

【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29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29年6月27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29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29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29年4月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。今後、指定投資信託証券の各運用会社の都合等により、記載内容が変更になることがあります。また、今後繰上償還などにより指定投資信託証券から除外される場合や、以下に記載した投資信託証券以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加される場合があります。運用プロセスは、実質的に運用を行う会社のものであり、将来運用プロセスは見直される場合があります。

(以下略)

(3) 運用体制

(以下略)

*当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成29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29年10月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。今後、指定投資信託証券の各運用会社の都合等により、記載内容が変更になることがあります。また、今後繰上償還などにより指定投資信託証券から除外される場合や、以下に記載した投資信託証券以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加される場合があります。運用プロセスは、実質的に運用を行う会社のものであり、将来運用プロセスは見直される場合があります。

(以下略)

(3) 運用体制

（以下略）

* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成29年10月末現在で約100名です。

（以下略）

[次へ](#)

3 投資リスク

< リスクの管理体制 >

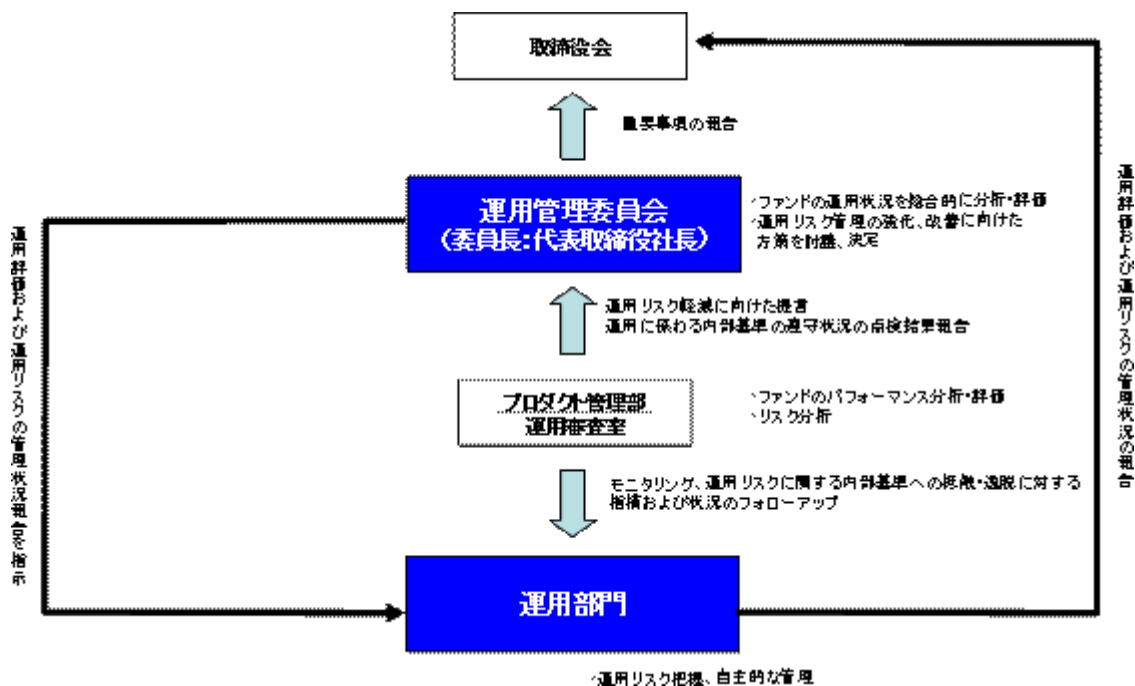
下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

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。

名称および人員数	内容
運用管理委員会 (20名程度)	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・決定します。
リスク管理委員会 (14名程度)	運用リスクを除く経営リスクを適時、的確に把握し、適切な具体的措置を講じ、リスクの軽減・管理に努めます。
監査部 (4名程度)	取締役会直轄として、各部室の業務が適正な内部管理態勢のもと、法令等に従って行われているかを点検します。
コンプライアンス・オフィサー (1名)	コンプライアンスの観点から各部室の指導・監督を行うと同時に、法令等の遵守体制の維持・強化に向けた役職員の啓蒙・教化に努めます。
法務コンプライアンス部 (5名程度)	社内規則の制定・改廃の点検を行うほか、インサイダー情報の管理や広報内容のチェック等、法令違反等を未然に防止するために日常的な活動を行います。
プロダクト管理部 (14名程度)	約定内容と取引報告書を照合する等、発注業務の監視および約定価格の妥当性を点検します。
運用審査室 (7名程度)	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います。
トレーディング部 (16名程度)	有価証券の売買発注は、トレーディング部が最良執行の観点を踏まえて行います。

運用リスクの管理は、以下の体制で行います。



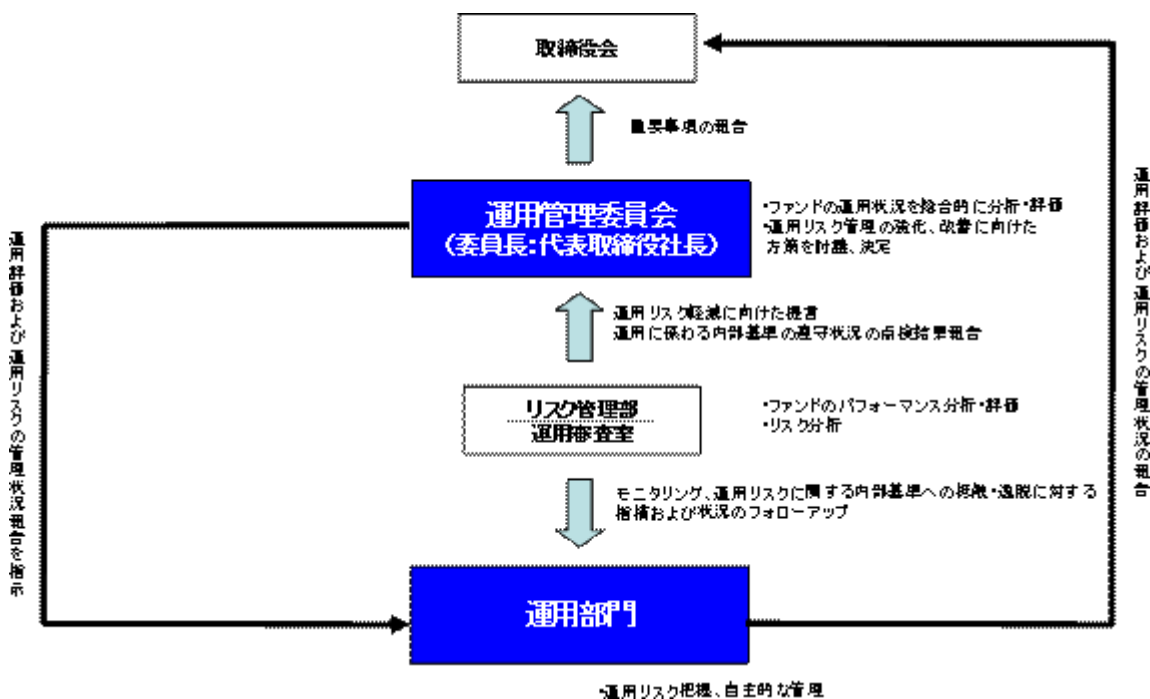
* リスクの管理体制は、今後変更になる場合があります。

<訂正後>

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。

名称および人員数	内容
運用管理委員会 (20名程度)	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・決定します。
リスク管理委員会 (14名程度)	運用リスクを除く経営リスクを適時、的確に把握し、適切な具体的措置を講じ、リスクの軽減・管理に努めます。
監査部 (4名程度)	取締役会直轄として、各部室の業務が適正な内部管理態勢のもと、法令等に従って行われているかを点検します。
コンプライアンス・オフィサー (1名)	コンプライアンスの観点から各部室の指導・監督を行うと同時に、法令等の遵守体制の維持・強化に向けた役職員の啓蒙・教化に努めます。
法務コンプライアンス部 (6名程度)	社内諸規程の統括・管理を行うほか、インサイダー情報の管理や広報内容のチェック等、法令違反等を未然に防止するために日常的な活動を行います。
リスク管理部 (17名程度)	約定内容と取引報告書を照合する等、発注業務の監視および約定価格の妥当性の点検を行うほか、社内事務フローに係る企画・立案および管理等を行います。
運用審査室 (9名程度)	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います。
トレーディング部 (16名程度)	有価証券の売買発注は、トレーディング部が最良執行の観点を踏まえて行います。

運用リスクの管理は、以下の体制で行います。



* リスクの管理体制は、今後変更になる場合があります。

<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

(2012年11月～2017年10月)

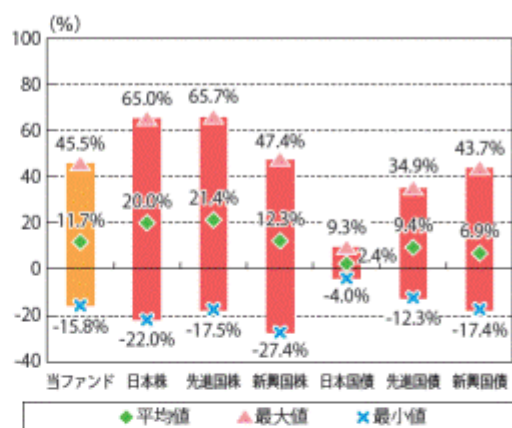


※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※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として計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2012年11月～2017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として計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数について>

