347)
ポーラン ド・ズロ チ	国債証券	POLGB 2.5 07/25/26	240,000.000	234,276.000
	国債証券	POLGB 5.75 09/23/22	340,000.000	404,090.000
	小計(ポーランド・ズロチ) 2 銘柄		580,000.000	638,366.000 (16,757,108)
ユーロ	国債証券	ALBANI 5.75 11/12/20	100,000.000	110,437.000
	国債証券	BGARIA 1.875 03/21/23	100,000.000	104,815.000
	国債証券	BGB 0.8 06/22/25	58,000.000	62,162.660
	国債証券	BGB 4.25 03/28/41	62,000.000	109,429.380
	国債証券	BGB 4.25 09/28/22	9,000.000	11,564.010
	国債証券	BGB 4.5 03/28/26	25,000.000	35,692.000
	国債証券	BGB 5 03/28/35	21,000.000	37,240.560
	国債証券	BTPS 0.7 05/01/20	175,000.000	179,156.250
	国債証券	BTPS 2 12/01/25	233,000.000	251,260.210
	国債証券	BTPS 3.1 09/15/26	40,000.000	53,687.700
	国債証券	BTPS 3.25 09/01/46	31,000.000	38,103.340
	国債証券	BTPS 4.25 03/01/20	123,000.000	140,759.970
	国債証券	BTPS 4.5 03/01/26	21,000.000	27,293.070
	国債証券	BTPS 4.75 09/01/28	29,000.000	39,765.090
	国債証券	BTPS 4.75 09/01/44	134,000.000	206,441.740
	国債証券	BTPS 5 08/01/39	46,000.000	70,965.580
	国債証券	BTPS 5 09/01/40	64,000.000	99,225.600
	国債証券	BTPS 5.5 09/01/22	173,000.000	223,865.460
	国債証券	BTPS 5.75 02/01/33	19,000.000	30,180.360
	国債証券	CYPRUS 3.75 07/26/23	35,000.000	35,875.000
	国債証券	CYPRUS 3.875 05/06/22	130,000.000	135,590.000
	国債証券	CYPRUS 4.25 11/04/25	10,000.000	10,654.000
	国債証券	DBR 1 08/15/25	43,000.000	47,846.530
	国債証券	DBR 2.5 07/04/44	59,000.000	91,062.370
	国債証券	FRTR 0.5 05/25/26	240,000.000	248,671.200
	国債証券	FRTR 3.25 05/25/45	157,000.000	246,147.740
	国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	56,000.000	101,558.240
	国債証券	INDON 2.875 07/08/21	149,000.000	159,678.830
	国債証券	IRISH 2 02/18/45	20,000.000	23,967.000
	国債証券	IRISH 5.4 03/13/25	90,000.000	128,655.000
	国債証券	ISRAEL 2.875 01/29/24	100,000.000	117,150.000
	国債証券	LATVIA 1.375 05/16/36	110,000.000	119,885.700
	国債証券	MEX 3.625 04/09/29	100,000.000	119,610.000
	国債証券	MONTEN FL 12/09/16	24,000.000	24,210.000
	国債証券	OBL 0 10/08/21	175,000.000	180,080.250
	国債証券	RAGB 3.8 01/26/62	15,000.000	30,757.650
	国債証券	SLOREP 1.5 03/25/35	20,000.000	19,862.400
	国債証券	SLOREP 2.25 03/03/32	65,000.000	73,440.900
	国債証券	SLOREP 5.125 03/30/26	143,000.000	202,133.360
	国債証券	SPGB 3.45 07/30/66	54,000.000	67,584.780
	国債証券	SPGB 5.15 10/31/44	12,000.000	20,209.560
	国債証券	SPGB 5.9 07/30/26	219,000.000	320,543.730
	社債券	ADRBID 7.875 11/15/20	100,000.000	104,752.000
	社債券	ALTICE 9 06/15/23	100,000.000	113,975.000
	社債券	ARION 3.125 03/12/18	115,000.000	118,874.350
	社債券	BALTAL 7.75 09/15/22	100,000.000	107,617.000
	社債券	CMZB 4 03/23/26	50,000.000	51,039.500
	社債券	DEXGRP 0.625 01/21/22	50,000.000	51,998.000
	社債券	EIBKOR 2 04/30/20	160,000.000	170,988.800
	社債券	HETAR 2.375 12/13/22	400,000.000	450,224.000
	社債券	ISLBAN 1.75 09/07/20	120,000.000	120,858.000
	社債券	LOXAM 7 07/23/22	100,000.000	108,512.000
	社債券	NWIDE 6.75 07/22/20	50,000.000	60,259.500
社債券	PEMEX 2.75 04/21/27	110,000.000	97,513.900	

社債券	PSMGR 2.625 04/15/21	7,000.000	7,560.630	
社債券	SYMRIS 1.75 07/10/19	35,000.000	36,264.900	
社債券	UNICZ 0.625 04/30/20	100,000.000	100,733.000	
社債券	WINDIM 7 04/23/21	100,000.000	104,995.000	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	58,670.000	
小計(ユーロ)59銘柄		5,236,000.000	6,222,054.800 (701,723,340)	
合計			997,364,779 (997,364,779)	

- (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 3銘柄	14.82%	15.39%
	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 2銘柄	2.11%	2.19%
	社債券 1銘柄		
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.66%	0.69%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	3.18%	3.31%
	特殊債券 1銘柄		
	社債券 2銘柄		
セルビア・ディナール	国債証券 2銘柄	2.74%	2.85%
ルーマニア・レイ	国債証券 2銘柄	2.05%	2.13%
ロシア・ルーブル	国債証券 1銘柄	1.35%	1.40%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	1.62%	1.68%
ユーロ	国債証券 42銘柄	67.74%	70.36%
	社債券 17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](#)

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28年3月28日現在 金額（円）	平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	105,437,315	188,331,918
金銭信託	9,116,353	-
コール・ローン	1,346,779	17,709,722
国債証券	331,674,619	275,595,241
特殊債券	797,092,547	644,087,176
未収利息	9,704,568	6,835,510
流動資産合計	1,254,372,181	1,132,559,567
資産合計	1,254,372,181	1,132,559,567
負債の部		
流動負債		
未払金	-	74,310,987
流動負債合計	-	74,310,987
負債合計	-	74,310,987
純資産の部		
元本等		
元本	946,421,994	855,464,668
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	307,950,187	202,783,912
元本等合計	1,254,372,181	1,058,248,580
純資産合計	1,254,372,181	1,058,248,580
負債純資産合計	1,254,372,181	1,132,559,567

[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28年3月29日 至 平成28年9月27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	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28年3月28日現在	平成28年9月27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	1,035,297,717円	946,421,994円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	88,875,723円	90,957,326円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	946,421,994円	855,464,668円
合計	946,421,994円	855,464,668円
2. 受益権の総数	946,421,994口	855,464,668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28年3月29日 至 平成28年9月27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28年9月27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28年3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	451,317
特殊債券	2,524,479
合計	2,975,796

「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28年3月28日まで）を指しております。

（平成28年9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	442,586
特殊債券	1,692,921
合計	2,135,507

「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28年3月29日から平成28年9月27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28年3月28日現在）

該当事項はありません。

（平成28年9月27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28年3月29日 至 平成28年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成28年3月28日現在	平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.3254円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,254円）」	1口当たり純資産額 1.2370円 「1口 = 1円（10,000口 = 12,370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	4,000,000.000	4,111,520.000	
	小計（オーストラリア・ドル）1銘柄		4,000,000.000	4,111,520.000 (314,654,626)	
香港・ドル	国債証券	HKGB 2.44 12/07/20	4,000,000.000	4,302,000.000	
	小計（香港・ドル）1銘柄		4,000,000.000	4,302,000.000 (55,624,860)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.5 06/01/19	700,000.000	728,700.000	
	小計（シンガポール・ドル）1銘柄		700,000.000	728,700.000 (53,690,616)	
ニュージーランド・ドル	特殊債券	EIB 7.5 12/15/17	1,000,000.000	1,060,420.000	
	特殊債券	NIB 4.875 01/22/19	900,000.000	948,645.000	
	特殊債券	RENTEN 4 01/30/20	2,400,000.000	2,510,520.000	
	小計（ニュージーランド・ドル）3銘柄		4,300,000.000	4,519,585.000 (329,432,551)	
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 4.25 06/10/21	900,000,000.000	1,017,603,000.000	
	小計（韓国・ウォン）1銘柄		900,000,000.000	1,017,603,000.000 (91,991,311)	
マレーシア・リンギット	国債証券	MGS 3.8 08/17/23	3,000,000.000	3,065,970.000	
	小計（マレーシア・リンギット）1銘柄		3,000,000.000	3,065,970.000 (74,288,453)	
合計				919,682,417 (919,682,417)	

- (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	29.73%	34.21%
香港・ドル	国債証券 1銘柄	5.26%	6.05%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	5.07%	5.84%
ニュージーランド・ドル	特殊債券 3銘柄	31.13%	35.82%
韓国・ウォン	国債証券 1銘柄	8.69%	10.00%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	7.02%	8.08%

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28年3月28日現在 金額（円）	平成28年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	8,718,960	7,529,104
社債券	556,662,785	524,960,917
未収利息	2,366,921	3,951,801
前払費用	-	534,372
流動資産合計	567,748,666	536,976,194
資産合計	567,748,666	536,976,194
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	1,157,528,386	1,157,551,219
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	589,779,720	620,575,025
元本等合計	567,748,666	536,976,194
純資産合計	567,748,666	536,976,194
負債純資産合計	567,748,666	536,976,194

[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28年 3月29日 至 平成28年 9月27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	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28年 3月28日現在	平成28年 9月27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	1,157,528,386円	1,157,528,386円
期中追加設定元本額	-	22,833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	1,157,528,386円	1,157,551,219円
合計	1,157,528,386円	1,157,551,219円
2. 受益権の総数	1,157,528,386口	1,157,551,219口
3. 元本の欠損	589,779,720円	620,575,025円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 3月29日 至 平成28年 9月27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28年 9月27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28年3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	78,620,500
合計	78,620,500

「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28年3月28日まで)を指しております。

(平成28年9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	26,861,282
合計	26,861,282

「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28年3月29日から平成28年9月27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28年3月28日現在)

該当事項はありません。

(平成28年9月27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28年3月29日 至 平成28年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成28年3月28日現在	平成28年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.4905円 「1口 = 1円(10,000口 = 4,905円)」	1口当たり純資産額 0.4639円 「1口 = 1円(10,000口 = 4,639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 10/20/17	5,600,000.000	5,232,864.000	
	小計(アメリカ・ドル) 1銘柄		5,600,000.000	5,232,864.000 (524,960,917)	
合計				524,960,917 (524,960,917)	

(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	97.76%	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 1」に従って認可されています。

同ファンドの2016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、2016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

2016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
	USD	USD	USD
資 産			
有価証券（取得原価）	1,281,307,142	1,580,974,595	254,693,661
評価（損）益	77,869,393	(29,114,994)	7,384,115
有価証券（時価）	1,359,176,535	1,551,859,601	262,077,776
TBA取引（時価）	-	-	26,475,713
現金預金	31,753,723	116,384,839	35,630,118
有価証券売却に係る未収入金	3,648,973	3,573,901	6,025,175
未収配当金および未収利息	3,674,756	27,165,300	1,416,980
発行未収金	77,211,901	4,596,430	590,646
為替予約取引に係る評価益	199,587	7,250,669	467,890
オプション（時価）	-	-	-
先物取引に係る評価益	-	-	308,563
スワップ契約（時価）	-	1,097,646	-
委託証拠金	-	-	-
その他の資産	116,169	3,772	2,240
資産 合計	1,475,785,644	1,711,932,158	332,995,101
負 債			
外国税引当金	-	-	-
有価証券購入に係る未払金	68,973,905	6,748,505	35,188,700
買戻未払金	831,323	10,374,242	439,740
為替予約取引に係る評価損	18,115	9,896,104	850,912
未払運用報酬	1,044,927	1,253,766	78,808
未払分配金	-	-	-
オプション（時価）	-	-	-
スワップ契約（時価）	-	1,087,042	-
委託証拠金	-	-	23,522

先物取引に係る評価損	-	-	263,382
当座貸越	3,340,622	-	-
その他の負債	334,378	402,162	61,465
負債 合計	74,543,270	29,761,821	36,876,529
純資産	1,401,242,374	1,682,170,337	296,118,572

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

2016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
	USD	USD	USD
収益			
受取利息（源泉税控除後）	19,988	50,459,058	3,116,127
受取配当金（源泉税控除後）	12,160,608	284,008	1,531
スワップに係る利息	-	74,513	-
収益 合計	12,180,596	50,817,579	3,117,658
費用			
運用報酬	5,811,277	6,965,826	352,611
カストディーフィー	236,407	96,766	11,066
管理会社報酬	124,638	164,967	36,002
専門家報酬	107,956	94,955	21,784
年次税	98,900	313,139	22,868
スワップに係る利息	-	408,565	-
支払利息	41	1,895	10
その他の費用	20,205	19,249	1,581
費用 合計	6,399,424	8,065,362	445,922
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	5,781,172	42,752,217	2,671,736
運用会社により免除または負担された費用	13,504	24,512	14,947
投資（損）益 合計	5,794,676	42,776,729	2,686,683
実現（損）益の内訳：			
スイング・プライシング	386,904	556,983	36,568
有価証券(外国税控除後)	(16,521,404)	(33,821,160)	1,314
TBA取引	-	-	358,242
為替予約取引	64,784	4,178,227	759,244
先物取引	-	-	(260,960)
オプション	-	63,000	-
スワップ	-	322,848	-
外貨取引	(108,066)	1,065,504	(477,362)

実現(損)益 合計	(16,177,782)	(27,634,598)	417,046
評価(損)益の内訳:			
有価証券(外国税控除後)	125,804,124	88,358,891	8,729,628
TBA取引	-	-	254,550
為替予約取引	181,472	8,943,277	(126,709)
先物取引	-	-	(19,862)
オプション	-	(34,358)	-
スワップ	-	(71,788)	-
外貨建のその他の資産および負債	(246,051)	371	-
評価(損)益 合計	125,739,545	97,196,393	8,837,607
運用による純資産の純増(減)額	115,356,439	112,338,524	11,941,336
分配金:			
分配による純資産の減少額	(40,991)	(5,075,399)	(709,695)
資本取引:			
投資証券発行受領額	200,072,104	420,740,868	134,465,657
投資証券買戻支払額	(56,090,608)	(284,678,198)	(26,145,134)
資本取引による純資産の純増(減)額	143,981,496	136,062,670	108,320,523
純資産の増(減)額 合計	259,296,944	243,325,795	119,552,164
期首現在純資産	1,141,945,430	1,438,844,542	176,566,408
換算調整	-	-	-
期末現在純資産	1,401,242,374	1,682,170,337	296,118,572

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

2016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)	USD	USD	USD
クラスJd			
期首現在発行済投資証券	833,531	5,827,586	4,877,969
発行投資証券口数	6,242	391,397	297,472
買戻投資証券口数	(98,440)	(608,492)	(495,015)
期末現在発行済投資証券	741,333	5,610,491	4,680,426

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)	USD	USD	USD

以下の時点のクラスJd証券一口当たり純資産額:

2016年 6月30日	6.92	9.40	11.14
2015年12月31日	6.35	9.05	10.71
2014年12月31日	7.23	9.93	10.92

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

2016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 USD	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				
アルゼンチン				
MercadoLibre, Inc.	USD	66,500	9,237,515	0.66
Tenaris SA, ADR	USD	189,400	5,422,522	0.39
			14,660,037	1.05
ブラジル				
Ambev SA, ADR	USD	1,091,700	6,408,279	0.46
Banco Bradesco SA Preference	BRL	1,704,221	13,182,054	0.94
BR Maltis Participacoes SA	BRL	1,991,790	7,969,889	0.57
BRF SA	BRL	391,912	5,389,187	0.38
Itau Unibanco Holding SA Preference	BRL	5,195,695	47,921,930	3.42
Lojas Renner SA	BRL	6,588,100	47,676,230	3.40
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	BRL	258,074	4,835,372	0.35
Rais Drogasil SA	BRL	837,200	16,178,810	1.15
			149,561,751	10.67
チリ				
Banco Santander Chile, ADR	USD	541,481	10,331,458	0.74
SACI Falabella	CLP	1,179,148	8,985,205	0.64
			19,316,663	1.38
中国				
58.com, Inc., ADR	USD	118,700	5,508,867	0.39
Alibaba Group Holding Ltd., ADR	USD	267,163	21,031,071	1.50
Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'H'	HKD	1,957,000	4,676,502	0.33
BAIC Motor Corp. Ltd. 'H'	HKD	4,104,000	2,881,275	0.21
Baidu, Inc., ADR	USD	184,600	30,006,730	2.14
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	HKD	1,718,500	9,697,285	0.69
China Longyuan Power Group Corp. Ltd. 'H'	HKD	7,150,000	5,894,089	0.42
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	HKD	7,288,000	12,655,572	0.90
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	HKD	837,600	2,814,488	0.20
China Vanke Co. Ltd. 'A' **	CNY	2,619,883	6,135,289	0.44
China Vanke Co. Ltd. 'H'	HKD	999,050	1,950,772	0.14
CNOOC Ltd.	HKD	5,701,000	7,058,844	0.50
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	HKD	8,054,000	7,155,113	0.51
Dongfeng Motor Group Co. Ltd. 'H'	HKD	3,476,000	3,609,776	0.26
Hengan International Group Co. Ltd.	HKD	2,314,500	19,253,742	1.38
Huaneng Renewables Corp. Ltd. 'H'	HKD	16,606,000	5,482,824	0.39
Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A' **	CNY	173,815	7,639,529	0.55
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'A' **	CNY	386,200	1,863,177	0.13
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	HKD	4,111,100	18,030,655	1.29
Qinjin Foodstuffs Group Cayman Co. Ltd.	HKD	432,600	585,431	0.04
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	HKD	2,211,000	7,729,955	0.55
Tencent Holdings Ltd.	HKD	3,254,900	73,686,953	5.26
Vipshop Holdings Ltd., ADR	USD	810,100	8,805,787	0.63
Want Want China Holdings Ltd.	HKD	1,043,000	736,246	0.05
			264,889,972	18.90
コロンビア				
Grupo Aval Acciones y Valores SA, ADR Preference	USD	765,600	6,109,488	0.44
			6,109,488	0.44

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
香港				
AIA Group Ltd.	HKD	6,863,400	40,904,576	2.92
ASM Pacific Technology Ltd.	HKD	681,800	4,864,894	0.35
Techtronic Industries Co. Ltd.	HKD	910,000	3,780,698	0.27
			49,550,168	3.54
インド				
Axis Bank Ltd.	INR	2,405,650	18,924,093	1.35
Container Corp. Of India Ltd.	INR	317,371	6,707,294	0.48
Glenmark Pharmaceuticals Ltd.	INR	571,105	6,749,880	0.48
HDFC Bank Ltd.	INR	259,759	5,226,347	0.37
Housing Development Finance Corp. Ltd.	INR	1,304,369	24,139,808	1.72
ICI Bank Ltd.	INR	3,228,461	11,442,835	0.82
Infosys Ltd.	INR	2,106,671	36,496,606	2.61
Maruti Suzuki India Ltd.	INR	145,838	9,020,363	0.64
NTPC Ltd.	INR	3,150,264	7,279,857	0.52
Power Grid Corp. of India Ltd.	INR	3,448,378	8,311,560	0.59
Tata Consultancy Services Ltd.	INR	226,758	8,556,239	0.61
Tata Motors Ltd.	INR	2,009,344	13,566,541	0.97
Yes Bank Ltd.	INR	375,025	6,126,584	0.44
			162,548,007	11.60
インドネシア				
Astra International Tbk. PT	IDR	27,408,400	15,321,692	1.09
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	17,165,000	17,294,764	1.24
Matahari Department Store Tbk. PT	IDR	5,532,800	8,371,809	0.60
			40,988,265	2.93
マレーシア				
Astro Malaysia Holdings Bhd.	MYR	7,572,000	5,508,795	0.39
			5,508,795	0.39
メキシコ				
Fresnillo plc	GBP	690,832	14,880,737	1.06
Grupo Financiero Santander Mexico SAB de CV. ADR	USD	1,297,100	11,557,161	0.82
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	MXN	8,784,340	21,116,361	1.51
			47,554,259	3.39
フィリピン				
BDO Unibank, Inc.	PHP	3,769,930	8,965,572	0.64
GT Capital Holdings, Inc.	PHP	318,615	9,746,967	0.70
SM Investments Corp.	PHP	786,182	16,150,501	1.15
Universal Robina Corp.	PHP	4,536,820	20,041,939	1.43
			54,904,979	3.92
ロシア				
Magnit PJSC, GDR	USD	879,298	28,893,732	2.06
Sberbank of Russia PJSC, ADR	USD	3,833,635	33,337,290	2.38
Yandex NV 'A'	USD	219,400	4,703,936	0.34
			66,934,958	4.78
南アフリカ				
Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	ZAR	789,488	19,559,164	1.40
FirstRand Ltd.	ZAR	4,907,628	14,999,583	1.07
Mr Price Group Ltd.	ZAR	514,900	7,200,745	0.51
Naspers Ltd. 'N'	ZAR	75,998	11,605,836	0.83
Sanlam Ltd.	ZAR	3,500,526	14,499,945	1.03
Shoptite Holdings Ltd.	ZAR	1,546,344	17,598,801	1.26
Woolworths Holdings Ltd.	ZAR	3,381,862	19,351,188	1.38
			104,815,262	7.48
韓国				
Hyundai Glovis Co. Ltd.	KRW	18,318	2,728,060	0.19
Hyundai Motor Co.	KRW	130,274	15,326,016	1.09
LG Household & Health Care Ltd.	KRW	34,775	33,736,787	2.41

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
NAVER Corp.	KRW	23,433	14,444,323	1.03
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	37,409	46,299,062	3.30
Samsung Electronics Co. Ltd. Preference	KRW	3,355	3,446,633	0.25
SK Hynix, Inc.	KRW	546,189	15,369,112	1.10
			131,349,993	9.37
台湾				
Catcher Technology Co. Ltd.	TWD	3,040,000	22,344,472	1.60
China Life Insurance Co. Ltd.	TWD	1,672,400	1,289,246	0.09
Delta Electronics, Inc.	TWD	1,643,268	7,934,211	0.57
Largan Precision Co. Ltd.	TWD	139,000	12,662,498	0.90
Quanta Computer, Inc.	TWD	3,936,000	7,433,495	0.53
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	10,047,050	50,516,325	3.61
Uni-President Enterprises Corp.	TWD	13,214,783	25,977,279	1.85
			128,157,526	9.15
タイ				
CP ALL PCL	THB	8,065,400	11,537,745	0.82
Kasikornbank PCL, NVDR	THB	3,149,000	15,197,767	1.09
Siam Cement PCL (The), NVDR	THB	634,150	8,574,233	0.61
			35,309,745	2.52
トルコ				
BIM Birlesik Magazalar A/S	TRY	808,255	15,649,521	1.12
Türkiye Garanti Bankası A/S	TRY	4,391,941	11,541,311	0.82
			27,190,832	1.94
アラブ首長国連邦				
DP World Ltd.	USD	730,583	12,120,372	0.86
Emaar Malls Group PJSC	AED	7,918,135	6,079,265	0.43
First Gulf Bank PJSC	AED	2,190,403	7,514,042	0.54
			25,713,679	1.83
イギリス				
SABMiller plc	ZAR	413,398	24,112,156	1.72
			24,112,156	1.72
株式 計			1,359,176,535	97.00
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			1,359,176,535	97.00
有価証券 計			1,359,176,535	97.00