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

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

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は平成29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29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29年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （世界REITマザーファンド）	日本	1,526,269,279	14.85%
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	1,513,613,513	14.73%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	1,064,791,899	10.36%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	1,025,560,505	9.98%
親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド）	日本	1,009,520,377	9.82%
親投資信託受益証券 （アジア・オセアニア債券マザーファンド）	日本	981,404,772	9.55%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	532,028,053	5.18%
投資証券	ルクセンブルグ	2,517,018,126	24.50%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		105,417,838	1.03%
純資産総額		10,275,624,362	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29年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	1,374,522,046	1.1094 1,525,032,210	1.1104 1,526,269,279	- -	14.85%
2	グローバル好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	748,054,519	1.9698 1,473,517,792	2.0234 1,513,613,513	- -	14.73%
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 -	566,710,256	1.7806 1,009,140,952	1.8789 1,064,791,899	- -	10.36%
4	T.Rowe Price Funds SICAV- Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	913,236	1,136 1,037,557,145	1,138 1,039,619,206	- -	10.12%
5	欧州債券マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	743,375,258	1.3764 1,023,256,042	1.3796 1,025,560,505	- -	9.98%
6	T.Rowe Price Funds SICAV- U.S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	824,330	1,236 1,019,552,288	1,230 1,013,966,530	- -	9.87%
7	新興国債券マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	428,125,690	2.3348 999,630,673	2.3580 1,009,520,377	- -	9.82%
8	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 -	710,596,461	1.3979 993,413,852	1.3811 981,404,772	- -	9.55%
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 -	988,899,727	0.5254 519,567,917	0.5380 532,028,053	- -	5.18%
10	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	428,386	1,048 449,374,294	1,081 463,432,389	- -	4.51%

（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	74.48%
投資証券	24.50%
合計	98.97%

（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29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29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）
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
第18特定期間末 （平成28年3月28日）	12,093	12,223	0.8482	0.8572
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10月末日	10,902	-	0.8064	-
平成28年11月末日	11,332	-	0.8431	-
平成28年12月末日	11,522	-	0.8798	-
平成29年1月末日	11,182	-	0.8700	-
平成29年2月末日	11,078	-	0.8749	-
第20特定期間末 （平成29年3月27日）	10,697	10,813	0.8585	0.8675
平成29年3月末日	10,816	-	0.8710	-
平成29年4月末日	10,750	-	0.8749	-
平成29年5月末日	10,613	-	0.8817	-
平成29年6月末日	10,562	-	0.8943	-
平成29年7月末日	10,456	-	0.8962	-
平成29年8月末日	10,353	-	0.9000	-
第21特定期間末 （平成29年9月27日）	10,353	10,458	0.9174	0.9264
平成29年9月末日	10,370	-	0.9197	-
平成29年10月末日	10,275	-	0.9292	-

（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
第20特定期間(平成28年9月28日～平成29年3月27日)	0.0090
第21特定期間(平成29年3月28日～平成29年9月27日)	0.0090

収益率の推移

期間	収益率
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%
第20特定期間(平成28年9月28日～平成29年3月27日)	10.0%
第21特定期間(平成29年3月28日～平成29年9月27日)	7.9%

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

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第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
第20特定期間(平成28年9月28日～平成29年3月27日)	50,827,669	1,179,131,076
第21特定期間(平成29年3月28日～平成29年9月27日)	43,574,840	1,219,406,897

(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29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	18,178,330,960	93.85%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,191,273,945	6.15%
純資産総額		19,369,604,905	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29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	987,280,000	5.10%

(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29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	1,568,000	727.30 1,140,406,400	762.50 1,195,600,000	- -	6.17%
2	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	109,200	7,005.45 764,996,095	6,990.00 763,308,000	- -	3.94%
3	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	35,600	17,350.00 617,660,000	19,755.00 703,278,000	- -	3.63%
4	JXTGホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	1,074,800	564.70 606,939,560	583.20 626,823,360	- -	3.24%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	100,200	5,144.00 515,428,800	5,473.00 548,394,600	- -	2.83%
6	ディスコ 日本	株式 機械	16,500	23,170.00 382,305,000	26,130.00 431,145,000	- -	2.23%
7	オリックス 日本	株式 その他金融業	214,600	1,834.00 393,576,400	1,938.50 416,002,100	- -	2.15%
8	小松製作所 日本	株式 機械	109,200	3,285.00 358,722,000	3,697.00 403,712,400	- -	2.08%
9	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	145,400	2,582.50 375,495,500	2,741.00 398,541,400	- -	2.06%
10	SUBARU 日本	株式 輸送用機器	83,900	3,972.00 333,250,800	3,888.00 326,203,200	- -	1.68%
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	118,200	2,573.62 304,202,454	2,648.50 313,052,700	- -	1.62%
12	キヤノン 日本	株式 電気機器	71,100	4,012.08 285,259,042	4,243.00 301,677,300	- -	1.56%
13	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	151,900	1,848.42 280,776,254	1,978.00 300,458,200	- -	1.55%
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	60,400	4,379.00 264,491,600	4,855.00 293,242,000	- -	1.51%
15	第一生命ホールディングス 日本	株式 保険業	127,900	2,071.50 264,944,850	2,142.50 274,025,750	- -	1.41%
16	日本軽金属ホールディングス 日本	株式 非鉄金属	760,000	349.00 265,240,000	332.00 252,320,000	- -	1.30%
17	西日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	30,100	7,702.00 231,830,200	7,973.00 239,987,300	- -	1.24%
18	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	215,300	1,089.00 234,461,700	1,098.50 236,507,050	- -	1.22%
19	デンカ 日本	株式 化学	61,600	3,760.00 231,616,000	3,765.00 231,924,000	- -	1.20%
20	ふくおかフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	396,000	536.00 212,256,000	581.00 230,076,000	- -	1.19%
21	アズビル 日本	株式 電気機器	45,900	4,780.00 219,402,000	4,940.00 226,746,000	- -	1.17%
22	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	58,800	3,685.00 216,678,000	3,747.00 220,323,600	- -	1.14%

23	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	39,200	5,249.00 205,760,800	5,390.00 211,288,000	-	1.09%
24	三和ホールディングス 日本	株式 金属製品	146,900	1,298.00 190,676,200	1,419.00 208,451,100	-	1.08%
25	ツバキ・ナカシマ 日本	株式 機械	80,000	2,330.00 186,400,000	2,603.00 208,240,000	-	1.08%
26	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	32,100	6,147.00 197,318,700	6,395.00 205,279,500	-	1.06%
27	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	328,000	577.80 189,518,400	608.20 199,489,600	-	1.03%
28	宇部興産 日本	株式 化学	56,000	3,305.00 185,080,000	3,465.00 194,040,000	-	1.00%
29	K O A 日本	株式 電気機器	82,000	2,355.00 193,110,000	2,360.00 193,520,000	-	1.00%
30	東ソー 日本	株式 化学	77,500	2,542.00 197,005,000	2,438.00 188,945,000	-	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	93.85%
合計	93.85%

(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)	
電気機器	10.82%
銀行業	10.40%
輸送用機器	8.88%
機械	8.45%
建設業	6.81%
卸売業	6.50%
情報・通信業	6.34%
化学	6.22%
保険業	3.79%
その他金融業	3.32%
石油・石炭製品	3.24%
陸運業	2.10%
非鉄金属	2.09%
小売業	2.03%
ガラス・土石製品	1.92%
サービス業	1.56%
医薬品	1.49%
その他製品	1.23%
電気・ガス業	1.17%
食料品	1.14%
ゴム製品	1.09%
金属製品	1.08%
不動産業	0.84%
精密機器	0.69%
倉庫・運輸関連業	0.65%
小計	93.85%
合計	93.85%

(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29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29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 2912月	買建	56	950,483,777	987,280,000	5.10%

(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29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	438,566,875	28.73%
	オーストラリア	220,729,809	14.46%
	イギリス	216,159,759	14.16%
	日本	203,508,100	13.33%
	フランス	195,001,574	12.78%
	シンガポール	61,307,720	4.02%
	カナダ	48,140,139	3.15%
	スペイン	47,223,060	3.09%
	ドイツ	34,987,304	2.29%
	オランダ	31,600,440	2.07%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		29,067,956	1.90%
純資産総額		1,526,292,736	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29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	SEGRO PLC イギリス	投資証券 -	126,908	680 86,371,432	787 99,939,555	- -	6.55%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券 -	2,926	29,342 85,857,477	28,038 82,040,732	- -	5.38%
3	TRITAX BIG BOX REIT PLC イギリス	投資証券 -	329,423	212 69,900,464	216 71,377,234	- -	4.68%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券 -	8,731	7,883 68,833,957	7,605 66,403,477	- -	4.35%
5	GECINA SA フランス	投資証券 -	3,368	15,781 53,152,273	18,268 61,528,388	- -	4.03%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	6,896	7,122 49,115,314	7,583 52,299,148	- -	3.43%
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券 -	204	231,184 47,161,548	238,800 48,715,200	- -	3.19%
8	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券 -	88	615,000 54,120,000	548,000 48,224,000	- -	3.16%
9	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA スペイン	投資証券 -	22,261	2,156 48,006,624	2,121 47,223,060	- -	3.09%
10	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	2,627	18,870 49,572,203	17,849 46,891,578	- -	3.07%
11	DEXUS オーストラリア	投資証券 -	52,045	850 44,257,558	842 43,850,280	- -	2.87%
12	VEREIT INC アメリカ	投資証券 -	48,000	961 46,169,280	884 42,475,737	- -	2.78%
13	INGENIA COMMUNITIES GROUP オーストラリア	投資証券 -	181,604	239 43,492,266	233 42,318,453	- -	2.77%
14	MAPLETREE LOGISTICS TRUST シンガポール	投資証券 -	385,232	97 37,679,721	106 41,005,943	- -	2.69%
15	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券 -	110,848	366 40,576,963	347 38,552,934	- -	2.53%
16	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券 -	233	171,400 39,936,200	163,300 38,048,900	- -	2.49%
17	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	84,839	440 37,400,127	437 37,105,057	- -	2.43%
18	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN アメリカ	投資証券 -	9,800	3,893 38,159,588	3,780 37,050,620	- -	2.43%
19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券 -	60	659,000 39,540,000	610,000 36,600,000	- -	2.40%
20	ALSTRIA OFFICE REIT-AG ドイツ	投資証券 -	21,846	1,426 31,173,385	1,601 34,987,304	- -	2.29%
21	LIBERTY PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券 -	7,200	4,389 31,604,230	4,844 34,879,533	- -	2.29%
22	ICADE フランス	投資証券 -	3,538	8,901 31,494,234	9,831 34,785,372	- -	2.28%
23	CROWN CASTLE INTL CORP アメリカ	投資証券 -	2,800	11,277 31,577,205	12,007 33,620,741	- -	2.20%
24	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	60	610,000	532,000	-	2.09%