為替予約取引

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	決済日	取引相手先	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)
ZAR	82,181,888	USD	5,383,522	05/07/2016	J.P. Morgan	199,587	0.01
為替予約取引にかかる評価益 計						199,587	0.01
USD	707,246	ZAR	10,674,960	01/07/2016	Barclays	(18,115)	-
為替予約取引にかかる評価(損) 計						(18,115)	-
為替予約取引にかかる評価(損) 益 計						181,472	0.01

現金	28,417,101	2.03
その他資産(負債)	13,648,739	0.97
純資産 計	1,401,242,374	100.00

国別投資比率

	純資産比率 (%)
中国	18.90
インド	11.60
ブラジル	10.67
韓国	9.37
台湾	9.15
南アフリカ	7.48
ロシア	4.78
フィリピン	3.92
香港	3.54
メキシコ	3.39
インドネシア	2.93
タイ	2.52
トルコ	1.94
アラブ首長国連邦	1.83
イギリス	1.72
チリ	1.38
アルゼンチン	1.05
コロンビア	0.44
マレーシア	0.39
有価証券 計	97.00
現金及びその他資産（負債）	3.00
合計	100.00

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。

*純資産比率は、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

2016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 USD	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				
アルゼンチン				
YPF SA, 144A 8.5% 23/03/2021	USD	10,590,000	11,360,952	0.68
			11,360,952	0.68
オーストリア				
Erste Group Bank AG, Reg. S, FRN 8.875% Perpetual	EUR	1,800,000	1,957,051	0.12
			1,957,051	0.12
ブラジル				
Minerva Luxembourg SA, 144A 7.75% 31/01/2023	USD	3,975,000	4,062,848	0.24
Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/05/2021	USD	7,975,000	8,226,213	0.49
Vale Overseas Ltd. 5.875% 10/06/2021	USD	3,650,000	3,658,121	0.22
Vale Overseas Ltd. 4.375% 11/01/2022	USD	775,000	726,004	0.04
Vale Overseas Ltd. 6.875% 21/11/2036	USD	5,150,000	4,725,228	0.28
			21,398,414	1.27
カナダ				
Alberta Energy Co. Ltd. 8.125% 15/09/2030	USD	615,000	685,129	0.04
Alberta Energy Co. Ltd. 7.375% 01/11/2031	USD	1,455,000	1,541,631	0.09
Cenovus Energy, Inc. 6.75% 15/11/2039	USD	3,445,000	3,595,891	0.22
Encana Corp. 6.5% 15/05/2019	USD	4,775,000	5,073,437	0.3
Encana Corp. 7.2% 01/11/2031	USD	3,115,000	3,199,011	0.19
Entertainment One Ltd., Reg. S 6.875% 15/12/2022	GBP	3,000,000	4,086,680	0.24
HudBay Minerals, Inc. 9.5% 01/10/2020	USD	8,925,000	7,497,000	0.45
Teck Resources Ltd. 6% 15/08/2040	USD	1,475,000	1,017,750	0.06
Teck Resources Ltd. 6.25% 15/07/2041	USD	1,975,000	1,401,855	0.08
			28,098,384	1.67
中国				
Nord Anglia Education Finance LLC, Reg. S 5.75% 15/07/2022	CHF	1,725,000	1,805,041	0.11
			1,805,041	0.11
コロンビア				
Pacific Exploration and Production Corp., Reg. S 5.375% 26/01/2019	USD	8,350,000	1,586,500	0.09
			1,586,500	0.09
フランス				
CGG SA 6.5% 01/06/2021	USD	350,000	155,750	0.01
CGG SA 6.875% 15/01/2022	USD	7,000,000	2,940,000	0.18
ContourGlobal Power Holdings SA, Reg. S 5.125% 15/06/2021	EUR	4,225,000	4,667,043	0.28
Credit Agricole SA, FRN, 144A 6.625% Perpetual	USD	4,200,000	3,825,444	0.23
Horizon Holdings I SASU, Reg. S 7.25% 01/08/2023	EUR	3,200,000	3,699,058	0.22
Loxam SAS, Reg. S 7% 23/07/2022	EUR	4,000,000	4,758,619	0.28
Numericable-SFR SA, 144A 7.375% 01/05/2026	USD	4,450,000	4,362,335	0.26
Numericable-SFR SA, Reg. S 6.25% 15/05/2024	USD	4,990,000	4,760,460	0.28
Synlab Bondco plc, Reg. S 6.25% 01/07/2022	EUR	3,200,000	3,766,574	0.22
Synlab Unsecured Bondco plc, Reg. S 8.25% 01/07/2023	EUR	1,600,000	1,816,322	0.11
			34,751,605	2.07

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
ドイツ				
Douglas GmbH, Reg. S 6.25% 15/07/2022	EUR	1,470,000	1,750,835	0.1
Garfunkelux Holdco 3 SA, Reg. S 7.5% 01/08/2022	EUR	2,500,000	2,732,203	0.16
Garfunkelux Holdco 3 SA, Reg. S 8.5% 01/11/2022	GBP	1,075,000	1,376,169	0.08
Kirk Beauty One GmbH, Reg. S 8.75% 15/07/2023	EUR	1,975,000	2,339,502	0.14
Pfleiderer GmbH, Reg. S 7.875% 01/08/2019	EUR	3,400,000	3,914,979	0.23
Safari Holding Verwaltungs GmbH, Reg. S 8.25% 15/02/2021	EUR	1,925,000	2,261,100	0.14
			14,374,788	0.85
ギリシャ				
OTE plc, Reg. S 7.875% 07/02/2018	EUR	3,225,000	3,841,279	0.23
			3,841,279	0.23
インドネシア				
TBG Global Pte. Ltd., Reg. S 5.25% 10/02/2022	USD	1,825,000	1,862,746	0.11
			1,862,746	0.11
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance plc, 144A 6.75% 31/01/2021	USD	1,650,000	1,670,625	0.1
Ardagh Packaging Finance plc, 144A 7.25% 15/05/2024	USD	2,875,000	2,954,062	0.17
			4,624,687	0.27
イタリア				
Bormioli Rocco Holdings SA, Reg. S 10% 01/08/2018	EUR	4,000,000	4,540,982	0.27
International Game Technology plc, 144A 6.25% 15/02/2022	USD	4,525,000	4,637,220	0.27
International Game Technology plc, 144A 6.5% 15/02/2025	USD	3,675,000	3,692,769	0.22
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 8% Perpetual	USD	1,800,000	1,457,892	0.09
Wind Acquisition Finance SA, Reg. S 7.375% 23/04/2021	USD	8,350,000	7,964,230	0.47
			22,293,093	1.32
カザフスタン				
Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC, Reg. S 7.25% 03/05/2017	USD	495,000	511,432	0.03
Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC, Reg. S 7.25% 28/01/2021	USD	640,000	678,211	0.04
			1,189,643	0.07
ルクセンブルグ				
Alice Financing SA, 144A 7.5% 15/05/2026	USD	3,600,000	3,514,158	0.21
Alice Financing SA, Reg. S 6.5% 15/01/2022	USD	6,400,000	6,374,656	0.38
Alice Finco SA, 144A 8.125% 15/01/2024	USD	4,475,000	4,351,893	0.26
Alice Luxembourg SA, Reg. S 7.75% 15/05/2022	USD	10,275,000	10,390,594	0.62
ArcelorMittal 10.85% 01/06/2019	USD	1,975,000	2,324,792	0.14
Intralot Finance Luxembourg SA, Reg. S 9.75% 15/08/2018	EUR	4,225,000	4,947,317	0.29
LSF9 Balta Issuer SA, Reg. S 7.75% 15/09/2022	EUR	3,000,000	3,531,647	0.21
Millicom International Cellular SA, Reg. S 6.625% 15/10/2021	USD	1,200,000	1,233,408	0.07
Swissport Investments SA, Reg. S 6.75% 15/12/2021	EUR	575,000	658,567	0.04
			37,327,032	2.22

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
オランダ				
LGE HoldCo VI BV, Reg. S 7.125% 15/05/2024	EUR	3,300,000	4,061,556	0.24
Lincoln Finance Ltd., Reg. S 6.875% 15/04/2021	EUR	10,000,000	11,932,510	0.71
Nyrstar Netherlands Holdings BV, Reg. S 8.5% 15/09/2019	EUR	4,525,000	5,088,747	0.30
UPC Holding BV, Reg. S 6.75% 15/03/2023	CHF	1,900,000	2,096,916	0.13
UPC Holding BV, Reg. S 6.75% 15/03/2023	EUR	3,625,000	4,333,574	0.26
			27,513,303	1.64
ロシア				
Gazprom OAO, Reg. S 9.25% 23/04/2019	USD	2,800,000	3,238,676	0.19
VimpelCom Holdings BV, Reg. S 5.2% 13/02/2019	USD	1,675,000	1,730,978	0.11
			4,969,654	0.30
セルビア				
United Group BV, Reg. S 7.875% 15/11/2020	EUR	4,540,000	5,324,397	0.32
			5,324,397	0.32
スペイン				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S, FRN 7% Perpetual	EUR	5,800,000	5,573,455	0.33
Banco Santander SA, Reg. S, FRN 6.375% Perpetual	USD	5,600,000	4,921,056	0.29
Cirsa Funding Luxembourg SA, 144A 5.75% 15/05/2021	EUR	1,500,000	1,697,432	0.10
Cirsa Funding Luxembourg SA, Reg. S 5.875% 15/05/2023	EUR	2,475,000	2,787,186	0.17
			14,979,129	0.89
スイス				
SIG Combibloc Holdings SCA, Reg. S 7.75% 15/02/2023	EUR	7,650,000	8,986,055	0.54
Transocean, Inc. 6% 15/03/2018	USD	1,544,000	1,567,160	0.09
Transocean, Inc. 8.125% 15/12/2021	USD	1,275,000	1,079,256	0.06
			11,632,471	0.69
イギリス				
Arqiva Broadcast Finance plc, Reg. S 9.5% 31/03/2020	GBP	7,325,000	10,524,004	0.63
HCBC Holdings plc, FRN 6.875% Perpetual	USD	2,115,000	2,116,058	0.13
Infinis plc, Reg. S 7% 15/02/2019	GBP	2,700,000	3,669,304	0.22
Matalan Finance plc, Reg. S 6.875% 01/06/2019	GBP	815,000	850,509	0.05
Mitzen Bondco Ltd., Reg. S 7% 01/05/2021	GBP	1,988,700	2,570,193	0.15
New Look Secured Issuer plc, Reg. S 6.5% 01/07/2022	GBP	2,325,000	2,882,701	0.17
New Look Senior Issuer plc, Reg. S 8% 01/07/2023	GBP	1,210,000	1,417,687	0.08
Royal Bank of Scotland Group plc 6.125% 15/12/2022	USD	1,110,000	1,165,833	0.07
Virgin Media Finance plc, Reg. S 7% 15/04/2023	GBP	2,750,000	3,780,822	0.22
Virgin Media Secured Finance plc, Reg. S 6.25% 28/03/2029	GBP	150,000	198,838	0.01
			29,175,949	1.73
アメリカ				
AES Corp. 5.5% 15/03/2024	USD	4,575,000	4,681,735	0.28
AES Corp. 6% 15/05/2026	USD	2,050,000	2,073,493	0.12
AGCO Corp. 5.875% 01/12/2021	USD	3,000,000	3,273,990	0.19

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Aircastle Ltd. 5.5% 15/02/2022	USD	2,225,000	2,328,285	0.14
Alliance Data Systems Corp., Reg. S 5.25% 15/11/2023	EUR	4,300,000	4,705,244	0.28
Ally Financial, Inc. 5.125% 30/09/2024	USD	725,000	738,964	0.04
Ally Financial, Inc. 5.75% 20/11/2025	USD	3,025,000	3,030,899	0.18
Ally Financial, Inc. 8% 01/11/2031	USD	6,125,000	7,110,145	0.42
AMC Entertainment, Inc. 5.75% 15/06/2025	USD	6,625,000	6,570,907	0.39
Anadarko Petroleum Corp. 8.7% 15/03/2019	USD	995,000	1,133,559	0.07
Ball Corp. 4% 15/11/2023	USD	550,000	541,150	0.03
Boardwalk Pipelines LP 4.95% 15/12/2024	USD	1,630,000	1,609,625	0.10
Boardwalk Pipelines LP 5.95% 01/06/2026	USD	1,270,000	1,325,512	0.08
Boise Cascade Co. 6.375% 01/11/2020	USD	4,700,000	4,817,500	0.29
Calpine Corp. 5.375% 15/01/2023	USD	3,225,000	3,134,281	0.19
CenturyLink, Inc. 7.5% 01/04/2024	USD	6,025,000	6,028,615	0.36
CNO Financial Group, Inc. 5.25% 30/05/2025	USD	3,750,000	3,871,875	0.23
Concho Resources, Inc. 7% 15/01/2021	USD	3,250,000	3,376,084	0.20
Concho Resources, Inc. 6.5% 15/01/2022	USD	475,000	488,661	0.03
Concho Resources, Inc. 5.5% 01/10/2022	USD	675,000	683,363	0.04
Concho Resources, Inc. 5.5% 01/04/2023	USD	8,200,000	8,248,790	0.49
Continental Resources, Inc. 4.9% 01/06/2044	USD	2,875,000	2,355,761	0.14
CoreLogic, Inc. 7.25% 01/06/2021	USD	1,575,000	1,634,757	0.10
Crown Cork & Seal Co., Inc. 7.375% 15/12/2026	USD	250,000	276,344	0.02
DCP Midstream Operating LP 5.6% 01/04/2044	USD	475,000	408,500	0.02
Devon Energy Corp. 7.95% 15/04/2032	USD	1,300,000	1,496,111	0.09
Devon Financing Co. LLC 7.875% 30/09/2031	USD	325,000	379,005	0.02
Dynegy, Inc. 6.75% 01/11/2019	USD	3,500,000	3,496,377	0.21
Energy Transfer Partners LP 9.7% 15/03/2019	USD	935,000	1,065,937	0.06
Energy Transfer Partners LP 9% 15/04/2019	USD	2,699,000	3,035,012	0.18
EQT Corp. 8.125% 01/06/2019	USD	725,000	798,840	0.05
Freeport-McMoRan, Inc. 2.375% 15/03/2018	USD	2,350,000	2,296,549	0.14
Freeport-McMoRan, Inc. 3.1% 15/03/2020	USD	1,150,000	1,079,022	0.06
Freeport-McMoRan, Inc. 4% 14/11/2021	USD	1,625,000	1,473,916	0.09
Freeport-McMoRan, Inc. 5.4% 14/11/2034	USD	2,275,000	1,820,000	0.11
Graphic Packaging International, Inc. 4.75% 15/04/2021	USD	1,775,000	1,867,460	0.11
Group 1 Automotive, Inc. 5% 01/06/2022	USD	2,000,000	1,978,760	0.12
HCA, Inc. 5% 15/03/2024	USD	7,050,000	7,276,270	0.43
HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	275,000	281,944	0.02
HCA, Inc. 5.25% 15/06/2026	USD	6,900,000	7,169,583	0.43
Hess Corp. 8.125% 15/02/2019	USD	380,000	424,538	0.03
Hess Corp. 7.875% 01/10/2029	USD	6,615,000	7,905,573	0.47
Hess Corp. 7.3% 15/08/2031	USD	900,000	1,027,084	0.06
Hess Corp. 7.125% 15/03/2033	USD	375,000	421,286	0.02
Hess Corp. 6% 15/01/2040	USD	925,000	963,263	0.06

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
HRG Group, Inc. 7.875% 15/07/2019	USD	3,450,000	3,612,944	0.21
Huntsman International LLC 4.875% 15/11/2020	USD	350,000	352,868	0.02
Intelsat Jackson Holdings SA 7.25% 15/10/2020	USD	1,825,000	1,306,016	0.08
Intelsat Jackson Holdings SA 7.5% 01/04/2021	USD	4,250,000	2,868,750	0.17
JC Penney Corp., Inc. 8.125% 01/10/2019	USD	3,725,000	3,841,071	0.23
Joseph T Ryerson & Son, Inc. 11.25% 15/10/2018	USD	132,000	126,060	0.01
Kosmos Energy Ltd., 144A 7.875% 01/08/2021	USD	3,650,000	3,540,500	0.21
Level 3 Communications, Inc. 5.75% 01/12/2022	USD	3,375,000	3,415,770	0.20
Level 3 Financing, Inc. 5.625% 01/02/2023	USD	3,650,000	3,692,358	0.22
LIN Television Corp. 5.875% 15/11/2022	USD	2,425,000	2,449,250	0.15
Matador Resources Co. 6.875% 15/04/2023	USD	5,475,000	5,584,500	0.33
Men's Wearhouse, Inc. (The) 7% 01/07/2022	USD	10,175,000	8,496,125	0.51
MGM Resorts International 6.625% 15/12/2021	USD	4,780,000	5,187,925	0.31
MGM Resorts International 6% 15/03/2023	USD	5,325,000	5,629,830	0.33
MPG Holdco I, Inc. 7.375% 15/10/2022	USD	4,100,000	4,054,552	0.24
MPT Operating Partnership LP, REIT 6.875% 01/05/2021	USD	2,450,000	2,531,156	0.15
MPT Operating Partnership LP, REIT 6.375% 01/03/2024	USD	2,125,000	2,273,750	0.14
Nationstar Mortgage LLC 7.875% 01/10/2020	USD	875,000	824,688	0.05
Nationstar Mortgage LLC 6.5% 01/07/2021	USD	4,450,000	3,855,970	0.23
New Albertsons, Inc. 7.45% 01/08/2029	USD	1,625,000	1,586,406	0.09
New Albertsons, Inc. 8% 01/05/2031	USD	950,000	947,625	0.06
Newfield Exploration Co. 5.75% 30/01/2022	USD	3,625,000	3,658,477	0.22
Newfield Exploration Co. 5.375% 01/01/2026	USD	1,600,000	1,559,256	0.09
Noble Energy, Inc. 8.25% 01/03/2019	USD	290,000	331,805	0.02
NuStar Logistics LP 4.8% 01/09/2020	USD	400,000	390,610	0.02
Ocwen Financial Corp. 6.625% 15/05/2019	USD	4,625,000	3,121,875	0.19
Penske Automotive Group, Inc. 5.75% 01/10/2022	USD	3,600,000	3,604,824	0.21
Penske Automotive Group, Inc. 5.5% 15/05/2026	USD	1,600,000	1,543,712	0.09
Post Holdings, Inc. 7.375% 15/02/2022	USD	4,100,000	4,317,197	0.26
Pride International, Inc. 8.5% 15/06/2019	USD	2,545,000	2,624,811	0.16
Pride International, Inc. 6.875% 15/08/2020	USD	115,000	109,831	0.01
QEP Resources, Inc. 6.875% 01/03/2021	USD	1,775,000	1,806,302	0.11
QEP Resources, Inc. 5.25% 01/05/2023	USD	800,000	736,968	0.04
Range Resources Corp. 4.875% 15/05/2025	USD	4,425,000	4,231,406	0.25
Regal Entertainment Group 5.75% 15/03/2022	USD	4,925,000	5,056,793	0.30
Reynolds Group Issuer, Inc. 5.75% 15/10/2020	USD	2,000,000	2,057,800	0.12

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Rowan Cos., Inc. 7.875% 01/08/2019	USD	3,445,000	3,577,030	0.21
SESI LLC 7.125% 15/12/2021	USD	8,700,000	8,417,250	0.50
SM Energy Co. 6.5% 01/01/2023	USD	4,790,000	4,454,700	0.26
Southwestern Energy Co. 7.5% 01/02/2018	USD	4,050,000	4,333,500	0.26
Southwestern Energy Co. 4.05% 23/01/2020	USD	2,750,000	2,687,286	0.16
Southwestern Energy Co. 4.95% 23/01/2025	USD	550,000	528,503	0.03
Springleaf Finance Corp. 8.25% 15/12/2020	USD	3,350,000	3,345,109	0.20
Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	USD	17,448,000	14,989,402	0.89
Tempur Sealy International, Inc. 5.625% 15/10/2023	USD	6,175,000	6,367,351	0.38
Tenet Healthcare Corp. 8.125% 01/04/2022	USD	1,700,000	1,741,990	0.10
Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	USD	4,650,000	4,475,741	0.27
Terex Corp. 6% 15/05/2021	USD	3,200,000	3,186,016	0.19
Tesoro Logistics LP 6.125% 15/10/2021	USD	875,000	911,789	0.05
TransDigm, Inc. 6.5% 15/07/2024	USD	1,900,000	1,924,833	0.11
TransDigm, Inc. 6.5% 15/05/2025	USD	1,575,000	1,584,844	0.09
Tribune Media Co. 5.875% 15/07/2022	USD	5,775,000	5,743,988	0.34
United Continental Holdings, Inc. 6% 01/12/2020	USD	3,300,000	3,469,488	0.21
VEREIT Operating Partnership LP, REIT 4.125% 01/06/2021	USD	1,375,000	1,392,187	0.08
Water Investment Management Corp. 7.875% 15/12/2021	USD	1,985,000	982,575	0.06
William Lyon Homes, Inc. 7% 15/08/2022	USD	3,800,000	3,781,000	0.22
WPX Energy, Inc. 5.25% 15/01/2017	USD	2,325,000	2,353,725	0.14
WPX Energy, Inc. 7.5% 01/08/2020	USD	4,550,000	4,504,500	0.27
Zayo Group LLC 6.375% 15/05/2025	USD	1,525,000	1,572,184	0.09
			306,359,361	18.33
債券 計			588,425,479	34.98
株式				
アルゼンチン				
YPF SA, ADR	USD	120,975	2,352,964	0.14
			2,352,964	0.14
オランダ				
Alice NV 'A'	EUR	37,779	566,954	0.04
Alice NV 'B'	EUR	12,593	189,755	0.01
			756,709	0.05
イギリス				
Liberty Global plc	USD	22,800	648,660	0.04
Liberty Global plc LILAC 'C'	USD	2,844	92,146	-
			740,806	0.04
アメリカ				
Allergan plc Preference 5.5%	USD	3,829	3,163,137	0.19
American Tower Corp., REIT Preference 5.25%	USD	12,240	1,361,945	0.08
American Tower Corp., REIT Preference 5.5%	USD	10,453	1,163,001	0.07
Crown Castle International Corp., REIT Preference 4.5%	USD	14,950	1,786,674	0.11
First Data Corp. 'A'	USD	94,000	1,031,180	0.06
Howard Hughes Corp. (The)	USD	15,375	1,722,000	0.10
Lands' End, Inc.	USD	1,375	23,072	-
Liberty Broadband Corp. 'C'	USD	28,825	1,714,511	0.10
NRG Energy, Inc.	USD	113,828	1,641,400	0.10

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Rowan Cos. plc 'A'	USD	145,975	2,516,609	0.15
T-Mobile US, Inc.	USD	80,200	3,479,878	0.21
T-Mobile US, Inc. Preference 5.5%	USD	12,341	907,187	0.05
			20,510,594	1.22
株式 計			24,361,073	1.45
フロント				
カナダ				
Pacific Exploration and Production Corp. 31/08/2016*	CAD	21,600	69,120	-
			69,120	-
フロント 計			69,120	-
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			612,855,672	36.43

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	826,000	854,910	0.05
BlueScope Steel Finance Ltd., 144A 6.5% 15/05/2021	USD	4,275,000	4,441,725	0.26
FMG Resources August 2006 Pty. Ltd., 144A 9.75% 01/03/2022	USD	10,500,000	11,518,027	0.69
James Hardie International Finance Ltd., 144A 5.875% 15/02/2023	USD	2,300,000	2,363,250	0.14
			19,177,912	1.14

ベルギー

Barry Callebaut Services NV, Reg. S 5.5% 15/06/2023	USD	9,900,000	10,725,017	0.64
			10,725,017	0.64

カナダ

1011778 BC ULC, 144A 4.625% 15/01/2022	USD	2,350,000	2,381,267	0.14
Air Canada, 144A 6.75% 01/10/2019	USD	475,000	493,501	0.03
Air Canada, Reg. S 7.75% 15/04/2021	USD	3,150,000	3,283,875	0.20
Bombardier, Inc., 144A 7.5% 15/03/2018	USD	7,075,000	7,302,921	0.43
Cascades, Inc., 144A 5.5% 15/07/2022	USD	1,275,000	1,238,344	0.07
Cascades, Inc., 144A 5.75% 15/07/2023	USD	6,250,000	6,031,250	0.36
Concordia International Corp., 144A 9.5% 21/10/2022	USD	650,000	606,125	0.04
Great Canadian Gaming Corp., 144A 6.625% 25/07/2022	CAD	4,100,000	3,236,427	0.19
Lundin Mining Corp., 144A 7.5% 01/11/2020	USD	4,300,000	4,404,275	0.26
Lundin Mining Corp., 144A 7.875% 01/11/2022	USD	975,000	999,087	0.06
Masonite International Corp., 144A 5.625% 15/03/2023	USD	1,425,000	1,485,563	0.09
Norbord, Inc., 144A 6.25% 15/04/2023	USD	2,025,000	2,080,688	0.12
Novelis, Inc. 8.75% 15/12/2020	USD	4,075,000	4,270,396	0.25
Pacific Exploration and Production Corp., Reg. S 12% 22/12/2017*	USD	864,000	760,320	0.05
Reliance Intermediate Holdings LP, 144A 6.5% 01/04/2023	USD	3,775,000	3,944,875	0.23
Seven Generations Energy Ltd., 144A 8.25% 15/05/2020	USD	11,325,000	11,792,156	0.70

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Seven Generations Energy Ltd., 144A 6.75% 01/05/2023	USD	3,025,000	3,047,687	0.18
Seven Generations Energy Ltd., Reg. S 8.25% 15/05/2020	USD	2,250,000	2,342,812	0.14
Teck Resources Ltd., 144A 8% 01/06/2021	USD	1,725,000	1,776,750	0.11
Trader Corp., 144A 9.875% 15/08/2018	USD	1,975,000	2,044,125	0.12
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 5.375% 15/03/2020	USD	3,425,000	2,941,219	0.17
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 7% 01/10/2020	USD	1,150,000	1,023,500	0.06
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 6.375% 15/10/2020	USD	7,450,000	6,415,195	0.38
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 6.75% 15/08/2021	USD	3,650,000	3,124,309	0.19
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 5.875% 15/05/2023	USD	16,550,000	13,405,500	0.80
			90,432,167	5.37
チリ				
VTR Finance BV, Reg. S 6.875% 15/01/2024	USD	2,475,000	2,480,185	0.15
			2,480,185	0.15
コロンビア				
Pacific Exploration and Production Corp., Reg. S 5.625% 19/01/2025	USD	4,275,000	811,288	0.05
			811,288	0.05
ドイツ				
Unitymedia GmbH, 144A 6.125% 15/01/2025	USD	450,000	463,455	0.03
Unitymedia GmbH, Reg. S 6.125% 15/01/2025	USD	3,525,000	3,630,398	0.21
Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG, Reg. S 5% 15/01/2025	USD	3,575,000	3,552,656	0.21
			7,646,509	0.45
香港				
Nexteer Automotive Group Ltd., Reg. S 5.875% 15/11/2021	USD	2,675,000	2,820,306	0.17
			2,820,306	0.17
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance plc, 144A 6% 30/06/2021	USD	641,000	639,398	0.04
			639,398	0.04
イスラエル				
B Communications Ltd., 144A 7.375% 15/02/2021	USD	2,375,000	2,547,829	0.15
			2,547,829	0.15
イタリア				
Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 144A 7.7% Perpetual	USD	8,100,000	7,092,401	0.42
			7,092,401	0.42
ジャマイカ				
Digicel Group Ltd., Reg. S 8.25% 30/09/2020	USD	7,750,000	6,488,222	0.38
Digicel Ltd., Reg. S 6% 15/04/2021	USD	2,275,000	1,957,137	0.12
			8,445,359	0.50
ルクセンブルグ				
Alice Luxembourg SA, 144A 7.625% 15/02/2025	USD	4,775,000	4,635,069	0.28
Ardagh Finance Holdings SA, 144A 8.375% 15/06/2019	EUR	3,880,675	4,425,083	0.26
Ardagh Finance Holdings SA, 144A 8.625% 15/06/2019	USD	3,657,780	3,703,502	0.22
Ardagh Finance Holdings SA, Reg. S 8.625% 15/06/2019	USD	2,399,214	2,429,204	0.14
			15,192,858	0.90

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
メキシコ				
Cemex Finance LLC, 144A 9.375% 12/10/2022	USD	4,000,000	4,408,340	0.26
Playa Resorts Holding BV, 144A 8% 15/08/2020	USD	625,000	631,250	0.04
Playa Resorts Holding BV, Reg. S 8% 15/08/2020	USD	2,025,000	2,045,250	0.12
			7,084,840	0.42
オランダ				
Constellium NV, 144A 7.875% 01/04/2021	USD	3,350,000	3,417,000	0.20
Sensata Technologies UK Financing Co. plc, 144A 6.25% 15/02/2026	USD	3,650,000	3,777,750	0.23
Ziggo Bond Finance BV, Reg. S 5.875% 15/01/2025	USD	1,900,000	1,833,500	0.11
			9,028,250	0.54
パナマ				
Cable International Finance Ltd., Reg. S 6.875% 01/08/2022	USD	2,350,000	2,371,902	0.14
			2,371,902	0.14
トリニダードトバゴ				
Consolidated Energy Finance SA, Reg. S 6.75% 15/10/2019	USD	4,750,000	4,488,750	0.27
			4,488,750	0.27
トルコ				
Eldorado Gold Corp., Reg. S 6.125% 15/12/2020	USD	3,525,000	3,551,437	0.21
			3,551,437	0.21
イギリス				
Ashtead Capital, Inc., Reg. S 6.5% 15/07/2022	USD	2,950,000	3,060,625	0.18
INEOS Group Holdings SA, Reg. S 6.125% 15/08/2018	USD	2,250,000	2,255,625	0.13
Iron Mountain Europe plc, REIT, Reg. S 6.125% 15/09/2022	GBP	2,175,000	2,962,112	0.18
Jaguar Land Rover Automotive plc, Reg. S 5.625% 01/02/2023	USD	2,275,000	2,371,926	0.14
Virgin Media Finance plc, 144A 6.375% 15/04/2023	USD	2,125,000	2,135,625	0.13
Virgin Media Finance plc, Reg. S 6% 15/10/2024	USD	1,900,000	1,868,422	0.11
Virgin Media Secured Finance plc, 144A 5.25% 15/01/2026	USD	1,600,000	1,546,008	0.09
Virgin Media Secured Finance plc, 144A 5.5% 15/08/2026	USD	2,500,000	2,428,250	0.15
			18,628,593	1.11
アメリカ				
24 Hour Holdings III LLC, 144A 8% 01/06/2022	USD	225,000	171,563	0.01
24 Hour Holdings III LLC, Reg. S 8% 01/06/2022	USD	2,775,000	2,115,938	0.13
Accudyne Industries Borrower, 144A 7.75% 15/12/2020	USD	3,775,000	3,350,312	0.20
Acosta, Inc., 144A 7.75% 01/10/2022	USD	2,825,000	2,507,188	0.15
ADT Corp. (The) 6.25% 15/10/2021	USD	7,375,000	7,827,235	0.47
ADT Corp. (The) 4.125% 15/06/2023	USD	1,775,000	1,668,447	0.10
AEP Industries, Inc. 8.25% 15/04/2019	USD	2,175,000	2,222,672	0.13
Albertsons Cos. LLC, 144A 6.625% 15/08/2024	USD	4,250,000	4,388,125	0.26
Alerts International, Inc. 7.875% 01/11/2020	USD	1,725,000	1,528,747	0.09
Alliance Data Systems Corp., Reg. S 5.375% 01/08/2022	USD	3,075,000	2,944,312	0.18
AMAG Pharmaceuticals, Inc., 144A 7.875% 01/09/2023	USD	2,350,000	2,115,000	0.13

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
AMC Networks, Inc. 4.75% 15/12/2022	USD	3,000,000	2,985,690	0.18
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 'B', 144A 5.625% 15/01/2021	USD	757,635	783,205	0.05
American Builders & Contractors Supply Co., Inc., 144A 5.75% 15/12/2023	USD	1,300,000	1,345,500	0.08
Ancestry.com Holdings LLC, 144A 9.625% 15/10/2018	USD	1,425,000	1,453,500	0.09
Ancestry.com Holdings LLC, Reg. S 9.625% 15/10/2018	USD	2,575,000	2,626,500	0.16
Ancestry.com, Inc. 11% 15/12/2020	USD	2,850,000	3,063,750	0.18
Apex Tool Group LLC, 144A 7% 01/02/2021	USD	6,950,000	6,029,125	0.36
Archrock Partners LP 6% 01/04/2021	USD	2,000,000	1,800,000	0.11
Archrock Partners LP 6% 01/10/2022	USD	1,875,000	1,668,750	0.10
Argos Merger Sub, Inc., 144A 7.125% 15/03/2023	USD	4,775,000	4,864,627	0.29
Avis Budget Car Rental LLC, 144A 5.25% 15/03/2025	USD	4,100,000	3,705,375	0.22
Bankrate, Inc., Reg. S 6.125% 15/08/2018	USD	3,125,000	3,140,625	0.19
Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA, Reg. S 5.625% 15/12/2016	USD	2,350,000	2,352,937	0.14
Blue Coat Holdings, Inc., 144A 8.375% 01/06/2023	USD	3,475,000	3,944,125	0.23
BlueLine Rental Finance Corp., Reg. S 7% 01/02/2019	USD	2,425,000	2,085,500	0.12
Boardriders SA, 144A 9.5% 15/12/2020	EUR	450,000	397,689	0.02
Boyd Gaming Corp., 144A 6.375% 01/04/2026	USD	2,725,000	2,858,348	0.17
Builders FirstSource, Inc., 144A 7.625% 01/06/2021	USD	1,769,000	1,857,450	0.11
Cable One, Inc., 144A 5.75% 15/06/2022	USD	1,650,000	1,695,375	0.10
Capugel SA, Reg. S 7% 15/05/2019	USD	1,584,000	1,597,860	0.10
CCO Holdings LLC, 144A 5.5% 01/05/2026	USD	2,850,000	2,867,813	0.17
CCO Holdings LLC 5.75% 01/09/2023	USD	1,900,000	1,962,282	0.12
CEB, Inc., 144A 5.625% 15/06/2023	USD	8,850,000	8,628,750	0.51
Gengage Learning, Inc., 144A 9.5% 15/06/2024	USD	3,200,000	3,240,000	0.19
Centene Corp., 144A 5.625% 15/02/2021	USD	1,325,000	1,385,446	0.08
Centene Corp., 144A 6.125% 15/02/2024	USD	900,000	954,000	0.06
Central Garden & Pet Co. 6.125% 15/11/2023	USD	5,800,000	6,046,500	0.36
Cequele Communications Holdings I LLC, 144A 6.375% 15/09/2020	USD	6,900,000	6,959,271	0.41
Cequele Communications Holdings I LLC, 144A 5.125% 15/12/2021	USD	3,300,000	3,143,250	0.19
Cequele Communications Holdings I LLC, 144A 7.75% 15/07/2025	USD	4,160,000	4,351,838	0.26
Charter Communications Operating LLC, 144A 6.384% 23/10/2035	USD	2,825,000	3,355,973	0.20
Charter Communications Operating LLC, 144A 6.484% 23/10/2045	USD	2,825,000	3,407,125	0.20
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 144A 7% 30/06/2024	USD	3,925,000	4,027,600	0.24
Chesapeake Energy Corp., Reg. S 8% 15/12/2022	USD	4,644,000	3,953,205	0.24
Citigroup, Inc., FRN 5.95% Perpetual	USD	7,025,000	6,825,033	0.41
Citigroup, Inc., FRN 6.25% Perpetual	USD	1,675,000	1,723,056	0.10

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Claire's Stores, Inc. 10.5% 01/06/2017	USD	3,338,000	1,835,900	0.11
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 6.5% 15/11/2022	USD	3,025,000	3,027,117	0.18
ClubCorp Club Operations, Inc., 144A 8.25% 15/12/2023	USD	2,150,000	2,144,625	0.13
CommScope Holding Co., Inc., 144A 6.625% 01/06/2020	USD	66,000	68,294	-
CommScope Technologies Finance LLC, 144A 6% 15/06/2025	USD	7,600,000	7,782,552	0.46
Consolidated Container Co. LLC, Reg. S 10.125% 15/07/2020	USD	3,925,000	3,561,937	0.21
Crimson Merger Sub, Inc., 144A 6.625% 15/05/2022	USD	2,425,000	2,018,813	0.12
CrownRock LP, 144A 7.125% 15/04/2021	USD	4,100,000	4,202,500	0.25
CrownRock LP, 144A 7.75% 15/02/2023	USD	5,825,000	6,116,250	0.36
CVR Partners LP, 144A 9.25% 15/06/2023	USD	2,450,000	2,459,188	0.15
DCP Midstream LLC, 144A 9.75% 15/03/2019	USD	600,000	650,250	0.04
DCP Midstream LLC, 144A 6.45% 03/11/2036	USD	1,550,000	1,364,000	0.08
DCP Midstream LLC 8.125% 16/08/2030	USD	475,000	467,875	0.03
Dean Foods Co., 144A 6.5% 15/03/2023	USD	3,825,000	3,962,088	0.24
Diamond 1 Finance Corp., 144A 5.875% 15/06/2021	USD	1,700,000	1,739,924	0.10
Diamond 1 Finance Corp., 144A 7.125% 15/06/2024	USD	2,925,000	3,049,137	0.18
DISH DBS Corp., 144A 7.75% 01/07/2026	USD	3,600,000	3,698,982	0.22
DISH DBS Corp. 6.75% 01/06/2021	USD	3,675,000	3,802,228	0.23
DISH DBS Corp. 5.875% 15/07/2022	USD	3,100,000	3,017,199	0.18
DPx Holdings BV, 144A 7.5% 01/02/2022	USD	2,700,000	2,757,375	0.16
EarthLink Holdings Corp. 7.375% 01/06/2020	USD	500,000	519,067	0.03
Eco Services Operations LLC, 144A 8.5% 01/11/2022	USD	3,425,000	3,407,875	0.20
Eldorado Resorts, Inc. 7% 01/08/2023	USD	4,425,000	4,613,063	0.27
EMI Music Publishing Group North America Holdings, 144A 7.625% 15/06/2024	USD	1,150,000	1,184,500	0.07
Endo Ltd., 144A 6% 15/07/2023	USD	3,925,000	3,463,813	0.21
Endo Ltd., 144A 6% 01/02/2025	USD	2,800,000	2,435,776	0.15
Energizer Holdings, Inc., 144A 5.5% 15/06/2025	USD	6,075,000	6,029,438	0.36
Energy Future Intermediate Holding Co. LLC, 144A 11.75% 01/03/2022 ¹	USD	8,727,688	10,255,033	0.61
Equinix, Inc., REIT 5.375% 01/01/2022	USD	2,450,000	2,535,236	0.15
Equinix, Inc., REIT 5.75% 01/01/2025	USD	1,325,000	1,368,752	0.08
First Data Corp., 144A 5.375% 15/08/2023	USD	5,875,000	5,955,047	0.35
First Data Corp., 144A 7% 01/12/2023	USD	19,450,000	19,721,619	1.17
Frontier Communications Corp. 8.875% 15/09/2020	USD	3,800,000	4,047,342	0.24
Gardner Denver, Inc., 144A 6.875% 15/08/2021	USD	2,550,000	2,320,500	0.14
Gibson Energy, Inc., 144A 6.75% 15/07/2021	USD	2,750,000	2,750,000	0.16
GLP Capital LP 4.375% 15/04/2021	USD	675,000	694,406	0.04
GLP Capital LP 5.375% 15/04/2026	USD	1,325,000	1,368,248	0.08
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 5.375% Perpetual	USD	7,325,000	7,227,944	0.43

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Greystar Real Estate Partners LLC, 144A 8.25% 01/12/2022	USD	2,675,000	2,755,250	0.16
Group 1 Automotive, Inc., 144A 5.25% 15/12/2023	USD	1,400,000	1,382,500	0.08
Gulfport Energy Corp. 7.75% 01/11/2020	USD	3,175,000	3,263,741	0.19
Gulfport Energy Corp. 6.625% 01/05/2023	USD	3,465,000	3,430,350	0.20
H&E Equipment Services, Inc. 7% 01/09/2022	USD	3,475,000	3,586,652	0.21
Harland Clarke Holdings Corp., 144A 9.75% 01/08/2018	USD	1,500,000	1,530,000	0.09
HD Supply, Inc., 144A 5.25% 15/12/2021	USD	3,725,000	3,878,656	0.23
Hexion, Inc. 6.625% 15/04/2020	USD	7,500,000	6,294,862	0.37
Hexion, Inc. 10% 15/04/2020	USD	1,375,000	1,295,938	0.08
Hill-Rom Holdings, Inc., 144A 5.75% 01/09/2023	USD	1,425,000	1,470,871	0.09
Howard Hughes Corp. (The), 144A 6.875% 01/10/2021	USD	4,125,000	4,176,563	0.25
Howard Hughes Corp. (The), Reg. S 6.875% 01/10/2021	USD	6,525,000	6,606,563	0.39
Hub Holdings LLC, 144A 8.125% 15/07/2019	USD	3,575,000	3,449,875	0.21
HUB International Ltd., 144A 9.25% 15/02/2021	USD	1,150,000	1,198,875	0.07
HUB International Ltd., 144A 7.875% 01/10/2021	USD	5,975,000	5,765,875	0.34
Huntington Ingalls Industries, Inc., 144A 5% 15/11/2025	USD	2,275,000	2,383,063	0.14
iHeartCommunications, Inc. 9% 15/12/2019	USD	6,000,000	4,528,320	0.27
Intelsat Jackson Holdings SA, 144A 8% 15/02/2024	USD	6,900,000	6,779,250	0.4
J.P. Morgan Chase & Co., FRN 5.3% Perpetual	USD	6,245,000	6,237,974	0.37
JC Penney Corp., Inc., 144A 5.875% 01/07/2023	USD	1,875,000	1,884,375	0.11
JLL, 144A 8.75% 01/05/2020	USD	4,875,000	4,826,250	0.29
Jo-Ann Stores Holdings, Inc., 144A 9.75% 15/10/2019	USD	1,800,000	1,575,000	0.09
Jo-Ann Stores LLC, 144A 8.125% 15/03/2019	USD	2,800,000	2,674,000	0.16
Joseph T Ryerson & Son, Inc., 144A 11% 15/05/2022	USD	5,500,000	5,706,250	0.34
KFC Holding Co., 144A 5% 01/06/2024	USD	1,275,000	1,297,580	0.08
KFC Holding Co., 144A 5.25% 01/06/2026	USD	6,800,000	6,915,702	0.41
Ladder Capital Finance Holdings LLLP, 144A 5.875% 01/08/2021	USD	1,875,000	1,685,156	0.10
Lamar Media Corp. 5.875% 01/02/2022	USD	1,000,000	1,035,145	0.06
LTF Merger Sub, Inc., 144A 8.5% 15/06/2023	USD	3,600,000	3,415,500	0.20
Manitowoc Foodservice, Inc., 144A 9.5% 15/02/2024	USD	775,000	858,313	0.05
Match Group, Inc., 144A 6.75% 15/12/2022	USD	2,950,000	3,068,000	0.18
Match Group, Inc., 144A 6.375% 01/06/2024	USD	3,270,000	3,400,800	0.21
McGraw-Hill Global Education Holdings LLC, 144A 7.875% 15/06/2024	USD	3,025,000	3,138,437	0.19
MDC Partners, Inc., 144A 6.5% 01/05/2024	USD	9,100,000	9,009,000	0.54
Mercer International, Inc. 7% 01/12/2019	USD	3,200,000	3,248,000	0.19

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Mercer International, Inc. 7.75% 01/12/2022	USD	1,700,000	1,708,500	0.10
MGM Growth Properties Operating Partnership LP, 144A 5.625% 01/05/2024	USD	1,650,000	1,736,113	0.10
MHGE Parent LLC, 144A 8.5% 01/08/2019	USD	2,875,000	2,918,125	0.17
Micron Technology, Inc., 144A 5.25% 01/08/2023	USD	1,775,000	1,511,288	0.09
Microsemi Corp., 144A 9.125% 15/04/2023	USD	7,050,000	7,790,250	0.46
Milacron LLC, 144A 7.75% 15/02/2021	USD	3,325,000	3,441,375	0.20
Molina Healthcare, Inc., 144A 5.375% 15/11/2022	USD	2,300,000	2,305,750	0.14
MPH Acquisition Holdings LLC, 144A 7.125% 01/06/2024	USD	1,200,000	1,263,000	0.08
MSGI, Inc., 144A 5.25% 15/11/2024	USD	2,225,000	2,280,625	0.14
MSGI, Inc., 144A 5.75% 15/08/2025	USD	2,675,000	2,795,375	0.17
Murray Energy Corp., 144A 11.25% 15/04/2021	USD	5,625,000	1,631,250	0.10
National Financial Partners Corp., 144A 9% 15/07/2021	USD	900,000	867,375	0.05
Navient Corp. 5% 26/10/2020	USD	3,225,000	3,033,645	0.18
Neptune Finco Corp., 144A 10.125% 15/01/2023	USD	14,450,000	16,208,132	0.96
Neptune Finco Corp., 144A 10.875% 15/10/2025	USD	2,800,000	3,192,000	0.19
Netflix, Inc. 5.75% 01/03/2024	USD	900,000	940,500	0.06
NRG Energy, Inc., 144A 7.25% 15/05/2026	USD	3,950,000	3,937,221	0.23
NRG Energy, Inc. 6.625% 15/03/2023	USD	5,550,000	5,457,343	0.32
OneMain Financial Holdings LLC, 144A 7.25% 15/12/2021	USD	4,225,000	4,066,563	0.24
OPE KAG Finance Sub, Inc., 144A 7.875% 31/07/2023	USD	1,675,000	1,658,250	0.10
Outerwall, Inc. 6% 15/03/2019	USD	5,325,000	4,997,220	0.30
Outfront Media Capital LLC 5.25% 15/02/2022	USD	3,875,000	3,915,533	0.23
Outfront Media Capital LLC 5.625% 15/02/2024	USD	1,325,000	1,356,138	0.08
Pactiv LLC 7.95% 15/12/2025	USD	1,575,000	1,641,937	0.10
Parsley Energy LLC, 144A 7.5% 15/02/2022	USD	5,300,000	5,538,500	0.33
Parsley Energy LLC, 144A 6.25% 01/06/2024	USD	475,000	485,687	0.03
Peninsula Gaming LLC, 144A 8.375% 15/02/2018	USD	2,125,000	2,133,591	0.13
PF Chang's China Bistro, Inc., 144A 10.25% 30/06/2020	USD	1,525,000	1,406,812	0.08
Platform Specialty Products Corp., 144A 10.375% 01/05/2021	USD	2,450,000	2,480,625	0.15
Platform Specialty Products Corp., 144A 6.5% 01/02/2022	USD	2,325,000	2,057,625	0.12
Post Holdings, Inc., 144A 6.75% 01/12/2021	USD	2,625,000	2,766,855	0.16
PQ Corp., 144A 6.75% 15/11/2022	USD	1,725,000	1,785,375	0.11
Prime Security One MS, Inc., 144A 4.875% 15/07/2032	USD	2,250,000	1,731,132	0.10
Prime Security Services Borrower LLC, 144A 9.25% 15/05/2023	USD	1,575,000	1,665,775	0.10
Provident Funding Associates LP, 144A 6.75% 15/06/2021	USD	2,250,000	2,148,750	0.13
Quicken Loans, Inc., 144A 5.75% 01/05/2025	USD	6,100,000	5,886,500	0.35