	日本	-		36,600,000	31,920,000	-	
25	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D アメリカ	投資証券 -	10,988	2,905 31,930,565	2,879 31,644,582	-	2.07%
26	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV オランダ	投資証券 -	6,703	4,356 29,202,586	4,714 31,600,440	-	2.07%
27	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	79,142	394 31,241,541	391 30,966,286	-	2.03%
28	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券 -	36,924	855 31,587,994	774 28,608,513	-	1.87%
29	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	134,434	189 25,482,099	207 27,936,796	-	1.83%
30	AMERICAN HOMES 4 RENT-D アメリカ	投資証券 -	7,289	2,899 21,131,971	3,037 22,138,255	-	1.45%

（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	98.10%
合計	98.10%

（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29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29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29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	21,196,038,538	29.95%
	日本	7,187,496,000	10.16%
	イギリス	6,044,512,630	8.54%
	スイス	5,154,036,253	7.28%
	ケイマン諸島	3,855,001,564	5.45%
	香港	3,627,555,863	5.13%
	フランス	3,411,531,896	4.82%
	オランダ	2,827,434,789	4.00%
	オーストラリア	2,811,870,582	3.97%
	フィンランド	1,929,824,091	2.73%
	ドイツ	1,729,790,341	2.44%
	シンガポール	1,675,095,786	2.37%
	台湾	1,551,066,873	2.19%
	パナマ	1,141,093,535	1.61%
	ノルウェー	1,100,884,149	1.56%
	イタリア	990,413,568	1.40%
	韓国	845,350,290	1.19%
	バミューダ	777,737,741	1.10%
	カナダ	457,550,400	0.65%
	デンマーク	372,706,950	0.53%
アイルランド	283,008,633	0.40%	
投資証券	シンガポール	311,850,000	0.44%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,488,258,062	2.10%
純資産総額		70,770,108,534	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29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	3,355,000	375	484	-	2.30%

	ケイマン諸島	耐久消費財・アパレル		1,258,405,142	1,625,947,070	-	
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC 台湾	株式 半導体・半導体 製造装置	1,702,131	772	911	-	2.19%
				1,314,896,197	1,551,066,873	-	
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	145,000	7,860	9,492	-	1.95%
				1,139,713,572	1,376,483,898	-	
4	NEXTERA ENERGY INC アメリカ	株式 公益事業	76,250	15,896	17,580	-	1.89%
				1,212,124,656	1,340,515,992	-	
5	アズビル 日本	株式 電気機器	260,000	4,225.00	4,940.00	-	1.81%
				1,098,500,000	1,284,400,000	-	
6	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	65,720	17,226	18,706	-	1.74%
				1,132,115,511	1,229,389,839	-	
7	SANDS CHINA LTD ケイマン諸島	株式 消費者サービス	2,320,000	496	529	-	1.74%
				1,151,281,440	1,228,706,800	-	
8	ディスコ 日本	株式 機械	47,000	18,700.00	26,130.00	-	1.74%
				878,900,000	1,228,110,000	-	
9	AMERICAN WATER WORKS CO INC アメリカ	株式 公益事業	122,900	8,799	9,930	-	1.72%
				1,081,436,624	1,220,510,264	-	
10	NORTHROP GRUMMAN CORP アメリカ	株式 資本財	36,210	29,646	33,537	-	1.72%
				1,073,510,207	1,214,383,069	-	
11	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD 香港	株式 銀行	2,120,000	533	556	-	1.67%
				1,130,474,100	1,179,692,020	-	
12	RAYTHEON COMPANY アメリカ	株式 資本財	58,000	18,769	20,321	-	1.67%
				1,088,651,253	1,178,633,822	-	
13	MCDONALD'S CORP アメリカ	株式 消費者サービス	62,500	17,683	18,810	-	1.66%
				1,105,219,575	1,175,661,675	-	
14	CARNIVAL CORP パナマ	株式 消費者サービス	152,740	7,449	7,470	-	1.61%
				1,137,809,564	1,141,093,535	-	
15	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	96,380	10,620	11,475	-	1.56%
				1,023,561,961	1,106,014,048	-	
16	TELENOR ASA ノルウェー	株式 電気通信サービ ス	458,200	1,904	2,402	-	1.56%
				872,566,755	1,100,884,149	-	
17	RELX NV オランダ	株式 商業・専門サー ビス	430,082	2,318	2,536	-	1.54%
				997,066,498	1,090,851,383	-	
18	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバ コ	148,100	7,798	7,347	-	1.54%
				1,154,995,126	1,088,160,766	-	
19	ANALOG DEVICES INC アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	104,830	8,879	10,333	-	1.53%
				930,855,302	1,083,289,234	-	
20	TOTAL SA フランス	株式 エネルギー	170,000	5,594	6,294	-	1.51%
				951,070,032	1,070,009,784	-	
21	N T T ドコモ 日本	株式 情報・通信業	390,000	2,622.50	2,741.00	-	1.51%
				1,022,775,000	1,068,990,000	-	
22	AMCOR LIMITED オーストラリア	株式 素材	770,320	1,402	1,380	-	1.50%
				1,080,376,496	1,063,631,665	-	
23	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST 香港	株式 不動産	2,870,000	336	367	-	1.49%
				966,133,840	1,055,667,795	-	
24	ING GROEP NV オランダ	株式 銀行	500,000	2,055	2,096	-	1.48%
				1,027,728,000	1,048,150,800	-	
25	CONOCOPHILLIPS アメリカ	株式 エネルギー	180,070	4,865	5,815	-	1.48%
				876,199,011	1,047,159,702	-	
26	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器 ・サービス	44,000	21,269	23,694	-	1.47%
				935,860,358	1,042,561,185	-	
27	GIVAUDAN-REG スイス	株式 素材	4,100	214,286	252,142	-	1.46%
				878,575,880	1,033,783,184	-	
28	BROADCOM LTD シンガポール	株式 半導体・半導体 製造装置	34,250	27,115	29,560	-	1.43%
				928,702,422	1,012,456,947	-	
29	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 資本財	698,500	1,410	1,432	-	1.41%
				985,144,842	1,000,347,694	-	
30	WESTPAC BANKING CORP オーストラリア	株式 銀行	345,559	2,659	2,893	-	1.41%
				919,118,000	999,942,696	-	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
-----	------

株式	97.46%
投資証券	0.44%
合計	97.90%

（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

業種別	投資比率
（国内）	
電気機器	1.81%
機械	1.74%
情報・通信業	1.51%
建設業	1.36%
輸送用機器	1.04%
化学	1.02%
卸売業	0.88%
その他金融業	0.79%
小計	10.16%
（海外）	
食品・飲料・タバコ	8.02%
銀行	7.43%
資本財	7.20%
電気通信サービス	6.43%
消費者サービス	6.37%
公益事業	5.98%
エネルギー	5.51%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.23%
半導体・半導体製造装置	5.15%
各種金融	4.66%
保険	4.51%
素材	2.96%
耐久消費財・アパレル	2.82%
不動産	2.43%
ソフトウェア・サービス	1.95%
食品・生活必需品小売り	1.79%
小売	1.74%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.61%
商業・専門サービス	1.54%
ヘルスケア機器・サービス	1.47%
運輸	1.40%
家庭用品・パーソナル用品	1.09%
小計	87.30%
合計	97.46%

（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29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29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29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	セルビア	492,292,797	5.13%
	トルコ	485,126,261	5.06%
	スリランカ	443,800,167	4.63%
	アルゼンチン	412,772,501	4.30%
	ウクライナ	362,028,261	3.77%
	コロンビア	305,176,960	3.18%
	レバノン	301,250,127	3.14%
	ガーナ	281,612,465	2.93%
	ジャマイカ	268,181,420	2.79%
	エジプト	267,062,827	2.78%
	ドミニカ共和国	255,044,251	2.66%
	南アフリカ	252,473,975	2.63%
	インドネシア	221,677,611	2.31%
	ブラジル	191,744,895	2.00%
	ベトナム	176,232,272	1.84%
	エルサルバドル	173,921,731	1.81%
	メキシコ	148,100,636	1.54%
	オマーン	140,548,567	1.46%
	ロシア	118,583,532	1.24%
	コートジボアール	107,748,135	1.12%
	パキスタン	91,537,585	0.95%
	チリ	69,831,036	0.73%
	ポーランド	62,307,593	0.65%
	セネガル	46,874,493	0.49%
パナマ	45,065,970	0.47%	
ザンビア	24,588,536	0.26%	
特殊債券	メキシコ	321,888,116	3.35%
	ブラジル	142,771,708	1.49%
	南アフリカ	122,021,333	1.27%
	カザフスタン	115,394,910	1.20%
	トルコ	69,983,123	0.73%
	ケイマン諸島	22,678,621	0.24%
社債券	オランダ	429,399,114	4.48%
	メキシコ	390,352,096	4.07%
	ルクセンブルグ	207,590,662	2.16%
	インド	184,442,199	1.92%
	インドネシア	175,881,362	1.83%
	カザフスタン	165,280,138	1.72%
	アイルランド	126,844,082	1.32%
	イギリス領バージン諸島	120,756,657	1.26%
	トルコ	119,523,156	1.25%
	ケイマン諸島	91,043,104	0.95%
	ロシア	72,402,936	0.75%
	アゼルバイジャン	64,007,822	0.67%
	トリニダード トバゴ	60,710,340	0.63%
	アルゼンチン	58,570,077	0.61%
	イスラエル	48,771,054	0.51%
	アラブ首長国連邦	26,451,150	0.28%
	ブラジル	24,866,910	0.26%
	コロンビア	24,555,720	0.26%
	モーリシャス	24,486,466	0.26%
	スリランカ	23,718,336	0.25%
アメリカ	23,084,640	0.24%	
マレーシア	22,862,393	0.24%	
フィリピン	22,598,957	0.24%	
チリ	21,641,850	0.23%	
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		525,165,586	5.47%
純資産総額		9,595,329,222	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29年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	REPUBLIC OF SERBIA	国債証券	3,200,000	13,038.13	13,031.16	7.2500	4.35%

	セルビア	-		417,220,467	416,997,315	2021/09/28	
2	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	2,100,000	11,481.96 241,121,328	12,113.77 254,389,338	7.7500 2021/09/01	2.65%
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券 -	2,198,000	11,587.11 254,684,871	11,486.53 252,473,975	4.6650 2024/01/17	2.63%
4	REPUBLIC OF SRI LANKA スリランカ	国債証券 -	1,850,000	11,883.32 219,841,590	12,092.73 223,715,509	5.8750 2022/07/25	2.33%
5	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	1,625,000	12,628.03 205,205,560	12,804.05 208,065,877	7.5000 2026/04/22	2.17%
6	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	1,754,000	11,434.81 200,566,707	11,483.47 201,420,183	6.5000 2041/06/02	2.10%
7	SOCIALIST REP OF VIETNAM ベトナム	国債証券 -	1,450,000	11,810.98 171,259,229	12,153.94 176,232,272	4.8000 2024/11/19	1.84%
8	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN インドネシア	国債証券 -	1,400,000	11,797.49 165,164,941	11,969.49 167,572,986	4.3500 2024/09/10	1.75%
9	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	1,350,000	12,296.75 166,006,229	12,320.40 166,325,510	6.2500 2022/09/26	1.73%
10	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	1,184,722	12,741.07 150,946,381	13,268.01 157,189,043	8.2800 2033/12/31	1.64%
11	REPUBLIC OF GHANA ガーナ	国債証券 -	1,200,000	12,056.25 144,675,060	12,773.72 153,284,725	9.2500 2022/09/15	1.60%
12	PERTAMINA PERSERO PT インドネシア	社債券 -	1,225,000	11,681.50 143,098,458	12,351.41 151,304,821	5.6250 2043/05/20	1.58%
13	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	1,250,000	11,732.33 146,654,228	11,777.12 147,214,087	4.0000 2024/02/26	1.53%
14	REPUBLIC OF SRI LANKA スリランカ	国債証券 -	1,200,000	12,039.56 144,474,766	12,220.14 146,641,780	6.2500 2021/07/27	1.53%
15	BANCO NAC DE DESEN ECONO ブラジル	特殊債券 -	1,200,000	11,989.30 143,871,624	11,897.64 142,771,708	5.5000 2020/07/12	1.49%
16	LEBANESE REPUBLIC レバノン	国債証券 -	1,230,000	11,552.34 142,093,880	11,044.75 135,850,492	6.8500 2027/03/23	1.42%
17	ARAB REPUBLIC OF EGYPT エジプト	国債証券 -	1,060,000	12,227.20 129,608,417	12,540.61 132,930,545	7.5000 2027/01/31	1.39%
18	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	950,000	13,214.83 125,540,948	13,018.71 123,677,825	7.3750 2025/02/05	1.29%
19	ESKOM HOLDINGS SOC LTD 南アフリカ	特殊債券 -	1,050,000	11,729.46 123,159,383	11,621.07 122,021,333	7.1250 2025/02/11	1.27%
20	GOVERNMENT OF JAMAICA ジャマイカ	国債証券 -	845,000	13,471.66 113,835,553	14,159.14 119,644,775	8.0000 2039/03/15	1.25%
21	DEVELOPMENT BANK OF KAZA カザフスタン	特殊債券 -	1,000,000	11,341.34 113,413,478	11,539.49 115,394,910	4.1250 2022/12/10	1.20%
22	BANCO NACIONAL COM EXT メキシコ	特殊債券 -	1,000,000	11,132.68 111,326,808	11,301.85 113,018,550	3.8000 2026/08/11	1.18%
23	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO カザフスタン	社債券 -	950,000	11,135.53 105,787,626	11,542.09 109,649,889	5.7500 2043/04/30	1.14%
24	LEBANESE REP レバノン	国債証券 -	900,000	12,558.94 113,030,544	12,051.76 108,465,896	8.2500 2021/04/12	1.13%
25	IVORY COAST コートジボアール	国債証券 -	965,000	11,204.82 108,126,526	11,165.61 107,748,135	5.7500 2032/12/31	1.12%
26	HAZINE MUSTESARLIGI VARL トルコ	国債証券 -	925,000	11,115.81 102,821,334	11,132.56 102,976,250	4.4890 2024/11/25	1.07%
27	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証券 -	855,000	11,782.78 100,742,811	12,023.25 102,798,787	5.5000 2025/01/27	1.07%
28	EXPORT-IMPORT BK INDIA インド	社債券 -	900,000	10,950.01 98,550,138	11,210.87 100,897,869	3.3750 2026/08/05	1.05%
29	PETROBRAS GLOBAL FINANCE オランダ	社債券 -	863,000	10,988.84 94,833,738	11,522.51 99,439,321	5.9990 2028/01/27	1.04%
30	PETROBRAS GLOBAL FINANCE オランダ	社債券 -	720,000	13,262.90 95,492,895	13,752.33 99,016,810	8.7500 2026/05/23	1.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
国債証券	59.88%
社債券	26.37%
特殊債券	8.28%
合計	94.53%

（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29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29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29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	169,822,471	16.56%
	フランス	101,048,248	9.85%
	イギリス	82,916,036	8.08%
	スペイン	45,188,229	4.41%
	ベルギー	39,553,748	3.86%
	スロヴェニア	34,661,739	3.38%
	ドイツ	24,231,068	2.36%
	キプロス	23,069,090	2.25%
	セルビア	21,987,937	2.14%
	インドネシア	21,274,476	2.07%
	ポルトガル	18,298,870	1.78%
	メキシコ	15,145,812	1.48%
	イスラエル	14,919,184	1.45%
	アルバニア	14,859,234	1.45%
	ルーマニア	13,391,783	1.31%
	アイルランド	9,763,908	0.95%
	ロシア	8,372,284	0.82%
	デンマーク	4,198,863	0.41%
	オーストリア	2,855,713	0.28%
特殊債券	国際機関	5,694,599	0.56%
社債券	オーストリア	43,439,690	4.24%
	スウェーデン	25,108,386	2.45%
	フランス	20,775,521	2.03%
	アイスランド	19,146,994	1.87%
	ルクセンブルグ	14,134,685	1.38%
	メキシコ	13,613,113	1.33%
	チェコ	13,307,760	1.30%
	ドイツ	8,545,666	0.83%
	イギリス	7,751,374	0.76%
	アイルランド	7,418,746	0.72%
	デンマーク	6,800,064	0.66%
アメリカ	1,534,015	0.15%	
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		172,724,752	16.84%
純資産総額		1,025,554,058	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29年10月末現在）
イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	344,000	16,111.31 55,422,933	16,244.16 55,879,921	5.5000 2022/09/01	5.45%
2	UK GILT イギリス	国債証券 -	202,000	23,371.33 47,210,098	22,684.52 45,822,730	4.2500 2046/12/07	4.47%
3	HETA ASSET RESOLUTION AG オーストリア	社債券 -	300,000	14,414.41 43,243,236	14,479.89 43,439,690	2.3750 2022/12/13	4.24%
4	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	231,000	16,926.76 39,100,823	17,816.58 41,156,316	3.2500 2045/05/25	4.01%
5	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	212,000	18,115.02 38,403,850	18,296.58 38,788,768	5.9000 2026/07/30	3.78%
6	UK GILT イギリス	国債証券 -	149,000	23,010.87 34,286,203	22,410.16 33,391,148	4.7500 2038/12/07	3.26%