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Rackspace Hosting, Inc., 144A 6.5% 15/01/2024	USD	3,250,000	3,225,625	0.19
Reynolds Group Issuer, Inc., 144A 7% 15/07/2024	USD	2,800,000	2,868,250	0.17
Reynolds Group Issuer, Inc. 8.25% 15/02/2021	USD	4,625,000	4,798,807	0.29
Rite Aid Corp., 144A 6.125% 01/04/2023	USD	4,100,000	4,361,478	0.26
Rite Aid Corp. 6.75% 15/06/2021	USD	6,725,000	7,077,558	0.42
Rockies Express Pipeline LLC, 144A 6% 15/01/2019	USD	822,000	845,620	0.05
RSI Home Products, Inc., 144A 6.5% 15/03/2023	USD	3,900,000	4,026,750	0.24
Sabine Pass Liquefaction LLC, 144A 5.875% 30/06/2026	USD	1,425,000	1,424,466	0.08
Sabine Pass Liquefaction LLC 6.25% 15/03/2022	USD	4,975,000	5,122,932	0.30
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/05/2024	USD	1,600,000	1,592,256	0.09
Sabre Global, Inc., 144A 5.375% 15/04/2023	USD	1,175,000	1,200,709	0.07
Safeway, Inc. 7.25% 01/02/2031	USD	575,000	553,337	0.03
Safway Group Holding LLC, 144A 7% 15/05/2018	USD	2,155,000	2,160,387	0.13
Scientific Games International, Inc., 144A 7% 01/01/2022	USD	5,625,000	5,667,188	0.34
Scotts Miracle-Gro Co. (The), 144A 6% 15/10/2023	USD	1,575,000	1,665,562	0.10
Seminole Hard Rock Entertainment, Inc., 144A 5.875% 15/05/2021	USD	2,820,000	2,841,150	0.17
Shea Homes LP, 144A 5.875% 01/04/2023	USD	1,800,000	1,791,000	0.11
Shear's Foods LLC, 144A 9% 01/11/2019	USD	2,250,000	2,385,000	0.14
Shingle Springs Tribal Gaming Authority, 144A 9.75% 01/09/2021	USD	3,700,000	4,051,500	0.24
Sinclair Television Group, Inc., 144A 5.875% 15/03/2026	USD	1,200,000	1,227,000	0.07
Sirius XM Radio, Inc., 144A 6% 15/07/2024	USD	4,605,000	4,739,696	0.28
SMW Merger Sub, Inc. 6.25% 01/06/2021	USD	1,800,000	1,825,912	0.10
Sonic Automotive, Inc. 5% 15/05/2023	USD	3,225,000	3,168,562	0.19
SS&C Technologies Holdings, Inc. 5.875% 15/07/2023	USD	1,975,000	2,029,312	0.12
StandardAero Aviation Holdings, Inc., 144A 10% 15/07/2023	USD	4,450,000	4,461,125	0.27
Sunoco LP, 144A 6.25% 15/04/2021	USD	2,950,000	2,950,723	0.18
Sunoco LP, 144A 6.375% 01/04/2023	USD	200,000	198,250	0.01
Surgery Center Holdings, Inc., 144A 8.875% 15/04/2021	USD	2,150,000	2,214,500	0.13
Targa Resources Partners LP, 144A 6.75% 15/03/2024	USD	3,225,000	3,241,125	0.19
Targa Resources Partners LP 5.25% 01/05/2023	USD	4,175,000	3,927,464	0.23
Targa Resources Partners LP 4.25% 15/11/2023	USD	9,850,000	8,835,746	0.53
Taylor Morrison Communities, Inc., 144A 5.875% 15/04/2023	USD	2,250,000	2,266,875	0.13
Tempur Sealy International, Inc., 144A 5.5% 15/06/2026	USD	2,075,000	2,038,667	0.12
Tenet Healthcare Corp., FRN 4.152% 15/06/2020	USD	1,650,000	1,645,875	0.10
TerraForm Power Operating LLC, 144A 5.875% 01/02/2023	USD	2,050,000	1,957,750	0.12

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
TerraForm Power Operating LLC, 144A 6.125% 15/06/2025	USD	800,000	734,000	0.04
TI Group Automotive Systems LLC, 144A 8.75% 15/07/2023	USD	5,250,000	5,184,375	0.31
Time Warner Cable, Inc. 6.55% 01/05/2037	USD	575,000	677,065	0.04
Time Warner Cable, Inc. 7.3% 01/07/2038	USD	495,000	623,452	0.04
Time Warner Cable, Inc. 6.75% 15/06/2039	USD	340,000	407,215	0.02
T-Mobile USA, Inc. 6% 01/03/2023	USD	1,025,000	1,061,956	0.06
T-Mobile USA, Inc. 6.5% 15/01/2024	USD	825,000	869,826	0.05
T-Mobile USA, Inc. 6% 15/04/2024	USD	1,925,000	2,004,012	0.12
T-Mobile USA, Inc. 6.375% 01/03/2025	USD	1,575,000	1,644,087	0.10
T-Mobile USA, Inc. 6.5% 15/01/2026	USD	10,850,000	11,429,933	0.68
Townsquare Media, Inc., 144A 6.5% 01/04/2023	USD	3,700,000	3,658,375	0.22
TransDigm, Inc., 144A 6.375% 15/06/2026	USD	550,000	539,688	0.03
Tranworld Systems, Inc., 144A 9.5% 15/08/2021	USD	3,350,000	1,658,250	0.10
United Airlines Pass Through Trust, Series 2014-2 'B' 4.625% 03/09/2022	USD	689,436	690,298	0.04
Univar USA, Inc., 144A 6.75% 15/07/2023	USD	4,800,000	4,752,000	0.28
Univision Communications, Inc., 144A 8.5% 15/05/2021	USD	1,298,000	1,356,008	0.08
Univision Communications, Inc., 144A 5.125% 15/02/2025	USD	5,250,000	5,185,504	0.31
Univision Communications, Inc., Reg. S 6.75% 15/09/2022	USD	829,000	876,667	0.05
USI, Inc., 144A 7.75% 15/01/2021	USD	5,125,000	5,067,344	0.30
VB-S1 Issuer LLC, Series 2016-1A 'F', 144A 6.901% 15/06/2046	USD	960,000	967,981	0.06
Veritas US, Inc., 144A 10.5% 01/02/2024	USD	275,000	233,750	0.01
Vista Outdoor, Inc., 144A 5.875% 01/10/2023	USD	1,975,000	2,068,813	0.12
Watco Cos. LLC, 144A 6.375% 01/04/2023	USD	2,475,000	2,462,625	0.15
Wayne Merger Sub LLC, 144A 8.25% 01/08/2023	USD	5,750,000	5,678,125	0.34
Western Digital Corp., 144A 7.375% 01/04/2023	USD	6,900,000	7,364,439	0.44
Western Digital Corp., 144A 10.5% 01/04/2024	USD	13,125,000	14,059,566	0.84
WideOpenWest Finance LLC 10.25% 15/07/2019	USD	3,525,000	3,648,375	0.22
WideOpenWest Finance LLC 13.375% 15/10/2019	USD	5,000,000	5,300,000	0.32
William Lyon Homes, Inc. 8.5% 15/11/2020	USD	4,225,000	4,391,169	0.26
WMG Acquisition Corp., 144A 6% 15/01/2021	USD	1,725,000	1,786,099	0.11
WR Grace & Co-Conn, 144A 5.125% 01/10/2021	USD	2,550,000	2,594,625	0.15
Zebra Technologies Corp. 7.25% 15/10/2022	USD	3,075,000	3,274,875	0.19
Zekelman Industries, Inc., 144A 9.875% 15/06/2023	USD	2,800,000	2,828,000	0.17
			725,310,600	43.12
債券 計			938,475,601	55.79

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
株式				
イギリス				
Gentry Holdings 'A'	GBP	3,537	-	-
Gentry Holdings Preference 'B'	GBP	786,348	528,328	0.03
			528,328	0.03
株式 計				
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			939,003,929	55.82
その他取引可能な有価証券				
株式				
アイルランド				
Smurfit-Stone Container Corp. Preference*	USD	7,275	-	-
			-	-
株式 計				
その他取引可能な有価証券 計			-	-
有価証券 計			1,551,859,601	92.25

為替予約取引

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	決済日	取引相手先	評価 (損)益 USD	純資産 比率(%)
EUR	49,258,852	USD	53,713,330	15/07/2016	RBC	1,066,387	0.07
EUR	14,806,059	USD	16,190,684	15/07/2016	J.P. Morgan	274,817	0.01
EUR	1,510,186	USD	1,660,195	15/08/2016	J.P. Morgan	21,203	-
EUR	490,308	USD	545,890	15/09/2016	J.P. Morgan	639	-
EUR	2,231,000	USD	2,467,330	15/09/2016	HSBC	19,490	-
EUR	461,266	USD	512,504	15/12/2016	J.P. Morgan	3,525	-
NOK	131,852,850	USD	14,772,972	15/07/2016	Societe Generale	970,690	0.06
NOK	18,726,097	USD	2,169,715	15/07/2016	J.P. Morgan	66,241	-
NOK	122,351,093	USD	14,268,061	15/08/2016	RBC	340,106	0.02
NOK	26,003,876	USD	3,237,672	15/08/2016	J.P. Morgan	105,864	0.01
NOK	181,073,000	USD	21,273,144	15/09/2016	J.P. Morgan	344,504	0.02
NOK	312,800	USD	37,320	15/11/2016	J.P. Morgan	28	-
NOK	734,965	USD	87,204	15/12/2016	J.P. Morgan	556	-
SEK	240,950	USD	28,137	15/07/2016	J.P. Morgan	273	-
SEK	2,556,387	USD	299,111	15/08/2016	J.P. Morgan	2,737	-
SEK	446,725	USD	52,882	15/12/2016	J.P. Morgan	151	-
USD	4,004,912	CHF	3,881,000	19/09/2016	Standard Chartered	12,205	-
USD	1,246,839	EUR	1,114,796	15/07/2016	J.P. Morgan	7,097	-
USD	116,582,566	EUR	108,030,000	15/09/2016	Goldman Sachs	1,738,529	0.11
USD	3,378,211	EUR	3,001,720	15/09/2016	Citibank	32,295	-
USD	38,411,338	GBP	26,944,358	15/07/2016	Westpac Banking	2,202,432	0.13
USD	232,211	GBP	156,844	15/07/2016	Barclays	21,438	-
USD	452,579	NOK	3,766,182	15/07/2016	J.P. Morgan	2,886	-
USD	183,355	SEK	1,514,722	15/07/2016	J.P. Morgan	4,755	-
USD	288,124	SEK	2,336,802	15/09/2016	J.P. Morgan	11,821	-
為替予約取引にかかる評価益 計						7,250,669	0.43

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	決済日	取引相手先	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)
EUR	2,160,526	USD	2,415,931	15/07/2016	J.P. Morgan	(13,256)	-
EUR	65,190,487	USD	73,866,363	15/08/2016	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1,285,131)	(0.08)
EUR	2,714,210	USD	3,059,733	15/08/2016	J.P. Morgan	(37,807)	-
EUR	7,267,000	USD	8,323,447	15/08/2016	Bank of America	(232,576)	(0.01)
EUR	65,236,000	USD	73,385,281	15/09/2016	Goldman Sachs	(668,930)	(0.04)
EUR	9,806,815	USD	11,060,662	15/09/2016	RBC	(129,338)	(0.01)
EUR	2,977,720	USD	3,380,961	15/09/2016	J.P. Morgan	(61,797)	-
EUR	282,572	USD	321,735	15/09/2016	Barclays	(6,762)	-
EUR	54,689,900	USD	62,686,274	14/10/2016	HSBC	(1,654,698)	(0.10)
EUR	3,410,377	USD	3,888,498	14/10/2016	J.P. Morgan	(82,665)	-
EUR	5,505,000	USD	6,279,009	14/10/2016	State Street	(135,665)	(0.01)
EUR	7,975,000	USD	9,072,719	14/10/2016	Barclays	(172,962)	(0.01)
EUR	70,775,300	USD	81,497,758	15/11/2016	Deutsche Bank	(2,414,584)	(0.15)
EUR	2,626,396	USD	2,974,083	15/11/2016	J.P. Morgan	(39,390)	-
EUR	988,000	USD	1,125,243	15/11/2016	Barclays	(21,268)	-
EUR	63,091,300	USD	71,585,723	15/12/2016	Standard Chartered	(1,004,133)	(0.06)
EUR	5,812,643	USD	6,631,562	15/12/2016	J.P. Morgan	(128,835)	(0.01)
NOK	1,976,472	USD	238,752	15/07/2016	J.P. Morgan	(2,754)	-
NOK	24,783,879	USD	3,017,555	15/08/2016	J.P. Morgan	(58,470)	-
NOK	473,767	USD	56,803	15/09/2016	J.P. Morgan	(241)	-
NOK	159,400,000	USD	19,486,445	14/10/2016	Societe Generale	(456,102)	(0.03)
NOK	22,356,942	USD	2,746,701	14/10/2016	J.P. Morgan	(77,565)	(0.01)
NOK	152,374,500	USD	18,600,630	15/11/2016	Deutsche Bank	(407,599)	(0.03)
NOK	2,672,209	USD	323,305	15/11/2016	J.P. Morgan	(4,253)	-
NOK	20,733,000	USD	2,557,807	15/11/2016	RBC	(82,353)	(0.01)
NOK	165,017,400	USD	20,100,810	15/12/2016	Bank of America	(396,791)	(0.02)
NOK	1,168,588	USD	141,360	15/12/2016	J.P. Morgan	(1,824)	-
SEK	11,266,275	USD	1,330,060	15/07/2016	BNP Paribas	(1,667)	-
SEK	604,671	USD	73,368	15/07/2016	J.P. Morgan	(2,071)	-
SEK	1,826,000	USD	224,504	15/07/2016	HSBC	(9,202)	-
SEK	11,853,199	USD	1,419,144	15/08/2016	J.P. Morgan	(19,569)	-
SEK	19,115,350	USD	2,281,171	15/09/2016	J.P. Morgan	(20,973)	-
SEK	10,700,000	USD	1,335,050	14/10/2016	Goldman Sachs	(68,270)	-
SEK	5,128,342	USD	637,886	14/10/2016	J.P. Morgan	(30,738)	-
SEK	13,411,600	USD	1,658,864	15/11/2016	Deutsche Bank	(68,824)	(0.01)
SEK	3,128,818	USD	378,834	15/11/2016	J.P. Morgan	(7,891)	-
SEK	1,889,000	USD	232,611	15/11/2016	Barclays	(8,656)	-
SEK	12,669,500	USD	1,543,801	15/12/2016	Bank of America	(39,764)	-
SEK	1,545,039	USD	188,234	15/12/2016	J.P. Morgan	(4,818)	-
USD	3,295,511	CAD	4,313,000	30/09/2016	Bank of America	(26,491)	-
USD	179,351	EUR	162,044	15/07/2016	J.P. Morgan	(854)	-
USD	513,705	NOK	4,370,491	15/07/2016	J.P. Morgan	(8,146)	-
USD	131,346	SEK	1,117,533	15/07/2016	J.P. Morgan	(421)	-
為替予約取引にかかる評価 (損) 計						(9,896,104)	(0.59)
為替予約取引にかかる評価 (損) 益 計						(2,645,435)	(0.16)

クレジット・デフォルト・スワップ取引

想定 元本	通貨	取引相手方	対象先	売買	利息 (支払) 受取 レート	満期日	評価額 USD	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)
3,338,000	USD	Goldman Sachs	Claire's Stores, Inc. 7.75% 01/06/2020	Buy	5.00%	20/06/2017	969,030	969,030	0.06
2,475,000	USD	Citibank	Teck Resources Ltd. 3.75% 01/02/2023	Sell	5.00%	20/06/2019	32,636	32,636	-
625,000	EUR	Goldman Sachs	TVN Finance Corp. II AB 7.375% 15/12/2020	Sell	5.00%	20/06/2019	95,980	95,980	-
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかると評価益 計							1,097,646	1,097,646	0.06
25,650,000	USD	J.P. Morgan	CDXNAJHY26V1	Buy	5.00%	20/06/2021	(746,918)	(746,918)	(0.05)
1,825,000	USD	Goldman Sachs	Freport- McMoran, Inc. 3.55% 01/03/2022	Sell	1.00%	20/06/2019	(105,938)	(105,938)	-
1,300,000	USD	Barclays	Transocean, Inc. 7.375% 15/04/2018	Sell	1.00%	20/06/2019	(196,414)	(196,414)	(0.01)
250,000	USD	Citibank	Transocean, Inc. 7.375% 15/04/2018	Sell	1.00%	20/06/2019	(37,772)	(37,772)	-
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかると評価 (損) 計							(1,087,042)	(1,087,042)	(0.06)
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかると評価 (損) 益 計							10,604	10,604	-

現金	116,384,839	6.92
その他資産 (負債)	13,926,897	0.83
純資産	1,682,170,337	100.00

国別投資比率

	純資産比率 (%)
アメリカ	62.67
カナダ	7.04
ルクセンブルグ	3.12
イギリス	2.91
オランダ	2.23
フランス	2.07
イタリア	1.74
ドイツ	1.30
ブラジル	1.27
オーストラリア	1.14
スペイン	0.89
アルゼンチン	0.82
スイス	0.69
ベルギー	0.64
ジャマイカ	0.50
メキシコ	0.42
セルビア	0.32
アイルランド	0.31
ロシア	0.30
トリニダードトバゴ	0.27
ギリシャ	0.23

	純資産比率 (%)
トルコ	0.21
香港	0.17
イスラエル	0.15
チリ	0.15
コロンビア	0.14
パナマ	0.14
オーストリア	0.12
インドネシア	0.11
中国	0.11
カザフスタン	0.07
有価証券 計	92.25
現金及びその他資産（負債）	7.75
合計	100.00

³当該証券は現在、デフォルトしている。

・これらの証券は公正価値で評価されている

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。

*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

2016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 USD	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				
GGSP Australia Assets Pty. Ltd., Reg. S 3.3% 09/04/2023	USD	400,000	409,502	0.14
			409,502	0.14
ベルギー				
Solvay Finance America LLC, 144A 4.45% 03/12/2025	USD	550,000	584,405	0.20
			584,405	0.20
バミューダ				
Bermuda Government International Bond, 144A 4.854% 06/02/2024	USD	205,000	223,859	0.08
			223,859	0.08
カナダ				
Province of Manitoba Canada 1.3% 03/04/2017	USD	275,000	276,217	0.09
Province of Ontario Canada 2.5% 10/09/2021	USD	230,000	241,006	0.08
Rogers Communications, Inc. 3.625% 15/12/2025	USD	80,000	86,078	0.03
Thomson Reuters Corp. 3.35% 15/05/2026	USD	80,000	82,027	0.03
TransCanada PipeLines Ltd. 4.875% 15/01/2026	USD	315,000	359,621	0.12
			1,044,949	0.35
中国				
Alibaba Group Holding Ltd. 3.125% 28/11/2021	USD	740,000	758,282	0.26
Alibaba Group Holding Ltd. 3.6% 28/11/2024	USD	525,000	537,479	0.18
CCCI Treasure Ltd., Reg. S, FRN 3.5% Perpetual	USD	200,000	203,669	0.07
CNOOC Finance 2015 USA LLC 3.5% 05/05/2025	USD	250,000	253,736	0.09
CRCC Yupeng Ltd., Reg. S, FRN 3.95% Perpetual	USD	350,000	360,031	0.12
JD.com, Inc. 3.875% 29/04/2026	USD	1,000,000	953,335	0.32
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.8% 11/02/2025	USD	1,025,000	1,081,165	0.36
			4,147,697	1.40
フランス				
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	400,000	417,542	0.14
			417,542	0.14
香港				
IFC Development Corporate Treasury Ltd., Reg. S 2.375% 21/05/2019	USD	300,000	304,046	0.10
			304,046	0.10
インドネシア				
Indonesia Government International Bond, 144A 4.875% 05/05/2021	USD	200,000	217,374	0.07
			217,374	0.07
イスラエル				
Teva Pharmaceutical Finance IV BV 3.65% 10/11/2021	USD	515,000	546,119	0.18
			546,119	0.18
メキシコ				
BBVA Bancomer SA, 144A 4.375% 10/04/2024	USD	295,000	306,866	0.11
Mexico Government International Bond 3.6% 30/01/2025	USD	225,000	234,709	0.08
Mexico Government International Bond 4.125% 21/01/2026	USD	585,000	631,376	0.21

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Petroleos Mexicanos, 144A 6.375% 04/02/2021	USD	25,000	27,114	0.01
			1,200,065	0.41
オランダ				
ING Bank NV, Reg. S, FRN 4.125% 21/11/2023	USD	500,000	508,562	0.17
LYB International Finance BV 4% 15/07/2023	USD	595,000	641,175	0.22
Shell International Finance BV 2.125% 11/05/2020	USD	515,000	525,120	0.18
Shell International Finance BV 3.25% 11/05/2025	USD	1,160,000	1,216,823	0.41
			2,691,680	0.98
パナマ				
Autoridad del Canal de Panama, 144A 4.95% 29/07/2035	USD	200,000	217,000	0.07
			217,000	0.07
スペイン				
Telefonica Emisiones SAU 4.57% 27/04/2023	USD	235,000	261,006	0.09
			261,006	0.09
スウェーデン				
Svensk Exportkredit AB 5.125% 01/03/2017	USD	350,000	359,924	0.12
			359,924	0.12
トルコ				
Türkiye Halk Bankası A/S, 144A 4.75% 04/06/2019	USD	205,000	208,440	0.07
			208,440	0.07
イギリス				
Barclays Bank plc 5.14% 14/10/2020	USD	560,000	598,035	0.20
Barclays plc 5.2% 12/05/2026	USD	355,000	360,797	0.12
Delphi Automotive plc 4.25% 15/01/2026	USD	75,000	82,166	0.03
Heathrow Funding Ltd., 144A 4.875% 15/07/2021	USD	180,000	198,849	0.07
HSBC Holdings plc 2.95% 25/05/2021	USD	335,000	338,278	0.11
Imperial Brands Finance plc, 144A 4.25% 21/07/2025	USD	645,000	699,538	0.24
Royal Bank of Scotland Group plc 4.8% 05/04/2026	USD	605,000	616,495	0.21
Santander UK Group Holdings plc 2.875% 16/10/2020	USD	70,000	69,653	0.02
WPP Finance 2010 3.75% 19/09/2024	USD	500,000	528,477	0.18
			3,492,288	1.18
アメリカ				
AbbVie, Inc. 4.45% 14/05/2046	USD	435,000	446,134	0.15
Actavis Funding SCS 3.8% 15/03/2025	USD	260,000	271,049	0.09
Actavis Funding SCS 4.55% 15/03/2035	USD	780,000	806,372	0.27
Aetna, Inc. 2.4% 15/06/2021	USD	370,000	377,287	0.13
Aetna, Inc. 3.2% 15/06/2026	USD	360,000	370,467	0.13
Agilent Technologies, Inc. 3.2% 01/10/2022	USD	25,000	25,660	0.01
Agilent Technologies, Inc. 3.875% 15/07/2023	USD	20,000	21,186	0.01
Alcoa, Inc. 5.72% 23/02/2019	USD	130,000	140,307	0.05
Alcoa, Inc. 6.15% 15/08/2020	USD	385,000	416,909	0.14
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.95% 15/01/2027	USD	530,000	548,111	0.19
Anthem, Inc. 3.5% 15/08/2024	USD	290,000	301,303	0.10
Anthem, Inc. 4.65% 15/01/2043	USD	500,000	530,740	0.18