7	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	227,000	12,566.17 28,525,212	12,853.97 29,178,531	0.2500 2026/11/25	2.85%
8	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	162,000	16,428.63 26,614,381	17,513.93 28,372,573	4.7500 2044/09/01	2.77%
9	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	172,000	15,649.68 26,917,458	15,935.31 27,408,746	4.5000 2024/03/01	2.67%
10	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	170,000	13,109.32 22,285,860	13,129.48 22,320,130	0.2500 2027/02/15	2.18%
11	SERBIA TREASURY BONDS セルビア	国債証券 -	18,000,000	123.38 22,210,184	122.15 21,987,937	10.0000 2019/08/21	2.14%
12	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	149,000	14,080.13 20,979,404	14,278.17 21,274,476	2.8750 2021/07/08	2.07%
13	REPUBLIC OF CYPRUS キプロス	国債証券 -	130,000	13,973.14 18,165,092	15,062.80 19,581,644	3.8750 2022/05/06	1.91%
14	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	142,000	13,069.16 18,558,219	13,661.53 19,399,380	2.0000 2025/12/01	1.89%
15	ISLANDSBANKI アイスランド	社債券 -	140,000	13,476.41 18,866,977	13,676.42 19,146,994	1.7500 2020/09/07	1.87%
16	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	143,000	12,327.99 17,629,029	12,959.12 18,531,545	1.2500 2036/05/25	1.81%
17	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	94,000	16,849.49 15,838,521	17,840.30 16,769,885	5.0000 2040/09/01	1.64%
18	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	80,000	20,212.18 16,169,745	20,508.31 16,406,649	4.2500 2041/03/28	1.60%
19	REPUBLIKA SLOVENIJA スロヴェニア	国債証券 -	116,000	12,931.00 14,999,969	13,596.05 15,771,419	1.2500 2027/03/22	1.54%
20	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券 -	100,000	14,258.27 14,258,276	15,145.81 15,145,812	3.6250 2029/04/09	1.48%
21	REPUBLIKA SLOVENIJA スロヴェニア	国債証券 -	83,000	17,874.56 14,835,886	18,074.17 15,001,567	5.1250 2026/03/30	1.46%
22	STATE OF ISRAEL イスラエル	国債証券 -	100,000	14,872.41 14,872,410	14,919.18 14,919,184	2.8750 2024/01/29	1.45%
23	REPUBLIC OF ALBANIA アルバニア	国債証券 -	100,000	14,589.12 14,589,126	14,859.23 14,859,234	5.7500 2020/11/12	1.45%
24	HORIZON PARENT HOLDEINGS ルクセンブルグ	社債券 -	100,000	13,749.81 13,749,814	14,134.68 14,134,685	8.2500 2022/02/15	1.38%
25	LOXAM SAS フランス	社債券 -	100,000	13,906.21 13,906,213	13,997.12 13,997,128	7.0000 2022/07/23	1.36%
26	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	社債券 -	110,000	11,573.79 12,731,178	12,375.55 13,613,113	2.7500 2027/04/21	1.33%
27	ROMANIA GOVERNMENT BOND ルーマニア	国債証券 -	420,000	3,278.85 13,771,171	3,188.51 13,391,783	5.8500 2023/04/26	1.31%
28	UNICREDIT BANK CZECH RE チェコ	社債券 -	100,000	13,194.70 13,194,709	13,307.76 13,307,760	0.6250 2020/04/30	1.30%
29	OBRIGACOES DO TESOURO ポルトガル	国債証券 -	88,000	12,438.53 10,945,914	14,936.31 13,143,955	3.8750 2030/02/15	1.28%
30	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	70,000	17,671.12 12,369,786	17,768.09 12,437,669	4.5000 2026/03/28	1.21%

（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	64.90%
社債券	17.71%
特殊債券	0.56%
合計	83.16%

（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29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29年10月末現在）

該当事項はありません。

(1) 投資状況

(平成29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	マレーシア	105,878,534	10.79%
	シンガポール	59,220,813	6.03%
	香港	59,047,284	6.02%
	韓国	32,346,522	3.30%
特殊債券	国際機関	436,527,884	44.48%
	ドイツ	80,186,161	8.17%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		208,210,330	21.22%
純資産総額		981,417,528	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29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	INT BK RECON & DEVELOP 国際機関	特殊債券 -	2,000,000	8,734.38 174,687,767	8,800.99 176,019,841	2.8000 2022/01/12	17.94%
2	ASIAN DEVELOPMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	1,495,000	8,849.80 132,304,585	8,802.90 131,603,429	3.5000 2018/07/25	13.41%
3	MALAYSIA GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	4,000,000	2,656.19 106,247,804	2,646.96 105,878,534	3.8000 2023/08/17	10.79%
4	LANDWIRTSCH. RENTENBANK ドイツ	特殊債券 -	1,000,000	7,972.37 79,723,725	8,018.61 80,186,161	4.0000 2020/01/30	8.17%
5	INT BK RECON & DEVELOP 国際機関	特殊債券 -	1,000,000	7,939.78 79,397,808	7,964.61 79,646,135	3.5000 2021/01/22	8.12%
6	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	700,000	8,546.60 59,826,218	8,460.11 59,220,813	2.5000 2019/06/01	6.03%
7	EUROFIMA 国際機関	特殊債券 -	500,000	9,880.12 49,400,642	9,851.69 49,258,479	6.0000 2022/03/30	5.02%
8	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	300,000,000	11.04 33,149,209	10.78 32,346,522	4.2500 2021/06/10	3.30%
9	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	2,000,000	1,516.57 30,331,413	1,501.49 30,029,896	2.4400 2020/12/07	3.06%
10	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	2,000,000	1,452.81 29,056,275	1,450.86 29,017,388	0.7900 2018/06/18	2.96%

(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	52.65%
国債証券	26.13%
合計	78.78%

(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29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29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29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	530,559,599	99.73%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,449,553	0.27%
純資産総額		532,009,152	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29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 10/18/19 イギリス	社債券 -	4,700,000	11,316.00 531,852,000	11,288.50 530,559,599	2.0000 2019/10/18	99.73%

(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	99.73%
合計	99.73%

(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29年10月末現在)

該当事項はありません。

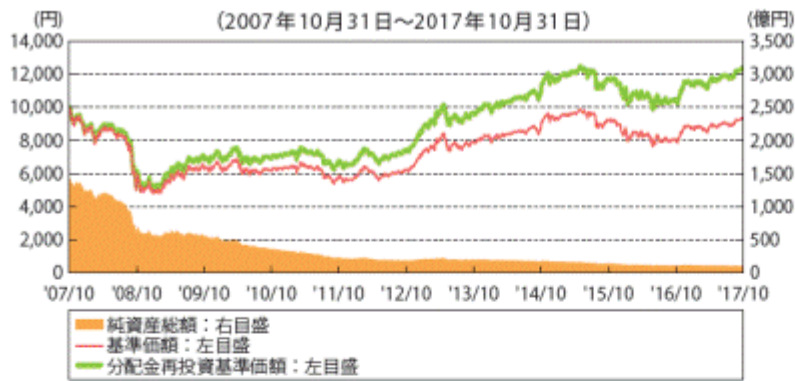
その他投資資産の主要なもの

(平成29年10月末現在)

該当事項はありません。

(参考情報)

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ものとして計算しております。

分配の推移

2017年9月	30円
2017年7月	30円
2017年5月	30円
2017年3月	30円
2017年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	2,030円

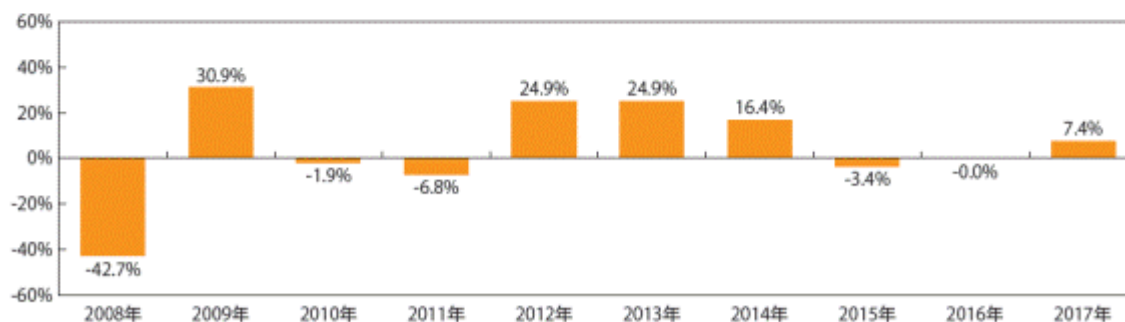
*分配金は1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
世界REITマザーファンド	14.9%
グローバル好配当株マザーファンド	14.7%
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	10.1%
欧州債券マザーファンド	10.0%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	9.9%
新興国債券マザーファンド	9.8%
アジア・オセアニア債券マザーファンド	9.6%
コモディティ・マザーファンド	5.2%
T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	4.5%

*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、2017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ものとして計算しております。

*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29年3月28日から平成29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29年3月27日現在 金額（円）	当期 平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,826,691	1,858,944
コール・ローン	168,199,903	188,917,876
投資証券	2,637,802,570	2,549,799,729
親投資信託受益証券	7,885,599,850	7,665,197,043
未収入金	80,000,000	80,000,000
流動資産合計	10,773,429,014	10,485,773,592
資産合計	10,773,429,014	10,485,773,592
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	37,384,413	33,856,917
未払解約金	9,982,584	70,772,457
未払受託者報酬	776,596	760,294
未払委託者報酬	27,181,389	26,610,946
その他未払費用	453,621	447,552
流動負債合計	75,778,603	132,448,166
負債合計	75,778,603	132,448,166
純資産の部		
元本等		
元本	12,461,471,162	11,285,639,105
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,763,820,751	932,313,679
（分配準備積立金）	572,880,756	592,942,449
元本等合計	10,697,650,411	10,353,325,426
純資産合計	10,697,650,411	10,353,325,426
負債純資産合計	10,773,429,014	10,485,773,592

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年9月28日 至 平成29年3月27日 金額（円）	当期 自 平成29年3月28日 至 平成29年9月27日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	54,267,926	50,613,394
受取利息	1,337	747
有価証券売買等損益	841,706,513	795,417,921
為替差損益	265,002,343	45,584,490
営業収益合計	1,160,978,119	891,616,552

営業費用		
支払利息	54,825	59,383
受託者報酬	2,394,725	2,298,732
委託者報酬	83,816,733	80,457,363
その他費用	654,405	660,660
営業費用合計	86,920,688	83,476,138
営業利益又は営業損失（ ）	1,074,057,431	808,140,414
経常利益又は経常損失（ ）	1,074,057,431	808,140,414
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,074,057,431	808,140,414
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（ ）	24,610,706	11,905,058
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,870,222,995	1,763,820,751
剰余金増加額又は欠損金減少額	181,854,129	145,412,975
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	181,854,129	145,412,975
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,601,326	5,098,011
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,601,326	5,098,011
分配金	116,297,284	105,043,248
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,763,820,751	932,313,679

[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29年 3月28日	至 平成29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 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、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	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	前期	当期
	平成29年 3月27日現在	平成29年 9月27日現在
1. 元本状況		
期首元本額	13,589,774,569円	12,461,471,162円
期中追加設定元本額	50,827,669円	43,574,840円
期中一部解約元本額	1,179,131,076円	1,219,406,897円
2. 受益権の総数	12,461,471,162口	11,285,639,105口
3. 元本の欠損	1,763,820,751円	932,313,679円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																
自 平成28年 9月28日 至 平成29年 3月27日	自 平成29年 3月28日 至 平成29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 7,239,951円	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 7,093,655円																																
2. 分配金の計算過程 第57期計算期間末（平成28年11月28日）に、投資信託約款に基づき計算した715,391,749円（1万口当たり532.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い140,318,273円（1万口当たり30円）を分配しております。	2. 分配金の計算過程 第60期計算期間末（平成29年5月29日）に、投資信託約款に基づき計算した686,034,217円（1万口当たり570.05円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い136,104,091円（1万口当たり30円）を分配しております。																																
<table border="1"> <tbody> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>66,089,144円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>64,967,487円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>584,335,118円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>715,391,749円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(532.31円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>40,318,273円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(30円)</td> </tr> </tbody> </table>	配当等収益 （費用控除後）	66,089,144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	64,967,487円	分配準備積立金	584,335,118円	分配可能額	715,391,749円	（1万口当たり分配可能額）	(532.31円)	収益分配金	40,318,273円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)	<table border="1"> <tbody> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>73,378,350円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>60,029,062円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>552,626,805円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>686,034,217円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(570.05円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>36,104,091円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(30円)</td> </tr> </tbody> </table>	配当等収益 （費用控除後）	73,378,350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	60,029,062円	分配準備積立金	552,626,805円	分配可能額	686,034,217円	（1万口当たり分配可能額）	(570.05円)	収益分配金	36,104,091円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)
配当等収益 （費用控除後）	66,089,144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	64,967,487円																																
分配準備積立金	584,335,118円																																
分配可能額	715,391,749円																																
（1万口当たり分配可能額）	(532.31円)																																
収益分配金	40,318,273円																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																
配当等収益 （費用控除後）	73,378,350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	60,029,062円																																
分配準備積立金	552,626,805円																																
分配可能額	686,034,217円																																
（1万口当たり分配可能額）	(570.05円)																																
収益分配金	36,104,091円																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																
第58期計算期間末（平成29年1月27日）に、投資信託約款に基づき計算した698,369,619円（1万口当たり542.85円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い138,594,598円（1万口当たり30円）を分配しております。	第61期計算期間末（平成29年7月27日）に、投資信託約款に基づき計算した682,736,507円（1万口当たり583.83円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い135,082,240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）	52,149,964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	62,859,618円
分配準備積立金	583,360,037円
分配可能額	698,369,619円
（1万口当たり分配可能額）	(542.85円)
収益分配金	38,594,598円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第59期計算期間末（平成29年3月27日）に、投資信託約款に基づき計算した671,741,106円（1万口当たり539.05円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い137,384,413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）	32,649,021円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	61,475,937円
分配準備積立金	577,616,148円
分配可能額	671,741,106円
（1万口当たり分配可能額）	(539.05円)
収益分配金	37,384,413円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

配当等収益 （費用控除後）	51,186,610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	59,221,411円
分配準備積立金	572,328,486円
分配可能額	682,736,507円
（1万口当たり分配可能額）	(583.83円)
収益分配金	35,082,240円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第62期計算期間末（平成29年9月27日）に、投資信託約款に基づき計算した684,498,284円（1万口当たり606.52円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い133,856,917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）	59,459,375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	57,698,918円
分配準備積立金	567,339,991円
分配可能額	684,498,284円
（1万口当たり分配可能額）	(606.52円)
収益分配金	33,856,917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29年3月28日 至 平成29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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 平成29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)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、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成29年3月27日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）

親投資信託受益証券	139,342,193
投資証券	28,948,746
合計	110,393,447

当期（平成29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	168,869,340
投資証券	24,672,540
合計	193,541,880

（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29年3月27日現在）
該当事項はありません。

当期（平成29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）
当期（自平成29年3月28日 至 平成29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29年3月27日現在	当期 平成29年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.8585円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,585円）」	1口当たり純資産額 0.9174円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,174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	566,710,256	1,009,140,952	
	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	1,374,522,046	1,525,032,210	
	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	783,033,532	1,542,419,451	
	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	428,125,690	999,630,673	
	親投資信託 受益証券	欧州債券マザーファンド	743,375,258	1,023,256,042	
	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	739,216,954	1,033,425,301	
	親投資信託 受益証券	コモディティ・マザーファンド	1,013,118,413	532,292,414	
	小計（日本）7銘柄		5,648,102,149	7,665,197,043	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	493,214.210	4,572,095.720	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	909,015.290	9,126,513.510	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	822,365.980	8,988,460.160	
	小計（アメリカ・ドル）3銘柄		2,224,595.480	22,687,069.390 (2,549,799,729)	
合計				10,214,996,772 (2,549,799,729)	

- （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	24.62%	24.96%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

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

指定投資信託証券の状況は以下のとおりです。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本好配当株マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成29年3月27日現在 金額（円）	平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,169,034,596	1,097,356,933
株式	19,757,765,470	18,407,478,440
派生商品評価勘定	-	48,443,614
未収入金	143,876,360	139,318,777
未収配当金	26,254,200	195,536,560
前払金	6,900,000	-
差入委託証拠金	40,365,000	27,000,000
流動資産合計	21,144,195,626	19,915,134,324
資産合計	21,144,195,626	19,915,134,324
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,935,181	-
前受金	-	40,500,000
未払金	47,480,850	-
未払解約金	88,217,876	108,023,430
流動負債合計	158,633,907	148,523,430
負債合計	158,633,907	148,523,430
純資産の部		
元本等		
元本	13,543,182,570	11,100,465,667
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,442,379,149	8,666,145,227
元本等合計	20,985,561,719	19,766,610,894
純資産合計	20,985,561,719	19,766,610,894
負債純資産合計	21,144,195,626	19,915,134,324

[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29年 3月28日 至 平成29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29年 3月27日現在	平成29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	16,119,012,756円	13,543,182,570円
期中追加設定元本額	89,758,479円	64,981,271円
期中一部解約元本額	2,665,588,665円	2,507,698,174円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	12,882,756,556円	10,533,755,411円
グローバル資産分散オープン	660,426,014円	566,710,256円
合計	13,543,182,570円	11,100,465,667円
2. 受益権の総数	13,543,182,570口	11,100,465,667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29年 3月28日 至 平成29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29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、当該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29年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,989,044,732
合計	2,989,044,732

「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10月12日から平成29年3月27日まで)を指しております。

(平成29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	2,341,951,526
合計	2,341,951,526

「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29年4月11日から平成29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29年3月27日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建 T O P I X	1,063,800,181	-	1,040,865,000	22,935,181
	合計	-	-	1,040,865,000	22,935,181

区分	種類	平成29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	953,556,386	-	1,002,000,000	48,443,614
	合計	-	-	1,002,000,000	48,443,614