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Arrow Electronics, Inc. 3.5% 01/04/2022	USD	85,000	86,957	0.03
Arrow Electronics, Inc. 4% 01/04/2025	USD	225,000	230,785	0.08
AT&T, Inc. 4.8% 15/06/2044	USD	725,000	752,010	0.25
Avnet, Inc. 4.625% 15/04/2026	USD	845,000	880,722	0.30
Bank of America Corp. 2% 11/01/2018	USD	250,000	251,645	0.08
Bank of America Corp. 3.3% 11/01/2023	USD	1,665,000	1,720,794	0.58
Bank of America Corp. 4.2% 26/08/2024	USD	105,000	108,820	0.04
Boston Properties LP, REIT 3.65% 01/02/2026	USD	365,000	388,229	0.13
Brkxmr Operating Partnership LP, REIT 3.875% 15/08/2022	USD	650,000	667,951	0.23
CC Holdings GS V LLC 3.849% 15/04/2023	USD	710,000	756,963	0.26
Chubb INA Holdings, Inc. 2.3% 03/11/2020	USD	145,000	148,748	0.05
Chubb INA Holdings, Inc. 4.35% 03/11/2045	USD	115,000	132,949	0.04
CNA Financial Corp. 5.875% 15/08/2020	USD	625,000	702,375	0.24
Crown Castle International Corp., REIT 3.4% 15/02/2021	USD	110,000	114,939	0.04
Crown Castle International Corp., REIT 5.25% 15/01/2023	USD	195,000	219,283	0.07
Crown Castle International Corp., REIT 4.45% 15/02/2026	USD	440,000	478,458	0.16
CVS Health Corp. 3.5% 20/07/2022	USD	145,000	156,092	0.05
CVS Health Corp. 5% 01/12/2024	USD	110,000	129,096	0.04
CVS Health Corp. 3.875% 20/07/2025	USD	124,000	137,143	0.05
DDR Corp., REIT 4.25% 01/02/2026	USD	235,000	247,625	0.08
Delphi Corp. 5% 15/02/2023	USD	445,000	471,661	0.16
Discover Bank 3.1% 04/06/2020	USD	830,000	849,430	0.29
Energy Transfer Partners LP 4.15% 01/10/2020	USD	830,000	842,409	0.28
Enterprise Products Operating LLC 2.85% 15/04/2021	USD	115,000	118,942	0.04
Enterprise Products Operating LLC 3.95% 15/02/2027	USD	1,020,000	1,086,234	0.37
Enterprise Products Operating LLC 5.1% 15/02/2045	USD	340,000	376,144	0.13
EQT Corp. 4.875% 15/11/2021	USD	115,000	122,092	0.04
Essex Portfolio LP, REIT 3.375% 15/04/2026	USD	440,000	452,531	0.15
Exelon Generation Co. LLC 2.95% 15/01/2020	USD	945,000	971,762	0.33
FirstEnergy Corp. 7.375% 15/11/2031	USD	155,000	189,965	0.06
GATX Corp. 3.5% 15/07/2016	USD	62,000	62,040	0.02
GATX Corp. 2.5% 15/03/2019	USD	150,000	151,716	0.05
GATX Corp. 2.5% 30/07/2019	USD	180,000	182,342	0.06
GATX Corp. 4.85% 01/06/2021	USD	150,000	162,196	0.05
GATX Corp. 3.25% 30/03/2025	USD	260,000	257,685	0.09
General Motors Co. 4% 01/04/2025	USD	630,000	636,114	0.21
General Motors Financial Co., Inc. 4% 15/01/2025	USD	175,000	176,864	0.06
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 7.5% 15/02/2019	USD	175,000	200,019	0.07
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 5.75% 24/01/2022	USD	715,000	828,928	0.28
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.625% 22/01/2023	USD	695,000	730,587	0.25
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 4.25% 21/10/2025	USD	215,000	222,603	0.08

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 6.75% 01/10/2037	USD	205,000	252,979	0.09
Harris Corp. 3.832% 27/04/2025	USD	930,000	988,771	0.33
Humana, Inc. 3.15% 01/12/2022	USD	330,000	340,443	0.11
Humana, Inc. 3.85% 01/10/2024	USD	515,000	551,140	0.19
Humana, Inc. 4.95% 01/10/2044	USD	250,000	277,753	0.09
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 4% 15/03/2022	USD	845,000	900,500	0.30
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 3.75% 15/02/2023	USD	70,000	73,238	0.02
Kilroy Realty LP, REIT 4.375% 01/10/2025	USD	440,000	477,605	0.16
Kimco Realty Corp., REIT 3.4% 01/11/2022	USD	45,000	47,231	0.02
Kinder Morgan Energy Partners LP 5.95% 15/02/2018	USD	285,000	300,990	0.10
Kinder Morgan Energy Partners LP 4.3% 01/05/2024	USD	505,000	512,565	0.17
Kinder Morgan, Inc. 4.3% 01/06/2025	USD	245,000	251,391	0.08
Life Technologies Corp. 6% 01/03/2020	USD	310,000	350,396	0.12
Lockheed Martin Corp. 2.9% 01/03/2025	USD	1,370,000	1,421,752	0.48
Lockheed Martin Corp. 3.55% 15/01/2026	USD	140,000	152,970	0.05
Lockheed Martin Corp. 3.6% 01/03/2035	USD	195,000	200,884	0.07
Martin Marietta Materials, Inc. 4.25% 02/07/2024	USD	370,000	394,390	0.13
Mead Johnson Nutrition Co. 4.125% 15/11/2025	USD	355,000	388,425	0.13
Medtronic, Inc. 4.625% 15/03/2045	USD	265,000	311,991	0.11
Morgan Stanley 2.125% 25/04/2018	USD	355,000	358,669	0.12
Morgan Stanley 7.3% 13/05/2019	USD	175,000	200,998	0.07
Morgan Stanley 5.5% 28/07/2021	USD	405,000	463,097	0.16
Morgan Stanley 3.75% 25/02/2023	USD	690,000	732,956	0.25
Newell Brands, Inc. 3.9% 01/11/2025	USD	50,000	52,716	0.02
Newell Brands, Inc. 5.5% 01/04/2046	USD	180,000	215,511	0.07
Omnicom Group, Inc. 3.625% 01/05/2022	USD	70,000	74,393	0.03
Omnicom Group, Inc. 3.65% 01/11/2024	USD	775,000	829,971	0.28
Oracle Corp. 2.65% 15/07/2026	USD	595,000	596,425	0.20
Plains All American Pipeline LP 6.5% 01/05/2018	USD	460,000	489,236	0.17
Reinsurance Group of America, Inc. 6.45% 15/11/2019	USD	145,000	165,602	0.06
Reinsurance Group of America, Inc. 5% 01/06/2021	USD	105,000	116,372	0.04
Reinsurance Group of America, Inc. 4.7% 15/09/2023	USD	170,000	185,315	0.06
Reynolds American, Inc. 4% 12/06/2022	USD	115,000	125,244	0.04
Reynolds American, Inc. 3.25% 01/11/2022	USD	90,000	93,550	0.03
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	200,000	224,224	0.08
Reynolds American, Inc. 5.85% 15/08/2045	USD	400,000	513,928	0.17
Roper Technologies, Inc. 3% 15/12/2020	USD	170,000	175,788	0.06
Sempra Energy 2.85% 15/11/2020	USD	110,000	114,038	0.04
Simon Property Group LP, REIT 2.5% 01/09/2020	USD	260,000	268,744	0.09
Southern California Gas Co. 3.2% 15/06/2025	USD	335,000	361,758	0.12

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Southern Co. (The) 2.95% 01/07/2023	USD	665,000	689,459	0.23
Thermo Fisher Scientific, Inc. 3.3% 15/02/2022	USD	1,000,000	1,040,715	0.35
Tyson Foods, Inc. 4.5% 15/06/2022	USD	120,000	133,269	0.04
Tyson Foods, Inc. 3.95% 15/08/2024	USD	65,000	70,054	0.02
Unum Group 5.625% 15/09/2020	USD	80,000	89,612	0.03
Unum Group 3% 15/05/2021	USD	140,000	142,994	0.05
US Treasury 0.625% 30/11/2017	USD	1,200,000	1,200,820	0.41
US Treasury 1.25% 31/10/2018	USD	4,445,000	4,505,424	1.52
US Treasury 1.5% 31/05/2019	USD	6,355,000	6,495,257	2.19
US Treasury 1.5% 30/11/2019	USD	4,685,000	4,792,609	1.62
US Treasury 2% 31/08/2021	USD	12,295,000	12,866,525	4.35
US Treasury 1.625% 15/05/2026	USD	1,275,000	1,291,236	0.44
US Treasury 5.375% 15/02/2031	USD	410,000	608,946	0.21
US Treasury 2.75% 15/08/2042	USD	700,000	773,828	0.26
US Treasury 3.375% 15/05/2044	USD	1,310,000	1,619,999	0.55
US Treasury 3% 15/11/2044	USD	2,360,000	2,722,666	0.92
US Treasury 2.5% 15/02/2045	USD	1,480,000	1,546,484	0.52
US Treasury 3% 15/05/2045	USD	4,175,000	4,816,254	1.63
US Treasury 2.5% 15/02/2046	USD	1,080,000	1,128,600	0.38
Verizon Communications, Inc. 6.4% 15/09/2033	USD	1,620,000	2,072,531	0.7
Verizon Communications, Inc. 4.852% 21/08/2046	USD	730,000	805,029	0.27
Visa, Inc. 4.3% 14/12/2045	USD	560,000	652,856	0.22
			86,278,369	29.14
債券 計			102,804,265	34.72
株式				
アメリカ				
American Tower Corp., REIT Preference 5.25%	USD	833	92,688	0.03
			92,688	0.03
株式 計			92,688	0.03
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			102,896,953	34.75

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	430,000	445,226	0.15
Brambles USA, Inc., 144A 4.125% 23/10/2025	USD	85,000	90,870	0.03
Origin Energy Finance Ltd., 144A 3.5% 09/10/2018	USD	405,000	408,046	0.14
SMART ABS Trust, Series 2012-4US 'A4A' 1.25% 14/08/2018	USD	61,400	61,386	0.02
SMART ABS Trust, Series 2012-4US 'A4A' 1.25% 14/08/2018	USD	155,546	155,314	0.05
SMART ABS Trust, Series 2013-1US 'A4A' 1.05% 14/10/2018	USD	51,851	51,801	0.02
SMART ABS Trust, Series 2013-2US 'A4A' 1.18% 14/02/2019	USD	81,699	81,581	0.03
SMART ABS Trust, Series 2014-1US 'A4A' 1.68% 14/12/2019	USD	275,000	275,943	0.09
SMART ABS Trust, Series 2015-1US 'A3A' 1.5% 14/09/2018	USD	85,000	85,112	0.03
Tranzurban Finance Co. Pty. Ltd., 144A 4.125% 02/02/2026	USD	45,000	47,884	0.02

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 144A 4.125% 02/02/2026	USD	105,000	111,684	0.04
WEA Finance LLC, REIT, 144A 3.25% 05/10/2020	USD	350,000	364,589	0.12
			2,179,416	0.74
チリ				
Banco Santander Chile, 144A 3.875% 20/09/2022	USD	150,000	157,403	0.05
			157,403	0.05
フランス				
BPCE SA, 144A 4.875% 01/04/2026	USD	660,000	676,417	0.23
			676,417	0.23
イタリア				
Intesa Sanpaolo SpA, 144A 6.5% 24/02/2021	USD	235,000	266,633	0.09
			266,633	0.09
ルクセンブルグ				
SES SA, 144A 3.6% 04/04/2023	USD	95,000	96,137	0.03
			96,137	0.03
メキシコ				
Petroleos Mexicanos 3.5% 23/07/2020	USD	45,000	44,835	0.01
Petroleos Mexicanos 4.875% 24/01/2022	USD	435,000	443,765	0.15
Petroleos Mexicanos 6.5% 02/06/2041	USD	145,000	146,150	0.05
			634,750	0.21
オランダ				
Airbus Group Finance BV, 144A 2.7% 17/04/2023	USD	155,000	161,029	0.05
ING Bank NV, 144A 2.45% 16/03/2020	USD	200,000	204,620	0.07
			365,649	0.12
シンガポール				
HPHT Finance 15 Ltd., 144A 2.25% 17/03/2018	USD	200,000	201,385	0.07
			201,385	0.07
スイス				
Holcim US Finance Carl & Cie SCS, 144A 6% 30/12/2019	USD	135,000	150,817	0.05
UBS Group Funding Jersey Ltd., 144A 4.125% 24/09/2025	USD	220,000	228,966	0.08
			379,783	0.13
イギリス				
HSBC Holdings plc, FRN 6.375% Perpetual	USD	200,000	190,694	0.06
Lanark Master Issuer plc, FRN, Series 2013-1A "1A1", 144A 1.118% 22/12/2054	USD	203,578	203,521	0.07
Nationwide Building Society, 144A 3.9% 21/07/2025	USD	795,000	849,982	0.29
Sky plc, 144A 3.75% 16/09/2024	USD	255,000	265,468	0.09
Trinity Acquisition plc 3.5% 15/09/2021	USD	250,000	257,106	0.09
			1,766,771	0.60
アメリカ				
21st Century Fox America, Inc. 4.75% 15/09/2044	USD	530,000	586,697	0.20
21st Century Fox America, Inc. 4.95% 15/10/2045	USD	275,000	314,614	0.11
225 Liberty Street Trust, Series 2016- 225L 'A', 144A 3.597% 01/02/2026	USD	100,000	108,980	0.04
Ally Auto Receivables Trust, Series 2012-A 'D', 144A 3.15% 15/10/2018	USD	70,000	70,066	0.02

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Ally Master Owner Trust, Series 2014-1 'A2' 1.29% 15/01/2019	USD	145,000	145,088	0.05
Ally Master Owner Trust, Series 2014-4 'A2' 1.43% 17/06/2019	USD	800,000	801,473	0.27
Ally Master Owner Trust, Series 2015-3 'A' 1.63% 15/05/2020	USD	575,000	576,850	0.19
Amazon.com, Inc. 3.8% 05/12/2024	USD	250,000	280,566	0.09
Amazon.com, Inc. 4.95% 05/12/2044	USD	575,000	704,168	0.24
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 'A' 4% 15/07/2025	USD	65,659	69,352	0.02
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-2 'A' 4.95% 15/01/2023	USD	168,031	182,944	0.06
American Airlines Pass Through Trust, Series 2014-1 'B' 4.375% 01/10/2022	USD	142,656	144,432	0.05
American Airlines Pass Through Trust, Series 2015-1 'B' 3.7% 01/05/2023	USD	45,413	44,562	0.02
American Airlines Pass Through Trust, Series 2016-1 'AA' 3.575% 15/07/2029	USD	280,000	295,050	0.10
American Airlines Pass Through Trust, Series 2016-2 'A' 3.65% 15/06/2028	USD	305,000	317,200	0.11
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-1 'A3' 1.26% 08/11/2019	USD	65,000	65,028	0.02
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-3 'B' 2.08% 08/09/2020	USD	170,000	171,642	0.06
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2016-1 'A3' 1.81% 08/10/2020	USD	55,000	55,476	0.02
ARI Fleet Lease Trust, Series 2016-A 'A3', 144A 2.11% 15/07/2024	USD	300,000	301,432	0.10
Ascension Health 3.945% 15/11/2046	USD	390,000	430,496	0.15
Ascantium Equipment Receivables LLC, Series 2015-1A 'A3', 144A 1.61% 13/10/2020	USD	82,000	82,087	0.03
Ascantium Equipment Receivables Trust, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.92% 10/12/2019	USD	170,000	170,456	0.06
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2013-1A 'A', 144A 1.92% 20/09/2019	USD	270,000	270,623	0.09
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2013-2A 'A', 144A 2.97% 20/02/2020	USD	160,000	164,139	0.06
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2014-1A 'A', 144A 2.46% 20/07/2020	USD	1,135,000	1,151,673	0.39
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2014-2A 'A', 144A 2.5% 20/02/2021	USD	120,000	121,824	0.04
Banc of America Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2006-3 'AM' 5.946% 10/07/2044	USD	140,000	139,022	0.05
Banc of America Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2007-4 'AM' 5.808% 10/02/2051	USD	370,000	385,631	0.13
Banc of America Commercial Mortgage Trust, Series 2006-5 'AM' 5.448% 10/09/2047	USD	275,000	276,488	0.09
Banc of America Commercial Mortgage Trust, Series 2007-5 'A4' 5.492% 10/02/2051	USD	105,172	108,276	0.04
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-A '2A2' 2.945% 25/02/2034	USD	11,391	10,881	-
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-B '2A2' 3.048% 25/03/2034	USD	62,397	62,068	0.02

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-D '2A2' 3.26% 25/05/2034	USD	136,035	134,764	0.05
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-H '2A2' 2.858% 25/09/2034	USD	75,921	74,203	0.03
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-I '3A2' 2.85% 25/10/2034	USD	27,264	26,982	0.01
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J '2A1' 2.922% 25/11/2035	USD	168,274	155,530	0.05
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J '3A1' 3.073% 25/11/2035	USD	70,162	67,029	0.02
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2014-3 'A' 2.41% 15/07/2022	USD	325,000	334,575	0.11
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2015-1 'A' 2.2% 15/12/2022	USD	100,000	102,960	0.03
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2015-2 'A' 1.56% 15/03/2021	USD	410,000	413,289	0.14
Bay Area Toll Authority 'F-2' 6.263% 01/04/2049	USD	255,000	398,925	0.13
Baylor Scott & White Holdings 3.967% 15/11/2046	USD	375,000	404,392	0.14
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-FW17 'A4' 5.694% 11/06/2050	USD	112,915	116,712	0.04
Biogen, Inc. 2.9% 15/09/2020	USD	295,000	307,279	0.10
Biogen, Inc. 4.05% 15/09/2025	USD	335,000	362,363	0.12
Cabela's Credit Card Master Note Trust, Series 2012-1A 'A1', 144A 1.63% 18/02/2020	USD	100,000	100,365	0.03
Cabela's Credit Card Master Note Trust, Series 2012-2A 'A1', 144A 1.45% 15/06/2020	USD	500,000	500,969	0.17
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2014-1 'C' 2.84% 22/04/2019	USD	30,000	30,420	0.01
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2015-2 'A3' 1.73% 20/09/2019	USD	240,000	241,642	0.08
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2015-4 'A4' 2.01% 20/07/2020	USD	35,000	35,201	0.01
Capital One Multi-Asset Execution Trust, Series 2015-A1 'A1' 1.39% 15/01/2021	USD	230,000	231,617	0.08
CarMax Auto Owner Trust, Series 2013-3 'B' 1.91% 15/03/2019	USD	225,000	226,265	0.08
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 'B' 1.69% 15/08/2019	USD	25,000	25,079	0.01
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 'C' 1.93% 15/11/2019	USD	35,000	35,041	0.01
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-1 'A4' 1.88% 15/06/2021	USD	340,000	344,670	0.12
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-2 'A4' 1.68% 15/09/2021	USD	280,000	281,825	0.10
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-2 'B' 2.16% 15/12/2021	USD	90,000	90,393	0.03
CCG Receivables Trust, Series 2016-1 'A2', 144A 1.69% 14/09/2022	USD	220,000	220,415	0.07
Celgene Corp. 3.625% 15/05/2024	USD	400,000	419,542	0.14
Celgene Corp. 3.875% 15/08/2025	USD	1,155,000	1,236,000	0.42
Charter Communications Operating LLC, 144A 4.464% 23/07/2022	USD	165,000	177,431	0.06
Charter Communications Operating LLC, 144A 4.908% 23/07/2025	USD	795,000	868,474	0.29
Charter Communications Operating LLC, 144A 6.384% 23/10/2035	USD	40,000	47,518	0.02

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Charter Communications Operating LLC, 144A 6.484% 23/10/2045	USD	595,000	717,607	0.24
Chase Issuance Trust, Series 2015-A2 'A2' 1.59% 18/02/2020	USD	265,000	267,784	0.09
Chase Issuance Trust, Series 2016-A2 'A' 1.37% 15/06/2021	USD	1,495,000	1,503,643	0.51
Chicago Metropolitan Water Reclamation 5.72% 01/12/2038	USD	410,000	531,741	0.18
Chicago O'Hare International Airport 'B' 6.395% 01/01/2040	USD	170,000	245,869	0.08
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2014-GC25 'A4' 3.635% 10/10/2047	USD	625,000	681,002	0.23
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC27 'A5' 3.137% 10/02/2048	USD	225,000	236,911	0.08
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC33 'A4' 3.778% 10/09/2058	USD	175,000	193,422	0.07
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC35 'A4' 3.818% 10/11/2048	USD	190,000	210,473	0.07
City of Los Angeles Department of Airports 7.053% 15/05/2040	USD	70,000	109,400	0.04
City of New York 6.271% 01/12/2037	USD	165,000	236,785	0.08
CNH Equipment Trust, Series 2012-D 'B' 1.27% 15/05/2020	USD	105,000	105,077	0.04
CNH Equipment Trust, Series 2015-A 'A4' 1.85% 15/04/2021	USD	1,009,000	1,022,026	0.35
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2014-TWC 'A', 144A 1.286% 13/02/2032	USD	100,000	99,379	0.03
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2014-UBS4 'C' 4.625% 10/08/2047	USD	150,000	160,679	0.05
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LC21 'B' 4.312% 10/07/2048	USD	170,000	178,779	0.06
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-PC1 'B' 4.443% 10/07/2050	USD	85,000	86,251	0.03
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-PC1 'C' 4.443% 10/07/2050	USD	65,000	59,737	0.02
COMM Mortgage Trust, Series 2014-UBS5 'A4' 3.838% 10/09/2047	USD	395,000	433,774	0.15
COMM Mortgage Trust, Series 2014-UBS6 'A5' 3.644% 10/12/2047	USD	580,000	629,585	0.21
COMM Mortgage Trust, Series 2015-CR24 'A5' 3.696% 10/08/2055	USD	160,000	175,837	0.06
COMM Mortgage Trust, Series 2015-CR26 'A4' 3.63% 10/10/2048	USD	345,000	375,104	0.13
COMM Mortgage Trust, Series 2015-LC23 'A4' 3.774% 10/10/2053	USD	180,000	198,072	0.07
COMM Mortgage Trust, Series 2015-PC1 'A2' 3.148% 10/07/2050	USD	85,000	68,324	0.02
COMM Mortgage Trust, Series 2015-PC1 'A5' 3.902% 10/07/2050	USD	1,775,000	1,958,686	0.66
COMM Mortgage Trust, Series 2015-PC1 'AM' 4.29% 10/07/2050	USD	50,000	54,961	0.02
COMM Mortgage Trust, Series 2016-CR28 'AHR' 3.651% 10/02/2049	USD	130,000	138,582	0.05
Commercial Mortgage Trust, Series 2007-GG9 'AM' 5.475% 10/03/2039	USD	150,000	152,588	0.05
Commercial Mortgage Trust, Series 2007-GG9 'AMFX' 5.475% 10/03/2039	USD	220,000	222,572	0.08
Commonwealth of Virginia Transportation Board 5.35% 15/05/2035	USD	265,000	335,222	0.11