(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29年3月28日 至 平成29年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年3月27日現在	平成29年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.5495円 「1口=1円(10,000口=15,495円)」	1口当たり純資産額 1.7807円 「1口=1円(10,000口=17,807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	西松建設	40,800	3,165.00	129,132,000	
	奥村組	40,000	4,235.00	169,400,000	
	大東建託	5,600	20,320.00	113,792,000	
	住友林業	60,000	1,722.00	103,320,000	
	大和ハウス工業	45,400	3,863.00	175,380,200	
	ライト工業	64,000	1,112.00	71,168,000	
	積水ハウス	37,600	1,885.50	70,894,800	
	中電工	35,600	3,205.00	114,098,000	
	関電工	138,000	1,161.00	160,218,000	
	協和エクシオ	66,000	2,195.00	144,870,000	
	九電工	18,900	4,250.00	80,325,000	
	日本たばこ産業	65,400	3,702.00	242,110,800	
	東ソー	77,500	2,544.00	197,160,000	
	東亜合成	19,000	1,467.00	27,873,000	
	デンカ	61,600	3,655.00	225,148,000	
	三菱ケミカルホールディングス	131,000	1,049.50	137,484,500	
	KHネオケム	57,500	2,846.00	163,645,000	
	アイカ工業	20,000	3,705.00	74,100,000	
	宇部興産	56,000	3,250.00	182,000,000	
	太陽ホールディングス	41,600	5,220.00	217,152,000	
	D I C	39,200	4,035.00	158,172,000	
	日本バルカー工業	24,000	2,778.00	66,672,000	
	武田薬品工業	32,100	6,092.00	195,553,200	
	大塚ホールディングス	17,600	4,475.00	78,760,000	
	J X T Gホールディングス	1,074,800	570.80	613,495,840	
	ブリヂストン	45,400	5,108.00	231,903,200	
	日本電気硝子	24,300	4,305.00	104,611,500	
	住友大阪セメント	235,000	498.00	117,030,000	
	日本特殊陶業	25,000	2,379.00	59,475,000	
	ニチアス	158,000	1,369.00	216,302,000	
	日本軽金属ホールディングス	760,000	321.00	243,960,000	
	住友電気工業	41,800	1,775.00	74,195,000	
	アサヒホールディングス	57,000	2,242.00	127,794,000	
	三和ホールディングス	146,900	1,265.00	185,828,500	
	アマダホールディングス	86,600	1,227.00	106,258,200	
	アイダエンジニアリング	101,400	1,278.00	129,589,200	
	ディスコ	16,500	22,320.00	368,280,000	
	小松製作所	109,200	3,175.00	346,710,000	
	トーヨーカネツ	22,000	4,250.00	93,500,000	
	C K D	62,000	2,170.00	134,540,000	
	アマノ	51,100	2,657.00	135,772,700	
	マックス	58,000	1,557.00	90,306,000	
	ツバキ・ナカシマ	80,000	2,455.00	196,400,000	
	スター精密	83,000	1,912.00	158,696,000	
	I D E C	55,000	2,359.00	129,745,000	
	日本信号	121,600	1,210.00	147,136,000	
	スミダコーポレーション	138,000	2,014.00	277,932,000	
	新電元工業	19,000	6,980.00	132,620,000	
	アズビル	45,900	4,660.00	213,894,000	
	エスベック	56,800	2,203.00	125,130,400	
	ニチコン	106,000	1,353.00	143,418,000	
	K O A	82,000	2,061.00	169,002,000	
	東京エレクトロン	35,600	16,860.00	600,216,000	
デンソー	23,300	5,644.00	131,505,200		
日産自動車	370,700	1,128.50	418,334,950		
トヨタ自動車	70,200	6,748.00	473,709,600		
アイシン精機	7,800	5,960.00	46,488,000		
S U B A R U	83,900	4,065.00	341,053,500		
ヤマハ発動機	49,500	3,460.00	171,270,000		
愛三工業	29,400	1,076.00	31,634,400		
東京精密	29,800	3,870.00	115,326,000		
大日本印刷	32,000	2,699.00	86,368,000		
リンテック	7,000	2,999.00	20,993,000		
岡村製作所	103,000	1,246.00	128,338,000		
東北電力	64,000	1,470.00	94,080,000		
沖縄電力	51,100	2,415.00	123,406,500		
電源開発	21,500	2,847.00	61,210,500		

西日本旅客鉄道	33,100	7,785.00	257,683,500
センコーグループホールディングス	203,000	792.00	160,776,000
住友倉庫	162,000	766.00	124,092,000
システナ	24,000	2,814.00	67,536,000
SRAホールディングス	18,100	2,973.00	53,811,300
伊藤忠テクノソリューションズ	24,600	4,090.00	100,614,000
ネットワークシステムズ	66,900	1,178.00	78,808,200
日本電信電話	114,200	5,149.00	588,015,800
NTTドコモ	145,400	2,565.50	373,023,700
ジャステック	36,400	1,345.00	48,958,000
ダイワボウホールディングス	46,100	4,670.00	215,287,000
第一興商	13,300	5,170.00	68,761,000
伊藤忠商事	91,900	1,839.50	169,050,050
三井物産	95,200	1,669.00	158,888,800
住友商事	98,600	1,622.00	159,929,200
三菱商事	89,400	2,615.50	233,825,700
稲畑産業	25,500	1,504.00	38,352,000
伊藤忠エネクス	87,000	1,189.00	103,443,000
日鉄住金物産	32,700	6,210.00	203,067,000
パルグループホールディングス	34,400	3,455.00	118,852,000
青山商事	27,400	3,980.00	109,052,000
パルコ	53,600	1,354.00	72,574,400
丸井グループ	50,400	1,572.00	79,228,800
あおぞら銀行	40,700	4,275.00	173,992,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,430,000	720.60	1,030,458,000
りそなホールディングス	328,000	559.00	183,352,000
三井住友トラスト・ホールディングス	17,600	3,982.00	70,083,200
武蔵野銀行	22,700	3,290.00	74,683,000
ふくおかフィナンシャルグループ	241,000	517.00	124,597,000
セブン銀行	210,000	403.00	84,630,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	27,000	3,599.00	97,173,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	34,000	1,823.00	61,982,000
第一生命ホールディングス	127,900	1,972.00	252,218,800
東京海上ホールディングス	60,400	4,381.00	264,612,400
東京センチュリー	26,000	4,970.00	129,220,000
オリックス	214,600	1,804.00	387,138,400
レオパレス21	80,000	783.00	62,640,000
スターツコーポレーション	66,000	2,813.00	185,658,000
ユー・エス・エス	50,000	2,213.00	110,650,000
ソラスト	63,000	2,038.00	128,394,000
丹青社	107,000	1,368.00	146,376,000
メイテック	7,200	5,570.00	40,104,000
合計 109銘柄	10,761,800	-	18,407,478,440

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29年3月27日現在 金額（円）	平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	14,650,382	25,412,899
コール・ローン	2,007,362	11,335,424
投資証券	1,555,410,273	1,484,497,368
未収入金	-	30,443
未収配当金	5,798,587	3,803,301
流動資産合計	1,577,866,604	1,525,079,435
資産合計	1,577,866,604	1,525,079,435
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	1,521,442,900	1,374,522,046
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	56,423,704	150,557,389
元本等合計	1,577,866,604	1,525,079,435
純資産合計	1,577,866,604	1,525,079,435
負債純資産合計	1,577,866,604	1,525,079,435

[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29年3月28日 至 平成29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29年3月27日現在	平成29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	1,615,286,744円	1,521,442,900円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	93,843,844円	146,920,854円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,521,442,900円	1,374,522,046円
合計	1,521,442,900円	1,374,522,046円
2. 受益権の総数	1,521,442,900口	1,374,522,046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29年3月28日 至 平成29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29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、当該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29年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	33,913,767
合計	33,913,767

「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29年3月27日まで)を指しております。

(平成29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	9,332,454
合計	9,332,454

「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29年3月28日から平成29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29年3月27日現在)

該当事項はありません。

(平成29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29年3月28日 至 平成29年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年3月27日現在	平成29年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.0371円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,371円)」	1口当たり純資産額 1.1095円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,095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	日本プロロジスリート投資法人	204	48,694,800	
	投資証券	日本ビルファンド投資法人	88	49,544,000	
	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	60	32,340,000	
	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	233	38,654,700	
	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	60	37,260,000	
			小計(日本)5銘柄	645	206,493,500
アメリカ・ドル	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-D	7,289.000	197,386.120	
	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	11,541.000	298,681.080	
	投資証券	CROWN CASTLE INTL CORP	2,800.000	278,796.000	
	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,300.000	147,277.000	
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	6,896.000	455,342.880	
	投資証券	GGP INC	8,900.000	187,256.000	
	投資証券	HERSHA HOSPITALITY TRUST-D	6,230.000	159,431.930	
	投資証券	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	9,800.000	323,400.000	
	投資証券	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,200.000	297,936.000	
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,721.000	281,400.710	
	投資証券	SUNSTONE HOTEL INVESTORS-F	5,242.000	137,602.500	
	投資証券	VEREIT INC	48,000.000	407,040.000	
	投資証券	WELLTOWER INC	8,731.000	626,973.110	

	小計(アメリカ・ドル)13銘柄		125,650.000	3,798,523.330 (426,916,036)	
カナダ ・ドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,805.000	194,931.900	
	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,963.000	214,126.070	
	投資証券	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4,400.000	130,284.000	
	小計(カナダ・ドル)3銘柄		19,168.000	539,341.970 (49,004,611)	
オースト ラリア・ ドル	投資証券	DEXUS	52,045.000	493,386.600	
	投資証券	GPT GROUP	84,839.000	416,559.490	
	投資証券	INGENIA COMMUNITIES GROUP	181,604.000	463,090.200	
	投資証券	MIRVAC GROUP	134,434.000	305,165.180	
	投資証券	SCENTRE GROUP	110,848.000	433,415.680	
	投資証券	STOCKLAND	79,142.000	337,936.340	
小計(オーストラリア・ドル)6銘柄		642,912.000	2,449,553.490 (216,834,475)		
シンガ ポール・ ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	110,305.000	295,617.400	
	投資証券	CAPITALAND MALL TRUST	120,856.000	244,129.120	
	投資証券	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,120.000	167,639.600	
	小計(シンガポール・ドル)3銘柄		370,281.000	707,386.120 (58,635,235)	
イギリ ス・ボン ド	投資証券	ASSURA PLC	178,395.000	109,891.320	
	投資証券	HAMMERSON PLC	36,924.000	197,912.640	
	投資証券	SEGRO PLC	126,908.000	675,150.560	
	投資証券	TRITAX BIG BOX REIT PLC	329,423.000	469,098.350	
小計(イギリス・ポンド)4銘柄		671,650.000	1,452,052.870 (219,405,189)		
ユーロ	投資証券	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	21,846.000	264,991.980	
	投資証券	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	22,261.000	370,200.430	
	投資証券	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6,703.000	241,106.910	
	投資証券	GECINA SA	3,368.000	455,522.000	
	投資証券	ICADE	3,538.000	265,703.800	
	投資証券	KLEPIERRE	3,758.000	123,299.980	
	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,926.000	599,830.000	
小計(ユーロ)7銘柄		64,400.000	2,320,655.100 (307,208,322)		
合計				1,484,497,368 (1,278,003,868)	