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	新資産 比率(%)
Continental Airlines Pass Through Trust, Series 2012-1 'A' 4.15% 11/04/2024	USD	38,355	40,513	0.01
Credit Suisse Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2008-C1 'A3' 6.066% 15/02/2041	USD	385,000	400,691	0.14
Crown Castle Towers LLC, 144A 6.113% 15/01/2020	USD	113,000	125,815	0.04
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.222% 15/05/2022	USD	25,000	26,016	0.01
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.663% 15/05/2025	USD	255,000	264,007	0.09
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C3 'A4' 3.718% 15/08/2048	USD	590,000	647,035	0.22
CSMC Trust, FRN, Series 2015-GLPB 'B', 144A 3.811% 15/11/2034	USD	170,000	181,303	0.06
CSMC Trust, Series 2015-GLPB 'A', 144A 3.639% 15/11/2034	USD	410,000	437,970	0.15
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2010-2 'A' 4.95% 23/05/2019	USD	37,322	39,421	0.01
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2011-1 'A' 5.3% 15/04/2019	USD	36,258	38,841	0.01
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2015-1 'AA' 3.625% 30/07/2027	USD	117,623	124,240	0.04
Denver City & County School 4.242% 15/12/2037	USD	70,000	77,825	0.03
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2013-2 'A', 144A 2.27% 20/05/2026	USD	155,924	155,568	0.05
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2015-1 'A', 144A 2.73% 20/07/2027	USD	52,238	52,574	0.02
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2015-2 'A', 144A 2.99% 22/05/2028	USD	131,930	134,321	0.05
Discover Card Execution Note Trust, Series 2016-A3 'A3' 1.85% 16/10/2023	USD	740,000	748,619	0.25
District of Columbia 5.591% 01/12/2034	USD	60,000	80,291	0.03
Domino's Pizza Master Issuer LLC, Series 2012-1A 'A2', 144A 5.216% 25/01/2042	USD	177,038	182,513	0.06
East Bay Municipal Utility District Water System 5.874% 01/06/2040	USD	215,000	300,084	0.10
Elara HGV Timechare Issuer LLC, Series 2014-A 'A', 144A 2.53% 25/02/2027	USD	52,073	52,038	0.02
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2013-2 'A2', 144A 1.06% 20/03/2019	USD	4,626	4,625	-
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2015-1 'A2', 144A 1.3% 20/09/2020	USD	431,240	430,767	0.15
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2016-1 'A3', 144A 2.08% 20/09/2021	USD	560,000	560,390	0.19
ERAC USA Finance LLC, 144A 3.8% 01/11/2025	USD	160,000	171,692	0.06
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2014-2A 'A', 144A 1.06% 15/08/2018	USD	2,830	2,829	-
Expedia, Inc., 144A 5% 15/02/2026	USD	765,000	794,919	0.27
Express Scripts Holding Co. 3.3% 25/02/2021	USD	35,000	36,754	0.01
Express Scripts Holding Co. 4.5% 25/02/2025	USD	980,000	1,079,764	0.36
Express Scripts Holding Co. 4.8% 15/07/2046	USD	220,000	221,494	0.07
FHLMC, FRN, Series 2014-HQ2 'M2' 2.653% 25/09/2024	USD	250,000	250,309	0.08
FHLMC, FRN, Series 2015-DN1 'M2' 2.853% 25/01/2025	USD	250,000	252,116	0.09

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA1 'M2' 2.303% 25/10/2027	USD	250,000	249,929	0.08
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA2 'M2' 3.046% 25/12/2027	USD	250,000	254,966	0.09
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA3 'M2' 3.303% 25/04/2028	USD	250,000	256,726	0.09
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ1 'M2' 2.646% 25/03/2025	USD	250,000	251,181	0.08
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ2 'M2' 2.403% 25/05/2025	USD	250,000	248,198	0.08
FHLMC, FRN, Series 2015-HQA1 'M2' 3.103% 25/03/2028	USD	250,000	255,846	0.09
FHLMC, FRN, Series 2016-DNA1 'M2' 3.353% 25/07/2028	USD	250,000	257,096	0.09
FHLMC, FRN, Series 2016-DNA3 'M2' 2.446% 25/12/2028	USD	430,000	430,915	0.15
FHLMC, Series K025 'A1' 1.875% 25/04/2022	USD	104,519	106,263	0.04
FHLMC, Series K502 'A2' 1.426% 25/08/2017	USD	57,886	58,077	0.02
FHLMC A26586 6% 01/09/2034	USD	4,031	4,664	-
FHLMC A71375 6% 01/01/2038	USD	2,477	2,819	-
FHLMC A71803 6% 01/01/2038	USD	2,402	2,732	-
FHLMC A90053 4.5% 01/12/2039	USD	70,995	78,235	0.03
FHLMC A91947 5% 01/04/2040	USD	15,623	17,262	0.01
FHLMC A93451 4.5% 01/08/2040	USD	262,728	288,552	0.10
FHLMC A94185 4% 01/10/2040	USD	3,048	3,278	-
FHLMC A94251 4% 01/10/2040	USD	2,091	2,249	-
FHLMC A94576 4% 01/10/2040	USD	1,207	1,292	-
FHLMC A94713 4% 01/11/2040	USD	2,175	2,338	-
FHLMC A95734 4% 01/12/2040	USD	19,291	21,017	0.01
FHLMC A96312 4% 01/01/2041	USD	86,216	92,715	0.03
FHLMC A97620 4.5% 01/03/2041	USD	2,987	3,281	-
FHLMC C01787 6% 01/02/2034	USD	67,292	77,843	0.03
FHLMC C04238 3.5% 01/09/2042	USD	413,857	436,405	0.15
FHLMC C09036 3.5% 01/03/2043	USD	248,098	261,413	0.09
FHLMC C09042 3.5% 01/05/2043	USD	186,429	196,448	0.07
FHLMC E01341 5.5% 01/03/2018	USD	4,881	5,020	-
FHLMC E01497 5.5% 01/11/2018	USD	2,005	2,081	-
FHLMC G01777 6% 01/02/2035	USD	59,197	68,490	0.02
FHLMC G01899 6% 01/09/2035	USD	20,844	23,854	0.01
FHLMC G02712 6% 01/12/2028	USD	9,891	11,431	-
FHLMC G03551 6% 01/11/2037	USD	78,353	89,498	0.03
FHLMC G04814 5.5% 01/10/2038	USD	285,903	322,326	0.11
FHLMC G05535 4.5% 01/07/2039	USD	157,291	172,155	0.06
FHLMC G05659 4.5% 01/10/2039	USD	225,665	247,446	0.08
FHLMC G05955 5% 01/08/2040	USD	154,794	171,223	0.06
FHLMC G05958 5% 01/08/2040	USD	374,577	414,191	0.14
FHLMC G06231 4% 01/12/2040	USD	137,351	147,714	0.05
FHLMC G06252 4% 01/02/2041	USD	3,589	3,889	-
FHLMC G06506 4% 01/12/2040	USD	709	762	-
FHLMC G07543 4.5% 01/08/2041	USD	35,550	39,236	0.01
FHLMC G08016 6% 01/10/2034	USD	334,392	386,856	0.13
FHLMC G08534 3% 01/06/2043	USD	364,756	378,334	0.13
FHLMC G08677 4% 01/11/2045	USD	1,492,569	1,601,123	0.54
FHLMC G18465 2.5% 01/05/2028	USD	141,758	146,743	0.05
FHLMC G60038 3.5% 01/01/2044	USD	195,124	205,721	0.07
FHLMC G60180 4.5% 01/05/2042	USD	175,734	192,850	0.07
FHLMC G60334 4.5% 01/10/2041	USD	134,700	147,571	0.05
FHLMC G60440 3.5% 01/03/2046	USD	1,270,217	1,355,350	0.46
FHLMC J03640 6% 01/10/2021	USD	23,568	25,098	0.01
FHLMC J15139 4% 01/05/2026	USD	61,914	66,053	0.02

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FHLMC 004674 4% 01/12/2041	USD	54,562	58,685	0.02
FHLMC 014426 3% 01/01/2043	USD	509,626	528,838	0.18
FHLMC 040647 3.5% 01/05/2046	USD	458,302	485,068	0.16
FHLMC U90932 3% 01/02/2043	USD	45,913	47,588	0.02
FHLMC U91090 3% 01/03/2043	USD	22,069	22,874	0.01
FHLMC V80025 3% 01/04/2043	USD	39,898	41,424	0.01
FirstEnergy Transmission LLC, 144A 4.35% 15/01/2025	USD	480,000	509,844	0.17
Florida Hurricane Catastrophe Fund Finance Corp. 1.298% 01/07/2016	USD	125,000	125,003	0.04
Florida Hurricane Catastrophe Fund Finance Corp. 2.995% 01/07/2020	USD	365,000	383,443	0.13
FNMA, FRN 763199 2.233% 01/10/2033	USD	15,639	16,160	0.01
FNMA, FRN 848522 2.236% 01/12/2035	USD	17,425	18,359	0.01
FNMA 7.125% 15/01/2030	USD	100,000	157,531	0.05
FNMA 190360 5% 01/08/2035	USD	32,014	35,650	0.01
FNMA 254140 5.5% 01/01/2017	USD	1,288	1,298	-
FNMA 254903 5% 01/10/2033	USD	19,223	21,467	0.01
FNMA 545759 6.5% 01/07/2032	USD	32,023	38,026	0.01
FNMA 555526 5.5% 01/05/2018	USD	3,789	3,884	-
FNMA 670373 6.5% 01/09/2017	USD	6,425	6,506	-
FNMA 725027 5% 01/11/2033	USD	20,147	22,500	0.01
FNMA 725229 6% 01/03/2034	USD	100,189	116,311	0.04
FNMA 725232 5% 01/03/2034	USD	8,280	9,248	-
FNMA 725238 5% 01/03/2034	USD	34,679	38,729	0.01
FNMA 725423 5.5% 01/05/2034	USD	257,333	292,010	0.10
FNMA 735061 6% 01/11/2034	USD	11,531	13,274	-
FNMA 735115 6% 01/12/2034	USD	3,607	4,167	-
FNMA 735141 5.5% 01/01/2035	USD	62,946	71,504	0.02
FNMA 735318 4.5% 01/11/2019	USD	9,676	9,957	-
FNMA 735500 5.5% 01/05/2035	USD	22,029	25,017	0.01
FNMA 735502 6% 01/04/2035	USD	6,819	7,856	-
FNMA 735575 5.5% 01/12/2018	USD	2,882	2,937	-
FNMA 735578 5% 01/06/2035	USD	54,678	60,925	0.02
FNMA 735579 5% 01/06/2035	USD	8,390	9,358	-
FNMA 735580 5% 01/06/2035	USD	4,810	5,367	-
FNMA 735591 5% 01/06/2035	USD	2,361	2,635	-
FNMA 735667 5% 01/07/2035	USD	15,966	17,825	0.01
FNMA 735669 5% 01/04/2035	USD	12,822	14,316	0.01
FNMA 735676 5% 01/07/2035	USD	1,159,689	1,293,889	0.44
FNMA 735997 5.5% 01/11/2035	USD	20,256	23,006	0.01
FNMA 745428 5.5% 01/01/2036	USD	132,867	150,592	0.05
FNMA 745458 6% 01/04/2036	USD	348	399	-
FNMA 745947 6.5% 01/10/2036	USD	5,958	6,946	-
FNMA 750412 6.5% 01/11/2033	USD	16,672	19,179	0.01
FNMA 888223 5.5% 01/01/2036	USD	24,661	27,976	0.01
FNMA 888264 5.5% 01/04/2037	USD	97,052	109,172	0.04
FNMA 888430 5% 01/11/2033	USD	20,514	22,906	0.01
FNMA 888437 5.5% 01/11/2036	USD	373,031	421,300	0.14
FNMA 889117 5% 01/10/2035	USD	303,496	338,926	0.11
FNMA 889298 5% 01/12/2036	USD	70,493	78,378	0.03
FNMA 889307 5% 01/07/2037	USD	24,351	27,194	0.01
FNMA 889579 6% 01/05/2038	USD	5,110	5,851	-
FNMA 889829 5% 01/07/2035	USD	219,212	246,331	0.08
FNMA 890263 4% 01/11/2025	USD	103,218	110,286	0.04
FNMA 890527 4.5% 01/09/2042	USD	97,708	106,970	0.04
FNMA 890565 3% 01/11/2043	USD	236,410	245,556	0.08
FNMA 900724 5.5% 01/08/2021	USD	4,392	4,729	-
FNMA 901646 6.5% 01/12/2036	USD	1,342	1,543	-

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
FNMA 902382 6.5% 01/11/2036	USD	10,394	12,248	-
FNMA 906064 6% 01/01/2037	USD	991	1,134	-
FNMA 933051 6.5% 01/10/2037	USD	54,429	65,598	0.02
FNMA 942477 6% 01/08/2022	USD	3,010	3,329	-
FNMA 948410 6% 01/08/2022	USD	2,729	2,913	-
FNMA 995024 5.5% 01/08/2037	USD	281,717	319,882	0.11
FNMA 995051 6% 01/03/2037	USD	86,887	99,872	0.03
FNMA 995112 5.5% 01/07/2036	USD	42,896	48,729	0.02
FNMA 995113 5.5% 01/09/2036	USD	262,714	298,358	0.10
FNMA 995203 5% 01/07/2035	USD	121,607	135,770	0.05
FNMA 995388 5.5% 01/08/2037	USD	13,655	15,487	0.01
FNMA 995434 5% 01/09/2023	USD	63,463	65,673	0.02
FNMA 995629 6.5% 01/12/2032	USD	36,293	43,615	0.01
FNMA AA4328 4% 01/04/2024	USD	72,954	77,270	0.03
FNMA AB5615 3.5% 01/07/2042	USD	52,066	55,426	0.02
FNMA AB5807 3.5% 01/08/2042	USD	102,222	108,827	0.04
FNMA AB6317 3.5% 01/09/2042	USD	27,899	29,516	0.01
FNMA AB6491 3% 01/10/2042	USD	67,619	70,970	0.02
FNMA AB6670 3% 01/10/2042	USD	52,786	55,401	0.02
FNMA AB6768 3% 01/10/2042	USD	86,123	90,129	0.03
FNMA AB7143 2.5% 01/12/2027	USD	196,715	203,998	0.07
FNMA AB7733 3% 01/01/2043	USD	255,136	265,009	0.09
FNMA AB7846 3% 01/02/2043	USD	139,134	145,562	0.05
FNMA AB8700 3% 01/03/2043	USD	889,339	932,811	0.32
FNMA AB8898 3% 01/04/2043	USD	263,373	273,542	0.09
FNMA AC9580 4.5% 01/02/2040	USD	1,057,090	1,158,747	0.39
FNMA AC9582 5.5% 01/01/2040	USD	67,987	76,750	0.03
FNMA AD0163 6% 01/11/2034	USD	327,634	380,039	0.13
FNMA AD0220 6% 01/10/2038	USD	469,643	538,435	0.18
FNMA AE0624 4% 01/11/2040	USD	110,566	119,180	0.04
FNMA AE0698 4.5% 01/12/2040	USD	43,193	47,362	0.02
FNMA AE0949 4% 01/02/2041	USD	669,427	720,029	0.24
FNMA AE3049 4.5% 01/09/2040	USD	35,110	38,496	0.01
FNMA AE7723 4% 01/11/2040	USD	79,817	85,865	0.03
FNMA AH1111 4% 01/12/2040	USD	495,665	533,019	0.18
FNMA AH3394 4% 01/01/2041	USD	143,736	154,557	0.05
FNMA AH5859 4% 01/02/2041	USD	143,265	154,071	0.05
FNMA AL0065 4.5% 01/04/2041	USD	152,969	167,743	0.06
FNMA AL0251 5% 01/07/2037	USD	4,807	5,367	-
FNMA AL0546 5% 01/07/2041	USD	193,460	215,747	0.07
FNMA AL0803 4% 01/09/2041	USD	281,732	302,997	0.10
FNMA AL1105 4.5% 01/12/2040	USD	118,642	130,132	0.04
FNMA AL1371 4% 01/01/2027	USD	183,781	195,870	0.07
FNMA AL1524 4.5% 01/12/2040	USD	31,412	34,407	0.01
FNMA AL1577 5% 01/01/2042	USD	33,401	37,195	0.01
FNMA AL1697 4% 01/10/2041	USD	404,866	435,328	0.15
FNMA AL1938 4% 01/12/2026	USD	55,824	59,646	0.02
FNMA AL2462 2.5% 01/10/2027	USD	226,719	235,117	0.08
FNMA AL2579 4% 01/12/2026	USD	206,704	220,833	0.07
FNMA AL2645 4.5% 01/01/2027	USD	215,014	230,920	0.08
FNMA AL2661 4% 01/10/2026	USD	22,506	24,045	0.01
FNMA AL3192 5% 01/05/2042	USD	157,701	175,849	0.06
FNMA AL4061 3.5% 01/08/2043	USD	36,392	38,444	0.01
FNMA AL4301 4.5% 01/04/2042	USD	75,004	82,217	0.03
FNMA AL5224 5% 01/02/2038	USD	17,006	18,958	0.01
FNMA AL5362 5% 01/09/2039	USD	262,931	293,297	0.10
FNMA AL5590 5.5% 01/09/2041	USD	11,940	13,556	-
FNMA AL6078 5% 01/03/2042	USD	38,304	42,625	0.01
FNMA AL6167 3.5% 01/01/2044	USD	93,004	99,023	0.03
FNMA AL6549 5% 01/07/2042	USD	372,833	414,900	0.14

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FNMA AL6966 6.5% 01/08/2038	USD	48,402	57,914	0.02
FNMA AL7033 5% 01/06/2039	USD	31,280	34,836	0.01
FNMA AL7035 5% 01/12/2038	USD	44,869	49,945	0.02
FNMA AL7389 4% 01/03/2029	USD	145,629	155,459	0.05
FNMA AL7522 4.5% 01/06/2044	USD	546,685	598,403	0.20
FNMA AL8045 3.5% 01/12/2042	USD	716,789	758,186	0.26
FNMA AO4163 3.5% 01/06/2042	USD	40,676	43,300	0.01
FNMA AO6755 3.5% 01/06/2042	USD	53,586	57,049	0.02
FNMA AO7977 3% 01/06/2027	USD	349,310	366,826	0.12
FNMA AO9944 3.5% 01/07/2042	USD	452,181	481,405	0.16
FNMA AP7539 3% 01/09/2027	USD	119,291	125,281	0.04
FNMA AP9785 2.5% 01/10/2027	USD	198,081	205,429	0.07
FNMA AQ0532 2.5% 01/11/2042	USD	52,440	53,048	0.02
FNMA AQ0535 3% 01/11/2042	USD	50,682	53,045	0.02
FNMA AQ8803 3.5% 01/01/2043	USD	71,000	75,595	0.03
FNMA AR2626 2.5% 01/02/2043	USD	290,328	293,704	0.10
FNMA AR7145 3.5% 01/07/2043	USD	51,194	54,645	0.02
FNMA AR9048 3% 01/03/2043	USD	19,668	20,414	0.01
FNMA AR9139 3% 01/03/2043	USD	18,018	18,702	0.01
FNMA AR9188 2.5% 01/03/2043	USD	68,495	69,291	0.02
FNMA AS0024 3.5% 01/07/2043	USD	121,004	127,828	0.04
FNMA AS0519 3.5% 01/09/2043	USD	59,307	62,640	0.02
FNMA AS0526 3.5% 01/09/2043	USD	41,910	44,273	0.02
FNMA AS0563 4.5% 01/09/2043	USD	433,096	472,592	0.16
FNMA AS1585 4.5% 01/01/2044	USD	552,467	602,848	0.20
FNMA AS2275 4.5% 01/04/2044	USD	153,171	167,444	0.06
FNMA AS3855 3.5% 01/11/2044	USD	30,727	32,799	0.01
FNMA AS4794 3.5% 01/04/2045	USD	1,095,539	1,163,780	0.39
FNMA AS4835 3% 01/04/2045	USD	24,419	25,377	0.01
FNMA AS4864 2.5% 01/05/2030	USD	808,730	839,613	0.28
FNMA AS5298 2.5% 01/07/2030	USD	303,451	314,584	0.11
FNMA AS5713 3.5% 01/09/2045	USD	562,422	593,826	0.20
FNMA AS6313 4% 01/12/2045	USD	394,370	425,775	0.14
FNMA AS6324 3.5% 01/12/2045	USD	3,334,118	3,517,060	1.19
FNMA AS6328 3.5% 01/12/2045	USD	565,973	596,992	0.20
FNMA AS6349 4% 01/12/2045	USD	397,015	430,762	0.15
FNMA AS6351 4% 01/12/2045	USD	53,315	57,272	0.02
FNMA AS6563 3.5% 01/01/2046	USD	24,534	26,056	0.01
FNMA AS7079 2.5% 01/04/2031	USD	1,639,141	1,696,503	0.57
FNMA AS7269 2.5% 01/06/2031	USD	64,588	66,867	0.02
FNMA AS7290 2.5% 01/06/2031	USD	24,818	25,687	0.01
FNMA AS9031 3% 01/06/2033	USD	22,214	23,298	0.01
FNMA AS9032 3% 01/08/2043	USD	92,481	96,007	0.03
FNMA AS9043 3% 01/04/2033	USD	9,038	9,485	-
FNMA AS9044 3% 01/08/2043	USD	161,675	168,149	0.06
FNMA AS9236 3% 01/02/2044	USD	21,980	22,797	0.01
FNMA AS9241 3% 01/09/2044	USD	29,856	31,025	0.01
FNMA AT0238 2.5% 01/03/2043	USD	65,593	66,355	0.02
FNMA AT1934 3.5% 01/04/2043	USD	36,763	38,854	0.01
FNMA AT2016 3% 01/04/2043	USD	258,308	268,256	0.09
FNMA AT2060 2.5% 01/04/2028	USD	192,947	200,746	0.07
FNMA AT2612 3.5% 01/09/2043	USD	51,506	54,408	0.02
FNMA AT2717 2.5% 01/05/2043	USD	187,376	189,555	0.06
FNMA AT2723 3% 01/05/2043	USD	444,638	461,789	0.16
FNMA AT8139 3.5% 01/08/2043	USD	62,104	65,637	0.02
FNMA AT8975 3.5% 01/07/2043	USD	38,975	41,173	0.01
FNMA AT9290 3.5% 01/07/2043	USD	39,352	41,572	0.01
FNMA AU0081 3.5% 01/09/2043	USD	69,645	73,536	0.02
FNMA AU0640 3.5% 01/07/2043	USD	36,761	38,852	0.01

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FNMA AU6196 3.5% 01/08/2043	USD	42,752	45,183	0.02
FNMA AU7438 3.5% 01/08/2043	USD	38,634	40,793	0.01
FNMA AU7743 3.5% 01/09/2043	USD	45,844	48,400	0.02
FNMA AU7753 3.5% 01/09/2043	USD	41,448	43,758	0.01
FNMA AU7868 3.5% 01/09/2043	USD	69,151	72,906	0.02
FNMA AX2501 4% 01/10/2044	USD	142,615	152,847	0.05
FNMA AX2509 3% 01/10/2029	USD	607,874	637,536	0.22
FNMA AY3425 3.5% 01/05/2045	USD	246,114	259,838	0.09
FNMA AZ0880 2.5% 01/07/2030	USD	95,579	99,055	0.03
FNMA AZ2118 3% 01/10/2030	USD	72,269	75,796	0.03
FNMA AZ2667 3.5% 01/10/2045	USD	94,702	100,263	0.03
FNMA AZ7353 3.5% 01/11/2045	USD	1,430,720	1,508,906	0.51
FNMA BC0880 3.5% 01/05/2046	USD	701,535	740,010	0.25
FNMA MA0561 4% 01/11/2040	USD	287,187	309,038	0.10
FNMA MA0583 4% 01/12/2040	USD	188,055	202,260	0.07
FNMA MA0907 4% 01/11/2041	USD	41,353	44,452	0.02
FNMA MA0971 4% 01/02/2042	USD	60,331	64,858	0.02
FNMA MA1086 3.5% 01/06/2042	USD	70,000	74,042	0.03
FNMA MA1283 3.5% 01/12/2042	USD	176,803	188,044	0.06
FNMA MA2471 3.5% 01/12/2045	USD	229,182	241,725	0.08
FNMA MA2495 3.5% 01/01/2046	USD	907,552	957,257	0.32
FNMA MA2510 2.5% 01/01/2031	USD	253,590	262,465	0.09
FNMA MA2512 4% 01/01/2046	USD	138,959	149,087	0.05
FNMA MA2522 3.5% 01/02/2046	USD	1,652,185	1,742,633	0.59
FNMA MA2549 3.5% 01/03/2046	USD	1,368,012	1,442,836	0.49
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2014-C04 '1M1' 2.396% 25/11/2024	USD	51,223	51,444	0.02
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2014-C04 '2M1' 2.546% 25/11/2024	USD	21,362	21,448	0.01
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2015-C01 '1M1' 1.946% 25/02/2025	USD	13,274	13,285	-
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2016-C02 '1M1' 2.596% 25/09/2028	USD	191,579	193,920	0.07
Ford Credit Auto Lease Trust, Series 2015-B 'A4' 1.54% 15/02/2019	USD	440,000	441,316	0.15
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2012-D 'D' 1.97% 15/05/2019	USD	270,000	270,408	0.09
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2013-B 'D' 1.82% 15/11/2019	USD	380,000	380,390	0.13
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2013-C 'D' 2.5% 15/01/2020	USD	245,000	247,836	0.08
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2014-1 'A', 144A 2.26% 15/11/2025	USD	260,000	265,368	0.09
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2014-C 'A4' 1.56% 15/02/2020	USD	40,000	40,262	0.01
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2016-2 'A', 144A 2.03% 15/12/2027	USD	685,000	685,204	0.23
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2016-A 'A4' 1.6% 15/06/2021	USD	235,000	238,109	0.08
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2012-5 'A' 1.49% 15/09/2019	USD	435,000	437,157	0.15
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K43 'B', 144A 3.735% 25/02/2048	USD	155,000	151,029	0.05
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K45 'B', 144A 3.591% 25/04/2048	USD	110,000	105,637	0.04
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K46 'B', 144A 3.819% 25/04/2048	USD	195,000	188,562	0.06

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K47 'B', 144A 3.724% 25/06/2048	USD	105,000	101,083	0.03
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K48 'B', 144A 3.636% 25/06/2048	USD	80,000	76,605	0.03
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K718 'B', 144A 3.547% 25/02/2022	USD	205,000	201,621	0.07
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K720 'B', 144A 3.389% 25/07/2022	USD	175,000	166,790	0.06
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2015-3 'A4' 1.81% 20/11/2019	USD	360,000	361,788	0.12
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2016-2 'B' 2.06% 20/03/2020	USD	205,000	205,445	0.07
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2016-2 'C' 2.58% 20/03/2020	USD	125,000	125,131	0.04
GMF Floorplan Owner Revolving Trust, Series 2016-1 'A1', 144A 1.96% 17/05/2021	USD	310,000	312,368	0.11
GMF Floorplan Owner Revolving Trust, Series 2016-1 'B', 144A 2.41% 17/05/2021	USD	100,000	100,629	0.03
GNMA, IO, Series 2010-103 '1N' 4.5% 20/02/2039	USD	28,616	982	-
GNMA, IO, Series 2010-92 'P1' 4.5% 20/11/2037	USD	95,919	2,812	-
GNMA, IO, Series 2011-41 'A1' 4.5% 20/12/2039	USD	222,012	13,954	-
GNMA, IO, Series 2011-88 'E1' 4.5% 20/11/2039	USD	36,274	2,272	-
GNMA, IO, Series 2012-94 'B1' 4% 20/05/2037	USD	175,287	22,045	0.01
GNMA, IO, Series 2013-24 'O1' 4% 20/02/2043	USD	76,549	10,620	-
GNMA, IO, Series 2013-62 'G3' 3.5% 20/05/2043	USD	207,379	38,071	0.01
GNMA 3306 5.5% 20/11/2032	USD	108,734	122,272	0.04
GNMA 3490 6.5% 20/12/2033	USD	105,271	121,946	0.04
GNMA 3611 6% 20/09/2034	USD	63,604	75,058	0.03
GNMA 4060 6% 20/12/2037	USD	7,955	9,099	-
GNMA 4558 4.5% 20/10/2039	USD	171,646	187,431	0.06
GNMA 4559 5% 20/10/2039	USD	36,250	40,355	0.01
GNMA 4577 4.5% 20/11/2039	USD	17,254	18,794	0.01
GNMA 4715 5% 20/06/2040	USD	25,688	28,592	0.01
GNMA 4772 5% 20/08/2040	USD	18,138	20,190	0.01
GNMA 4800 4% 20/09/2040	USD	76,989	82,968	0.03
GNMA 4801 4.5% 20/09/2040	USD	70,633	77,140	0.03
GNMA 4833 4% 20/10/2040	USD	47,661	51,363	0.02
GNMA 4834 4.5% 20/10/2040	USD	57,636	62,946	0.02
GNMA 4854 4.5% 20/11/2040	USD	60,169	65,712	0.02
GNMA 4882 4% 20/12/2040	USD	126,411	136,228	0.05
GNMA 4946 4.5% 20/02/2041	USD	228,721	249,794	0.08
GNMA 4978 4.5% 20/03/2041	USD	63,032	68,840	0.02
GNMA 4979 5% 20/03/2041	USD	145,848	162,348	0.05
GNMA 5054 4% 20/05/2041	USD	101,975	109,870	0.04
GNMA 710927 5% 15/10/2039	USD	20,878	23,465	0.01
GNMA 723339 5% 15/09/2039	USD	36,205	41,024	0.01
GNMA 782888 5% 15/02/2040	USD	51,719	59,160	0.02
GNMA 782889 5% 15/02/2040	USD	51,719	59,186	0.02
GNMA 783403 3.5% 15/09/2041	USD	107,733	114,356	0.04
GNMA 783726 3.5% 20/03/2043	USD	151,785	161,130	0.05

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
GNMA 783972 5% 15/12/2039	USD	216,895	245,930	0.08
GNMA 784012 5.5% 15/10/2038	USD	13,512	15,561	0.01
GNMA 784057 4.5% 15/09/2045	USD	434,624	479,507	0.16
GNMA 784069 5% 15/06/2040	USD	91,762	103,943	0.04
GNMA 784145 3.5% 20/02/2046	USD	376,980	401,531	0.14
GNMA AA3342 3% 15/10/2042	USD	15,682	16,366	0.01
GNMA AA6403 3% 15/05/2043	USD	19,686	20,586	0.01
GNMA AD1732 2.5% 15/02/2043	USD	66,200	69,390	0.02
GNMA AJ9334 3.5% 20/10/2044	USD	38,563	41,176	0.01
GNMA AL4508 3.5% 20/02/2045	USD	79,675	85,106	0.03
GNMA AM4385 3.5% 20/05/2045	USD	29,388	31,391	0.01
GNMA AM4931 3.5% 20/04/2045	USD	27,853	29,748	0.01
GNMA AM8053 3.5% 20/05/2045	USD	59,217	63,253	0.02
GNMA AR0556 3.5% 20/01/2046	USD	24,731	26,418	0.01
GNMA AR7632 3.5% 20/02/2046	USD	386,506	412,776	0.14
GNMA AS8186 3.5% 20/05/2046	USD	24,964	26,661	0.01
GNMA AS9176 3.5% 20/05/2046	USD	24,961	26,657	0.01
GNMA AT4041 3.5% 20/05/2046	USD	4,989	5,328	-
GNMA MA0219 3% 20/07/2042	USD	66,476	69,652	0.02
GNMA MA0221 4% 20/07/2042	USD	193,572	208,115	0.07
GNMA MA0318 3.5% 20/08/2042	USD	193,354	205,975	0.07
GNMA MA0392 3.5% 20/09/2042	USD	63,453	67,595	0.02
GNMA MA0393 4% 20/09/2042	USD	13,190	14,177	-
GNMA MA0535 4% 20/11/2042	USD	117,041	125,763	0.04
GNMA MA0623 2.5% 20/12/2042	USD	735,612	754,333	0.25
GNMA MA0624 3% 20/12/2042	USD	251,394	263,404	0.09
GNMA MA0625 3.5% 20/12/2042	USD	81,413	86,727	0.03
GNMA MA0697 2.5% 20/01/2043	USD	448,535	459,948	0.16
GNMA MA0699 3.5% 20/01/2043	USD	1,313,191	1,398,907	0.47
GNMA MA0783 3.5% 20/02/2043	USD	65,582	69,863	0.02
GNMA MA1011 3% 20/05/2043	USD	121,349	127,146	0.04
GNMA MA1012 3.5% 20/05/2043	USD	680,081	724,343	0.24
GNMA MA1088 2.5% 20/06/2043	USD	167,810	172,082	0.06
GNMA MA1155 2.5% 20/07/2043	USD	107,198	109,926	0.04
GNMA MA1157 3.5% 20/07/2043	USD	490,704	522,676	0.18
GNMA MA1284 3% 20/09/2043	USD	130,136	136,355	0.05
GNMA MA1285 3.5% 20/09/2043	USD	628,155	668,974	0.23
GNMA MA1678 4% 20/02/2044	USD	483,516	517,209	0.17
GNMA MA2222 3% 20/09/2044	USD	260,994	272,952	0.09
GNMA MA2890 2.5% 20/06/2045	USD	911,138	930,101	0.31
GNMA MA2895 5.5% 20/06/2045	USD	303,742	334,478	0.11
GNMA MA3174 4% 20/10/2045	USD	276,339	295,848	0.10
GNMA MA3245 4% 20/11/2045	USD	1,528,087	1,638,059	0.55
GNMA MA3311 4% 20/12/2045	USD	1,105,392	1,185,165	0.40
GNMA MA3595 2.5% 20/04/2046	USD	577,632	588,881	0.20
GNMA MA3736 3.5% 20/06/2046	USD	840,000	892,673	0.30
Grain Spectrum Funding LLC, 144A 4% 10/10/2018	USD	195,000	195,253	0.07
GS Mortgage Securities Corp. II, Series 2012-GCJ9 'A3' 2.773% 10/11/2045	USD	135,000	141,367	0.05
GS Mortgage Securities Trust, Series 2015-GC28 'A5' 3.396% 10/02/2048	USD	500,000	535,630	0.18
GS Mortgage Securities Trust, Series 2015-GC34 'A4' 3.506% 10/10/2048	USD	240,000	260,020	0.09
GS Mortgage-Backed Securities Trust, FRN, Series 2014-EB1A '2A1', 144A 2.492% 25/07/2044	USD	72,388	73,303	0.02
GSAA Trust, FRN, Series 2005-8 'A3' 0.883% 25/06/2035	USD	62,373	58,863	0.02
Hilton Grand Vacations Trust, Series 2014-AA 'A', 144A 1.77% 25/11/2026	USD	83,911	82,651	0.03

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
HOA Funding LLC, Series 2014-1A 'A2', 144A 4.846% 20/08/2044	USD	159,225	150,176	0.05
Honda Auto Receivables Owner Trust, Series 2014-4 'A4' 1.46% 15/10/2020	USD	30,000	30,187	0.01
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2015-B 'A4', 144A 1.66% 15/07/2019	USD	310,000	311,788	0.11
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2016-A 'A4', 144A 1.8% 16/12/2019	USD	240,000	243,109	0.08
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2016-B 'A3', 144A 1.52% 15/10/2019	USD	160,000	161,054	0.05
Hyundai Auto Receivables Trust, Series 2016-A 'A4' 1.73% 16/05/2022	USD	305,000	305,707	0.10
INVISTA Finance LLC, 144A 4.25% 15/10/2019	USD	60,000	58,739	0.02
J.P. Morgan Chase & Co. 3.875% 10/09/2024	USD	620,000	643,427	0.22
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2006-LDP7 'AM' 5.981% 17/04/2045	USD	265,037	264,709	0.09
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2006-LDP8 'AJ' 5.48% 15/05/2045	USD	30,000	30,047	0.01
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-CB19 'A4' 5.699% 12/02/2049	USD	140,771	143,959	0.05
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-CB19 'AM' 5.699% 12/02/2049	USD	325,000	331,500	0.11
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-LD12 'A4' 5.882% 15/02/2051	USD	210,000	217,645	0.07
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-LD12 'AM' 6.009% 15/02/2051	USD	200,000	207,395	0.07
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2006-LDP9 'A3' 5.336% 15/05/2047	USD	142,610	143,898	0.05
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2007-CB18 'A4' 5.44% 12/06/2047	USD	145,215	147,134	0.05
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8 'A3' 2.829% 15/10/2045	USD	185,000	193,633	0.07
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-LC11 'A5' 2.96% 15/04/2046	USD	145,000	152,273	0.05
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2016-ATRM 'A', 144A 2.962% 05/10/2028	USD	270,000	275,814	0.09
JobsOhio Beverage System 'B' 4.532% 01/01/2035	USD	155,000	185,121	0.06
John Deere Owner Trust, Series 2015-A 'A4' 1.65% 15/12/2021	USD	115,000	115,794	0.04
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2014-C22 'A4' 3.801% 15/09/2047	USD	430,000	473,175	0.16
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2015-C30 'A2' 3.067% 15/07/2048	USD	55,000	58,053	0.02

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2015-C30 'A5' 3.822% 15/07/2048	USD	555,000	612,869	0.21
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2015-C31 'A3' 3.801% 15/08/2048	USD	190,000	209,725	0.07
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2016-C2 'A1' 1.423% 15/06/2049	USD	306,485	307,963	0.10
Kaiser Foundation Hospitals, Inc. 3.5% 01/04/2022	USD	250,000	269,084	0.09
Kinder Morgan Finance Co. LLC, 144A 6% 15/01/2018	USD	155,000	162,998	0.06
Kubota Credit Owner Trust, Series 2015-1A 'A3', 144A 1.54% 15/03/2019	USD	585,000	588,041	0.20
LB-UBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2007-C2 'AM' 5.493% 15/02/2040	USD	225,000	228,322	0.08
LB-UBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2007-C6 'AM' 6.114% 15/07/2040	USD	160,000	165,056	0.06
LB-UBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2008-C1 'AM' 6.085% 15/04/2041	USD	110,000	109,734	0.04
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.85% 01/08/2044	USD	485,000	496,109	0.17
Los Angeles Community College District 6.75% 01/08/2049	USD	150,000	237,246	0.08
Maryland State Transportation Authority 5.754% 01/07/2041	USD	85,000	115,367	0.04
Maryland State Transportation Authority 5.888% 01/07/2043	USD	165,000	228,131	0.08
Mercedes Benz Auto Lease Trust, Series 2015-A 'A4' 1.21% 15/10/2020	USD	150,000	150,205	0.05
Merrill Lynch Mortgage Trust, Series 2008-C1 'A4' 5.69% 12/02/2051	USD	73,028	76,146	0.03
Metropolitan Transportation Authority 7.336% 15/11/2039	USD	80,000	129,112	0.04
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2014-AA 'A4', 144A 1.59% 08/02/2022	USD	110,000	110,560	0.04
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2015-AA 'A4', 144A 1.93% 16/07/2021	USD	100,000	101,340	0.03
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2016-AA 'A4', 144A 1.76% 17/01/2023	USD	335,000	337,410	0.11
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015-C24 'AS' 4.036% 15/05/2048	USD	60,000	65,585	0.02
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015-C24 'B' 4.354% 15/05/2048	USD	110,000	118,279	0.04
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015-C24 'C' 4.354% 15/05/2048	USD	80,000	73,595	0.03
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C22 'A4' 3.306% 15/04/2048	USD	100,000	106,741	0.04
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C27 'A4' 3.753% 15/12/2047	USD	1,790,000	1,973,536	0.57
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C27 'AS' 4.068% 15/12/2047	USD	115,000	125,353	0.04
Morgan Stanley Capital I Trust, FRN, Series 2015-MS1 'AS' 4.029% 15/05/2048	USD	20,000	21,977	0.01

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Morgan Stanley Capital I Trust, FRN, Series 2015-MS1 'B' 4.029% 15/05/2048	USD	55,000	57,843	0.02
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2015-MS1 'A4' 3.779% 15/05/2048	USD	150,000	165,745	0.06
MWV Owner Trust, Series 2013-1A 'A', 144A 2.15% 22/04/2030	USD	80,124	79,541	0.03
MWV Owner Trust, Series 2014-1A 'A', 144A 2.25% 22/09/2031	USD	63,705	62,734	0.02
Nationstar HECM Loan Trust, Series 2016-1A 'A', 144A 2.981% 25/02/2026	USD	85,923	86,048	0.03
New York City Transitional Finance Authority 5.508% 01/06/2037	USD	175,000	233,116	0.08
New York City Water & Sewer System 5.952% 15/06/2042	USD	320,000	474,010	0.16
New York State Dormitory Authority 3.879% 01/07/2046	USD	550,000	572,677	0.19
Nissan Auto Receivables Owner Trust, Series 2016-A 'A4' 1.59% 15/07/2022	USD	110,000	111,216	0.04
Nissan Auto Receivables Owner Trust, Series 2016-B 'A4' 1.54% 17/10/2022	USD	370,000	371,786	0.13
Nissan Master Owner Trust, Series 2015-A 'A2' 1.44% 15/01/2020	USD	185,000	185,672	0.06
Nordstrom Credit Card Master Note Trust II, Series 2011-1A 'A', 144A 2.28% 15/11/2019	USD	385,000	386,438	0.13
North Carolina Eastern Municipal Power Agency 1.561% 01/07/2017	USD	60,000	60,402	0.02
North Carolina Eastern Municipal Power Agency 2.003% 01/07/2018	USD	5,000	5,069	-
OneMain Financial Issuance Trust, Series 2016-1A 'A', 144A 3.66% 20/02/2029	USD	100,000	102,471	0.03
OneMain Financial Issuance Trust, Series 2016-2A 'A', 144A 4.1% 20/03/2028	USD	100,000	103,225	0.04
O'Reilly Automotive, Inc. 4.875% 14/01/2021	USD	175,000	195,372	0.07
Palisades Center Trust, Series 2016- PLSD 'A', 144A 2.713% 13/04/2033	USD	445,000	452,648	0.15
Port Authority of New York and New Jersey 4.458% 01/10/2062	USD	330,000	380,111	0.13
Priceline Group, Inc. (The) 3.65% 15/03/2025	USD	365,000	387,774	0.13
Priceline Group, Inc. (The) 3.6% 01/06/2026	USD	345,000	355,943	0.12
Principal Financial Group, Inc., FRN 4.7% 15/05/2055	USD	220,000	215,826	0.07
QVC, Inc. 3.125% 01/04/2019	USD	335,000	343,390	0.12
QVC, Inc. 5.125% 02/07/2022	USD	55,000	58,791	0.02
QVC, Inc. 4.375% 15/03/2023	USD	225,000	228,625	0.08
QVC, Inc. 4.85% 01/04/2024	USD	320,000	333,792	0.11
QVC, Inc. 4.45% 15/02/2025	USD	545,000	548,611	0.19
San Diego County Water Authority Financing Corp. 'B' 6.138% 01/05/2049	USD	70,000	100,871	0.03
SBA Tower Trust, 144A 2.933% 15/12/2017	USD	150,000	150,307	0.05
SBA Tower Trust, 144A 2.898% 15/10/2019	USD	175,000	177,560	0.06
SBA Tower Trust, 144A 3.156% 15/10/2020	USD	300,000	304,500	0.10
SBA Tower Trust, 144A 3.869% 15/10/2024	USD	150,000	154,231	0.05
Schlumberger Holdings Corp., 144A 3% 21/12/2020	USD	185,000	192,910	0.07

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Schlumberger Holdings Corp., 144A 4% 21/12/2025	USD	350,000	376,835	0.13
Sierra Timehare Receivables Funding LLC, Series 2014-3A 'A', 144A 2.3% 20/10/2031	USD	41,656	41,791	0.01
Sierra Timehare Receivables Funding LLC, Series 2015-1A 'A', 144A 2.4% 22/03/2032	USD	156,307	156,745	0.05
Sierra Timehare Receivables Funding LLC, Series 2015-2A 'A', 144A 2.43% 20/06/2032	USD	184,946	186,930	0.06
Sierra Timehare Receivables Funding LLC, Series 2015-3A 'A', 144A 2.58% 20/09/2032	USD	613,340	618,991	0.21
Sirius XM Radio, Inc., 144A 5.25% 15/08/2022	USD	380,000	399,475	0.14
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-4 'A4' 2.288% 25/07/2022	USD	100,000	100,138	0.03
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-5 'A4' 2.338% 25/07/2023	USD	191,808	192,024	0.07
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-9 'A' 2.138% 25/04/2023	USD	130,697	130,730	0.04
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-A 'A2A', 144A 2.49% 15/06/2027	USD	130,000	131,332	0.04
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-B 'A2A', 144A 2.98% 15/07/2027	USD	150,000	154,780	0.05
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-C 'A2A', 144A 2.75% 15/07/2027	USD	185,000	189,139	0.06
SMB Private Education Loan Trust, Series 2016-A 'A2A', 144A 2.7% 15/05/2031	USD	105,000	106,571	0.04
South Carolina State Public Service Authority 'D' 4.77% 01/12/2045	USD	162,000	187,831	0.06
State Board of Administration Finance Corp. 2.163% 01/07/2019	USD	110,000	113,166	0.04
SunTrust Auto Receivables Trust, Series 2015-1A 'A4', 144A 1.78% 15/01/2021	USD	495,000	498,777	0.17
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-2 'A' 2.22% 15/01/2022	USD	300,000	305,835	0.10
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-6 'A' 1.36% 17/08/2020	USD	250,000	250,726	0.08
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-7 'A' 1.76% 15/09/2022	USD	315,000	317,567	0.11
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2013-1 'B' 1.69% 15/03/2021	USD	205,000	204,899	0.07
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2014-1 'C' 1.91% 15/11/2020	USD	135,000	134,948	0.05
Time Warner Cable, Inc. 6.55% 01/05/2037	USD	415,000	488,665	0.17
Time Warner Cable, Inc. 6.75% 15/06/2039	USD	490,000	586,868	0.20
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-3 'A1B', 144A 3% 25/03/2054	USD	174,421	178,426	0.06
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-4 'A1B', 144A 2.75% 25/04/2055	USD	180,946	183,608	0.06
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-1 'A1B', 144A 2.75% 25/02/2055	USD	176,352	179,151	0.06

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-1 'A3B', 144A 3% 25/02/2055	USD	210,283	213,744	0.07
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-2 'A1A', 144A 2.75% 25/08/2055	USD	304,616	309,632	0.10
Trinity Acquisition plc 3.5% 15/09/2021	USD	65,000	66,847	0.02
United Airlines Pass Through Trust, Series 2014-2 'B' 4.625% 03/09/2022	USD	418,416	418,939	0.14
University of North Carolina at Chapel Hill 3.847% 01/12/2034	USD	210,000	240,937	0.08
US Airways Pass Through Trust, Series 2012-2 'A' 4.625% 03/06/2025	USD	95,552	101,892	0.03
US Airways Pass Through Trust, Series 2013-1 'A' 3.95% 15/11/2025	USD	108,943	115,071	0.04
US Treasury 3% 15/11/2045	USD	1,000,000	1,153,672	0.39
US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/01/2026	USD	4,150,000	4,403,202	1.49
Utah Transit Authority 'B' 5.937% 15/06/2039	USD	145,000	209,212	0.07
Utility Debt Securitization Authority, Series 2013-T 'T1' 2.042% 15/06/2021	USD	100,000	102,253	0.03
Volvo Financial Equipment LLC, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.67% 18/02/2020	USD	320,000	320,581	0.11
Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust, Series 2007-C30 'AM' 5.383% 15/12/2043	USD	315,000	320,511	0.11
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FRN, Series 2005-ARB '2AC2' 0.906% 25/07/2045	USD	323,327	289,388	0.10
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LG20 'C' 4.056% 15/04/2050	USD	105,000	100,971	0.03
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'A5' 3.767% 15/07/2058	USD	180,000	198,057	0.07
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'AS' 4.039% 15/07/2058	USD	35,000	38,595	0.01
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'B' 4.394% 15/07/2058	USD	50,000	52,893	0.02
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'C' 4.394% 15/07/2058	USD	30,000	28,840	0.01
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C29 'A4' 3.637% 15/06/2048	USD	275,000	299,941	0.10
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-NXS2 'A2' 3.02% 15/07/2058	USD	105,000	110,042	0.04
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GG1 'A4' 3.789% 15/12/2047	USD	165,000	182,134	0.06
Wendys Funding LLC, Series 2015-1A 'A2', 144A 3.371% 15/06/2045	USD	253,088	254,302	0.09
Western Digital Corp., 144A 7.375% 01/04/2023	USD	300,000	320,193	0.11
Western Gas Partners LP 4% 01/07/2022	USD	140,000	136,891	0.05
WFRBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2014-C22 'AS' 4.069% 15/09/2057	USD	1,000,000	1,097,254	0.37
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C18 'A3' 3.651% 15/12/2046	USD	100,000	107,539	0.04

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Wheels SPV 2 LLC, Series 2015-1A 'A2', 144A 1.27% 22/04/2024	USD	174,112	173,846	0.06
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2013-A 'A' 1.61% 15/12/2021	USD	1,080,000	1,085,326	0.37
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2015-A 'A3' 1.34% 15/05/2020	USD	190,000	190,881	0.06
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2016-A 'A4' 1.96% 16/05/2022	USD	225,000	230,019	0.08
			152,456,479	51.48
債券 計			159,180,823	53.75
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			159,180,823	53.75
有価証券 計			262,077,776	88.50

T B A取引

国	銘柄名	通貨	額面	評価額 USD	評価 (損)益 USD	純資産 比率 (%)
United States of America	FNMA, 3.00%, 25/07/2029	USD	2,105,000	2,205,974	13,857	0.75
United States of America	FNMA, 2.50%, 25/07/2031	USD	1,155,000	1,194,523	11,145	0.40
United States of America	FNMA, 3.00%, 25/07/2046	USD	8,690,000	9,003,655	120,542	3.04
United States of America	FNMA, 4.00%, 25/07/2046	USD	4,170,000	4,470,370	24,461	1.51
United States of America	FNMA, 4.50%, 25/07/2046	USD	660,000	720,535	1,032	0.24
United States of America	GNMA, 3.00%, 15/07/2044	USD	8,050,000	8,403,445	94,377	2.84
United States of America	GNMA, 3.50%, 15/07/2046	USD	450,000	477,211	834	0.16
	T B A取引 (ロングポジション) 計			26,475,713	266,248	8.94
	T B A取引 計			26,475,713	266,248	8.94

為替予約取引

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	決済日	取引相手先	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)
EUR	382,189	USD	423,931	31/08/2016	J.P. Morgan	1,831	-
EUR	28,900,300	USD	31,905,613	30/09/2016	Citibank	327,845	0.11
GBP	6,717,700	USD	8,890,406	29/07/2016	Barclays	138,214	0.05
為替予約取引にかかる評価益 計						467,890	0.16
EUR	22,182,900	USD	25,163,505	29/07/2016	Standard Chartered	(481,050)	(0.16)
EUR	5,903,712	USD	6,627,963	29/07/2016	J.P. Morgan	(59,025)	(0.01)
EUR	27,230,000	USD	30,529,731	31/08/2016	Citibank	(195,285)	(0.07)
EUR	5,789,475	USD	6,534,793	31/08/2016	J.P. Morgan	(85,269)	(0.04)
EUR	134,111	USD	149,667	30/09/2016	J.P. Morgan	(89)	-
USD	40,390	EUR	36,474	29/07/2016	J.P. Morgan	(194)	-
為替予約取引にかかる評価 (損) 計						(820,912)	(0.26)
為替予約取引にかかる評価 (損) 益 計						(353,022)	(0.12)

先物取引

銘柄名	契約数	通貨	グローバル エクスポージャー USD	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)
US 2 Year Note, 30/09/2016	9	USD	1,973,109	7,031	-
US Long Bond, 21/09/2016	31	USD	5,361,063	253,719	0.09
US Ultra Bond, 21/09/2016	4	USD	748,500	47,813	0.02
先物取引にかかる評価益 計				308,563	0.11
US 10 Year Note, 21/09/2016	(67)	USD	(8,905,766)	(211,680)	(0.07)
US 5 Year Note, 30/09/2016	(28)	USD	(3,417,094)	(51,702)	(0.02)
先物取引にかかる評価 (損) 計				(263,382)	(0.09)
先物取引にかかる評価 (損) 益 計				45,181	0.02

現金	35,630,118	12.03
その他資産 (負債)	(1,569,322)	(0.53)
純資産 計	296,118,572	100.00

国別投資比率

	純資産比率 (%)
アメリカ	80.65
イギリス	1.78
中国	1.40
オランダ	1.10
オーストラリア	0.88
メキシコ	0.62
フランス	0.37
カナダ	0.35
ベルギー	0.20
アイルランド	0.18
スイス	0.13
スウェーデン	0.12
香港	0.10
イタリア	0.09

	純資産比率 (%)
スペイン	0.09
バミューダ	0.08
インドネシア	0.07
パナマ	0.07
トルコ	0.07
シンガポール	0.07
チリ	0.05
ルクセンブルグ	0.03
有価証券 計	88.50
現金及びその他資産 (負債)	11.50
合計	100.00

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。

*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）

2016年6月30日現在（未監査）

1. 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は行わない。

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	2016年6月30日 現在のレート	2016年6月30日に終了した 期間の平均レート
カナダ・ドル	1.2985	NA
スイス・フラン	0.9748	NA
ユーロ	0.8996	0.8958
ノルウェー・クローネ	8.3749	NA
スウェーデン・クローナ	8.4851	NA
日本円	102.78	NA
イギリス・ポンド	0.7442	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

2016年6月30日現在、下記の通り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	Goldman Sachs	現金	2,790,000	-
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	-	1,240,000
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Barclays Bank	現金	-	370,000
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Deutsche Bank	現金	-	4,000,000
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	HSBC Bank	現金	-	2,240,000
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	J.P.Morgan	現金	-	960,000
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	RBS	現金	-	380,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Bank of America	現金	156,000	-
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	J.P.Morgan	現金	38,000	260,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Citibank	現金	-	1,461,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Goldman Sachs	現金	-	280,000

2. 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。実現損益は、デリバティブ取引の契約の終了により計上される。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

本ファンドは、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。本ファンドは、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のために登録済み適格外国機関投資家（QFII）としてまたは上海・香港相互株式交換制度（株式コネク）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効果を負担する。QFIIを通じて保有するA株は、中国国内のCNY為替レートで評価される。また、株式コネクを通じて保有しているものについては、オフショアのCNH為替レートで評価される。CNY及びCNH為替レートは異なる場合がある。つまり、異なったルートで購入した同一の発行体の株式が、同一の評価とは限らない。一般的に、本ファンドは、A株への投資に関してキャピタル・ゲイン税を課されない。

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ない。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、2016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	69.20
USアグリゲート・ボンド・ファンド	670.57
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	17.31
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	0.06
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	22.86
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	25.34

3. 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。

2016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	0.047783	2016年 1月21日
	Jd	米ドル	0.050598	2016年 2月19日
	Jd	米ドル	0.045296	2016年 3月18日
	Jd	米ドル	0.061586	2016年 4月21日
	Jd	米ドル	0.041783	2016年 5月20日
	Jd	米ドル	0.050731	2016年 6月21日
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.025854	2016年 1月21日
	Jd	米ドル	0.024308	2016年 2月19日
	Jd	米ドル	0.025207	2016年 3月18日
	Jd	米ドル	0.025845	2016年 4月21日
	Jd	米ドル	0.023541	2016年 5月20日
	Jd	米ドル	0.024532	2016年 6月21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	0.016350	2016年 2月19日
	Jd	米ドル	0.030053	2016年 5月20日

4. 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0.001%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。

5. 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。

6. 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

2016年6月30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・ロスは、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。2016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、エマージング・マーケット・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。

2016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。

エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド 5,857,785米ドル
繰り越されたキャピタル・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。

7. 関連当事者との取引

a) 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「管理会社」)により管理されている。管理会社は、管理会社報酬をファンドから受け取る権利を与えられている。管理会社は運用者に対して管理報酬以外から支払いを行う。管理会社報酬は日次ベースで算定され、月次ベースで支払われる。

ファンド名

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
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド
USラージキャップ・バリュエーション・エクイティ・ファンド
上記ファンドのクラスJ投資証券には管理会社報酬はない。

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、2016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	0.02	N/A
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	0.03	N/A
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	Jd	0.05	N/A
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	J	0.03	N/A
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	J	0.02	N/A
USラージキャップ・バリュエーション・エクイティ・ファンド	J	0.02	N/A

* 総経費率は、2016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。

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。2016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	18%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	10%
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	7%
USラージキャップ・バリュエーション・エクイティ・ファンド	14%

8. 取引費用

取引費用は、有価証券取引及びデリバティブ取引に関連したファンドに含まれた費用である。取引費用には、取引に関連した手数料及び税金を含んでいる。

2016年6月30日に終了した期間における金額は、以下の通りである。

ファンド名	通貨	取引費用 計
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	16,084
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	1,934
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	米ドル	769,668
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	米ドル	50,942
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	米ドル	189,032
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	米ドル	125,530

確定利付き商品及びデリバティブ(先物を除く)にかかる取引に対して分離して課された仲介手数料はない。

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成28年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

資産総額	10,939,072,466 円
負債総額	36,859,153 円
純資産総額 (-)	10,902,213,313 円
発行済数量	13,519,359,829 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.8064 円

(参考) 日本好配当株マザーファンド

資産総額	21,524,873,201 円
負債総額	95,196,649 円
純資産総額 (-)	21,429,676,552 円
発行済数量	15,855,182,343 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.3516 円

(参考) 世界REITマザーファンド

資産総額	1,636,536,285 円
負債総額	78,805,069 円
純資産総額 (-)	1,557,731,216 円
発行済数量	1,615,286,744 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.9644 円

(参考) グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	68,271,525,164 円
負債総額	23,609,534 円
純資産総額 (-)	68,247,915,630 円
発行済数量	43,677,767,536 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.5625 円

(参考) 新興国債券マザーファンド

資産総額	7,368,928,397 円
負債総額	28,356,342 円
純資産総額 (-)	7,340,572,055 円
発行済数量	3,617,401,705 口
1 単位当り純資産額 (/)	2.0292 円

(参考) 欧州債券マザーファンド

資産総額	1,039,237,708 円
負債総額	11,066,136 円
純資産総額 (-)	1,028,171,572 円
発行済数量	872,516,386 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.1784 円

(参考) アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	1,090,666,956 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	1,090,666,956 円
発行済数量	855,464,668 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.2749 円

(参考) コモディティ・マザーファンド

資産総額	571,020,096 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	571,020,096 円
発行済数量	1,157,551,219 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.4933 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28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、10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。

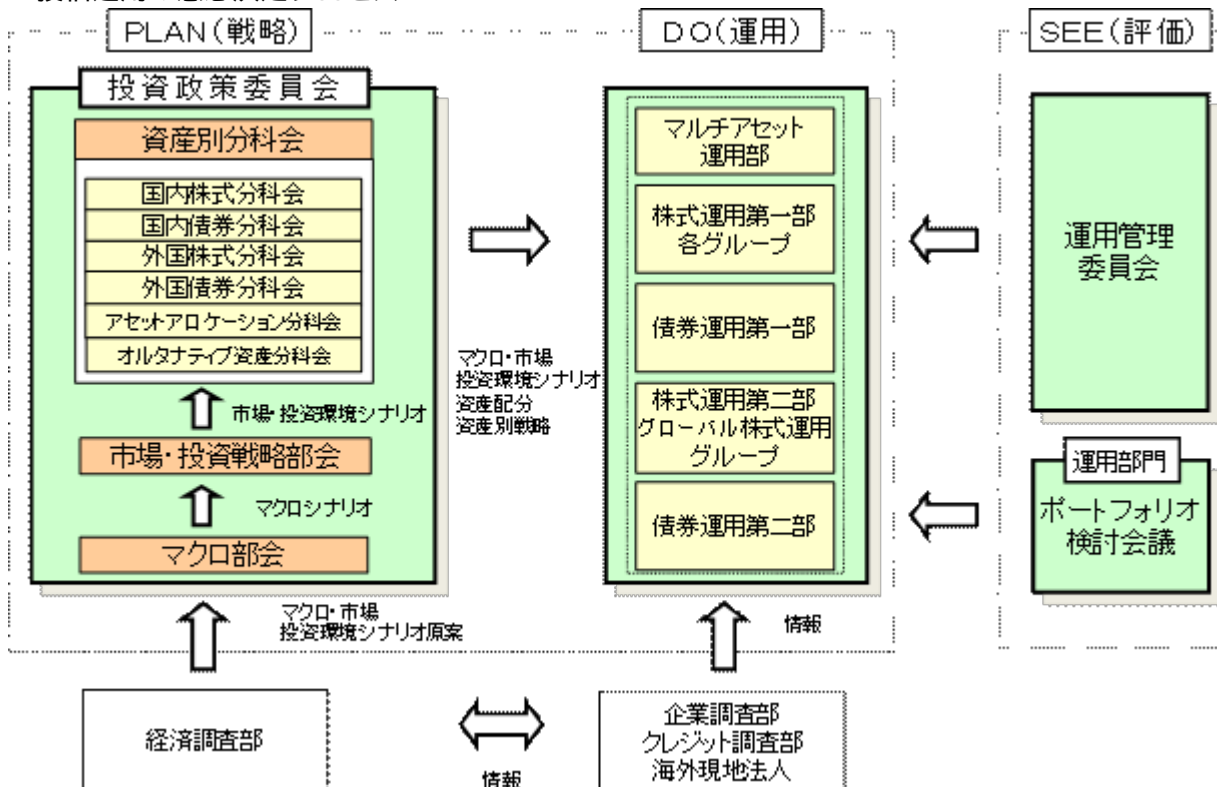
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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3分の2以上が出席し、その8分の5以上をもって行います。

< 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28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、381本であり、その純資産総額は、約3,241,764百万円です（なお、親投資信託131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	35	118,716百万円
追加型株式投資信託	289	2,813,370百万円
単位型公社債投資信託	57	309,677百万円
合計	381	3,241,764百万円

[次へ](#)

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44期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

(単位 : 千円)

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	19,107,074	22,725,768
前払費用	198,366	195,917
未収委託者報酬	3,278,499	3,678,543
未収運用受託報酬	1,001,357	957,351
未収収益	15,862	12,713
繰延税金資産	559,646	644,694
その他	7,378	824
流動資産計	24,168,184	28,215,813
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 135,473	110,648
器具備品	1 48,230	80,498
土地	710	710
リース資産	1 6,166	10,102
有形固定資産計	190,580	201,959
無形固定資産		
ソフトウェア	105,376	95,535
電話加入権	12,706	12,706
無形固定資産計	118,082	108,242
投資その他の資産		
投資有価証券	5,298,347	5,480,557
関係会社株式	1,169,774	956,115
従業員長期貸付金	3,738	2,428
長期差入保証金	510,636	511,355
出資金	82,660	82,660
繰延税金資産	561,097	556,611
その他	2,190	1,567
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産計	7,607,693	7,570,543
固定資産計	7,916,356	7,880,745
資産合計	32,084,541	36,096,558

(単位：千円)

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,042	3,565
未払金	53,907	85,383
未払手数料	1,519,563	1,620,526
未払費用	1,178,272	1,178,517
未払法人税等	1,515,891	1,923,850
未払消費税等	620,431	323,266
賞与引当金	1,220,900	1,498,000
役員賞与引当金	87,600	101,000
業務委託関連引当金	-	25,700
その他	29,244	20,860
流動負債計	6,228,853	6,780,670
固定負債		
リース債務	3,527	7,280
退職給付引当金	1,459,244	1,546,322
役員退職慰労引当金	148,160	100,350
固定負債計	1,610,931	1,653,953
負債合計	7,839,785	8,434,623

(単位：千円)

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28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	20,569,363	24,034,752
利益剰余金合計	22,013,094	25,478,483
株主資本合計	24,169,363	27,634,752
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	75,392	27,182
評価・換算差額等合計	75,392	27,182
純資産合計	24,244,756	27,661,934
負債純資産合計	32,084,541	36,096,558

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	3,613,731	4,608,029
委託者報酬	30,077,141	33,183,045
その他営業収益	54,133	45,653
営業収益計	33,745,007	37,836,728
営業費用		
支払手数料	14,599,540	15,893,270
広告宣伝費	172,450	168,848
公告費	-	1,028
調査費		
調査費	1,225,517	1,315,033
委託調査費	3,858,570	3,914,869
委託計算費	166,866	193,638
営業雑経費		
通信費	35,132	31,664
印刷費	465,810	523,643
協会費	23,810	23,203
諸会費	2,207	2,545
その他	48,630	63,792
営業費用計	20,598,538	22,131,536
一般管理費		
給料		
役員報酬	201,630	191,952
給料・手当	2,893,443	2,916,345

賞与	99,464	108,042
退職金	4,787	7,113
福利厚生費	644,228	683,822
交際費	17,830	19,339
旅費交通費	149,324	165,319
租税公課	91,224	136,339
不動産賃借料	627,983	635,313
退職給付費用	225,474	226,884
固定資産減価償却費	58,879	55,907
賞与引当金繰入額	1,174,402	1,498,000
役員退職慰労引当金繰入額	38,530	37,270
役員賞与引当金繰入額	86,300	101,100
諸経費	250,480	279,901
一般管理費計	6,563,983	7,062,654
営業利益	6,582,484	8,642,537
営業外収益		
受取配当金	18,215	17,230
受取利息	3,072	4,001
投資有価証券売却益	71,459	62,103
為替差益	397	106
その他	12,418	13,069
営業外収益計	105,563	96,510
営業外費用		
投資有価証券売却損	764	5,968
営業外費用計	764	5,968
経常利益	6,687,284	8,733,078
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	400	-
特別利益計	400	-
特別損失		
関係会社株式評価損	-	213,659
業務委託関連引当金繰入	-	25,700
固定資産除却損	95	4,215
割増退職金	7,785	-
特別損失計	7,881	243,574
税引前当期純利益	6,679,803	8,489,504
法人税、住民税及び事業税	2,602,339	3,016,713
法人税等調整額	53,385	56,198

法人税等合計	2,548,953	2,960,515
当期純利益	4,130,849	5,528,988

(3) 株主資本等変動計算書

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		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	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

第44期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	20,569,363
当期変動額						
剰余金の配当						2,063,600
当期純利益						5,528,988
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						

当期変動額合計	-	-	-	-	-	3,465,388
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	24,034,752

	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	其他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	22,013,094	24,169,363	75,392	75,392	24,244,756
当期変動額					
剰余金の配当	2,063,600	2,063,600			2,063,600
当期純利益	5,528,988	5,528,988			5,528,988
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)			48,210	48,210	48,210
当期変動額合計	3,465,388	3,465,388	48,210	48,210	3,417,178
当期末残高	25,478,483	27,634,752	27,182	27,182	27,661,934

[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>(6) 業務委託関連引当金 一部業務を外部委託するに当たり、当社が負担する従業員費用等の支出に備えるため合理的に発生すると見込まれる費用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>

(貸借対照表関係)

第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
----------------------	----------------------

1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	416,284千円	建物	438,341千円
器具備品	241,990千円	器具備品	272,516千円
リース資産	10,452千円	リース資産	13,775千円
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	7,139千円	金額	2,945千円

(株主資本等変動計算書関係)

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

第44期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1.発行済株式に関する事項

(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27年6月24日 定時株主総会	普通株式	2,063,600	536	平成27年3月31日	平成27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28年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,764,300	利益 剰余金	718	平成28年3月31日	平成28年6月24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。

第44期(平成28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	22,725,768	22,725,768	-
(2) 未収委託者報酬	3,678,543	3,678,543	-
(3) 未収運用受託報酬	957,351	957,351	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,429,421	5,429,421	-
資産計	32,791,085	32,791,085	-
(1) 未払手数料	1,620,526	1,620,526	-
(2) 未払費用(*1)	917,268	917,268	-
負債計	2,537,794	2,537,794	-

(*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43期(平成27年3月31日)	第44期(平成28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	956,115
(3) 長期差入保証金	510,636	511,355

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があるもの	428,800	2,113,200	149,744	-
合計	23,815,730	2,113,200	149,744	-

第44期（平成28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	22,725,768	-	-	-
未収委託者報酬	3,678,543	-	-	-
未収運用受託報酬	957,351	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期のあるもの	-	2,106,635	236,275	-
合計	27,361,663	2,106,635	236,275	-

（有価証券関係）

1. 子会社株式

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。

第44期（平成28年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）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。

第44期（平成28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	2,768,399	2,640,700	127,699
小計	2,768,399	2,640,700	127,699

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	2,661,022	2,749,542	88,520
小計	2,661,022	2,749,542	88,520
合計	5,429,421	5,390,242	39,178

(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

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28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	728,134	62,103	5,968

4. 減損処理を行った有価証券

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当事業年度において、関係会社株式について213,659千円の減損処理を行っております。

（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43期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第44期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	1,391,001	1,459,244
退職給付費用	162,604	162,311
退職給付の支払額	122,316	75,233
その他	27,955	-
退職給付引当金の期末残高	1,459,244	1,546,322

（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43期 （平成27年3月31日）	第44期 （平成28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	1,459,244	1,546,322
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,459,244	1,546,322
退職給付引当金	1,459,244	1,546,322
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,459,244	1,546,322

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第43期 162,604千円 第44期 162,311千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第43期は62,870千円、第44期は64,573千円であります。

(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43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
(1) 流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	107,110	119,355
賞与引当金	404,117	462,282
社会保険料	33,528	31,640
未払事業所税	4,550	4,486
その他	19,871	26,929
繰延税金資産合計	569,179	644,694
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	559,646	644,694
(2) 固定資産		
繰延税金資産		
退職給付引当金	471,999	473,920
投資有価証券	2,243	67,546
ゴルフ会員権	11,618	11,000
役員退職慰労引当金	48,561	30,899
その他	67,362	63,787
繰延税金資産小計	601,785	647,154
評価性引当額	13,861	78,546
繰延税金資産合計	587,924	568,607
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	26,826	11,996
繰延税金負債合計	26,826	11,996
繰延税金資産の純額	561,097	556,611

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43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.60%	33.10%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.56%	0.47%
住民税均等割等	0.06%	0.04%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.22%	0.95%
特定外国子会社等留保課税	0.46%	0.31%
税額控除	-	0.46%
その他	0.26%	0.46%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.16%	34.87%

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行わ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33.10%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額が81,319千円減少し、法人税等調整額が80,645千円、その他有価証券評価差額金が673千円、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。

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（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	33,183,045	4,608,029	45,653	37,836,728

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。

第44期(自平成27年4月1日 至平成28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	5,745,272	未払手数料	451,175
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	2,730,584	未払手数料	436,102

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43期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第44期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	6,297円34銭	7,184円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,072円95銭	1,436円10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43期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第44期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益(千円)	4,130,849	5,528,988
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)	4,130,849	5,528,988
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](#)

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28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28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28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。

第3【その他】

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

(以下略)

(3) 委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等を記載することがあります。

(以下略)

<訂正後>

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

(以下略)

(3) 委託会社のインターネットホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)ならびに電話番号および受付時間等を記載することがあります。

(以下略)

以上

独立監査人の監査報告書

平成28年11月11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 梅津 広 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、「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前年度3月29日から平成28年9月27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28年9月27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28年 6月10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 梅津 広 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27年4月1日から平成28年3月31日までの第44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28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。