- (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 13銘柄	27.99%	28.76%
カナダ・ドル	投資証券 3銘柄	3.21%	3.30%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	14.22%	14.61%
シンガポール・ドル	投資証券 3銘柄	3.84%	3.95%
イギリス・ポンド	投資証券 4銘柄	14.39%	14.78%
ユーロ	投資証券 7銘柄	20.14%	20.69%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

グローバル好配当株マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成29年3月27日現在 金額（円）	平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	549,513,145	436,535,312
コール・ローン	500,795,488	251,901,471
株式	69,957,593,046	69,880,844,297
投資証券	26,165,633	261,414,338
派生商品評価勘定	51,480	35,000
未収配当金	181,089,227	275,283,443
流動資産合計	71,215,208,019	71,106,013,861
資産合計	71,215,208,019	71,106,013,861
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	48,809	-
未払解約金	26,243,892	101,832,487
流動負債合計	26,292,701	101,832,487
負債合計	26,292,701	101,832,487
純資産の部		
元本等		
元本	39,936,402,354	36,047,061,352
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	31,252,512,964	34,957,120,022
元本等合計	71,188,915,318	71,004,181,374
純資産合計	71,188,915,318	71,004,181,374
負債純資産合計	71,215,208,019	71,106,013,861

[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29年 3月28日 至 平成29年 9月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 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。 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。 外国株式及び外国投資証券についての受取配当金は、原則として、株式及び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。 (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29年 3月27日現在	平成29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	44,290,929,056円	39,936,402,354円
期中追加設定元本額	242,864,988円	209,997,053円
期中一部解約元本額	4,597,391,690円	4,099,338,055円
元本の内訳		
グローバル好配当株オープン	39,068,397,478円	35,264,027,820円
グローバル資産分散オープン	868,004,876円	783,033,532円
合計	39,936,402,354円	36,047,061,352円
2. 受益権の総数	39,936,402,354口	36,047,061,352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29年 3月28日 至 平成29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29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、当該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29年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	1,561,394,862
投 資 証 券	309,665
合 計	1,561,085,197

「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29年1月11日から平成29年3月27日まで）を指しております。

(平成29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	1,495,725,892
投 資 証 券	3,605,715
合 計	1,499,331,607

「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29年7月11日から平成29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29年3月27日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	5,678,640	-	5,629,831	48,809
	売建 香港・ドル	5,678,640	-	5,627,160	51,480
合 計		-	-	11,256,991	2,671

区分	種類	平成29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	393,330,000	-	393,295,000	35,000
合 計		-	-	393,295,000	35,000

(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29年3月28日 至 平成29年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年3月27日現在		平成29年9月27日現在	
1口当たり純資産額	1.7826円 「1口 = 1円(10,000口 = 17,826円)」	1口当たり純資産額	1.9698円 「1口 = 1円(10,000口 = 19,698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	3,863.00	898,920,100	
	D I C	172,000	4,035.00	694,020,000	
	ディスコ	51,500	22,320.00	1,149,480,000	
	アズビル	296,800	4,660.00	1,383,088,000	
	S U B A R U	190,000	4,065.00	772,350,000	
	N T T ドコモ	409,300	2,565.50	1,050,059,150	
	三井物産	370,000	1,669.00	617,530,000	
	オリックス	288,000	1,804.00	519,552,000	
	小計(日本)8銘柄	2,010,300	-	7,084,999,250	
アメリカ ・ドル	ALLERGAN PLC	14,000	209.450	2,932,300.000	
	ALTRIA GROUP INC	127,180	64.520	8,205,653.600	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	122,900	82.280	10,112,212.000	
	ANALOG DEVICES INC	104,830	83.910	8,796,285.300	
	APPLE INC	36,080	153.140	5,525,291.200	
	AT&T INC	224,200	38.720	8,681,024.000	
	BROADCOM LTD	34,250	237.270	8,126,497.500	
	CARNIVAL CORP	152,740	65.320	9,976,976.800	
	COCA-COLA CO/THE	130,000	45.570	5,924,100.000	
	CONOCOPHILLIPS	180,070	49.670	8,944,076.900	
	EXXON MOBIL CORP	87,000	80.890	7,037,430.000	
	HOME DEPOT INC	65,720	161.260	10,598,007.200	
	JM SMUCKER CO/THE	46,890	106.080	4,974,091.200	
	JPMORGAN CHASE & CO	96,380	93.700	9,030,806.000	
	MCDONALD'S CORP	62,500	153.350	9,584,375.000	
	MERCK & CO. INC.	145,900	64.760	9,448,484.000	
	MICROSOFT CORP	145,000	73.260	10,622,700.000	
	NEXTERA ENERGY INC	76,250	147.700	11,262,125.000	
	NORTHERN TRUST CORP	81,500	89.870	7,324,405.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	36,210	284.740	10,310,435.400	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	74,310	112.210	8,338,325.100	
	RAYTHEON COMPANY	58,000	184.670	10,710,860.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	44,000	192.700	8,478,800.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	77,000	79.080	6,089,160.000		
WESTERN DIGITAL CORP	47,000	86.280	4,055,160.000		
小計(アメリカ・ドル)25銘柄	2,269,910	-	205,089,581.200 (23,050,018,031)		
カナダ ・ドル	MANULIFE FINANCIAL CORP	200,000	24.770	4,954,000.000	
	小計(カナダ・ドル)1銘柄	200,000	-	4,954,000.000 (450,120,440)	
オーストラリア ・ドル	AMCOR LIMITED	770,320	15.280	11,770,489.600	
	AMP LTD	1,731,600	4.880	8,450,208.000	
	WESTPAC BANKING CORP	345,559	31.890	11,019,876.510	
	小計(オーストラリア・ドル)3銘柄	2,847,479	-	31,240,574.110 (2,765,415,620)	
香港 ・ドル	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	3,915,000	31.950	125,084,250.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,120,000	38.100	80,772,000.000	
	CHINA MOBILE LTD	633,000	79.850	50,545,050.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,870,000	25.200	72,324,000.000	
	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	9,338,000	5.410	50,518,580.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	698,500	99.400	69,430,900.000	
	SANDS CHINA LTD	2,320,000	38.950	90,364,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	360,000	126.000	45,360,000.000	
	小計(香港・ドル) 8 銘柄	22,254,500	-	584,398,780.000 (8,409,498,444)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,108,000	3.680	7,757,440.000	
	小計(シンガポール・ドル) 1 銘柄	2,108,000	-	7,757,440.000 (643,014,202)	
台湾・ドル	DELTA ELECTRONICS INC	1,554,000	155.500	241,647,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,702,131	214.000	364,256,034.000	
	小計(台湾・ドル) 2 銘柄	3,256,131	-	605,903,034.000 (2,253,959,286)	
イギリス・ポンド	ASTRAZENECA PLC	111,900	48.880	5,469,672.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,100	46.500	6,886,650.000	
	BUNZL PLC	221,830	22.200	4,924,626.000	
	IMPERIAL BRANDS PLC	153,710	32.745	5,033,233.950	
	ITV PLC	1,400,000	1.690	2,366,000.000	
	NATIONAL GRID PLC	661,008	9.432	6,234,627.450	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	76,300	67.900	5,180,770.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	266,680	22.780	6,074,970.400	
	小計(イギリス・ポンド) 8 銘柄	3,039,528	-	42,170,549.800 (6,371,970,075)	
スイス・フラン	GIVAUDAN-REG	4,100	2,097.000	8,597,700.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	167,000	56.450	9,427,150.000	
	NOVARTIS AG-REG	89,490	82.900	7,418,721.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,500	246.800	8,021,000.000	
	SWISS RE AG	71,600	84.800	6,071,680.000	
	UBS GROUP AG-REG	472,570	16.210	7,660,359.700	
	小計(スイス・フラン) 6 銘柄	837,260	-	47,196,610.700 (5,465,839,485)	
デンマーク・クローネ	PANDORA A/S	34,500	603.500	20,820,750.000	
	小計(デンマーク・クローネ) 1 銘柄	34,500	-	20,820,750.000 (370,401,143)	
ノルウェー・クローネ	TELENOR ASA	458,200	164.000	75,144,800.000	
	小計(ノルウェー・クローネ) 1 銘柄	458,200	-	75,144,800.000 (1,068,559,056)	
韓国・ウォン	KT&G CORP	78,300	105,000.000	8,221,500,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1 銘柄	78,300	-	8,221,500,000.000 (812,284,200)	
ユーロ	ACCOR SA	189,880	40.870	7,760,395.600	
	ALLIANZ SE-REG	37,000	185.450	6,861,650.000	
	ATLANTIA SPA	270,000	26.490	7,152,300.000	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	427,800	15.725	6,727,155.000	
	ING GROEP NV	565,710	15.255	8,629,906.050	
	KONE OYJ-B	151,660	45.840	6,952,094.400	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	325,945	15.540	5,065,185.300	
	ORANGE	328,000	13.840	4,539,520.000	
	RELX NV	430,082	17.845	7,674,813.290	
	SAMPO OYJ-A SHS	167,470	43.450	7,276,571.500	
	SOCIETE GENERALE SA	145,000	47.960	6,954,200.000	
	TOTAL SA	188,230	45.255	8,518,348.650	
	小計(ユーロ) 12銘柄	3,226,777	-	84,112,139.790 (11,134,765,065)	
	合計	42,620,885	-	69,880,844.297 (62,795,845,047)	

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
シンガポール・ドル	投資証券	ACCORDIA GOLF TRUST	4,350,000.000	3,153,750.000	
		小計(シンガポール・ドル) 1 銘柄	4,350,000.000	3,153,750.000 (261,414,338)	
		合計		261,414,338 (261,414,338)	

- (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	25銘柄	32.48%	32.88%
カナダ・ドル	外国株式	1銘柄	0.63%	0.64%
オーストラリア・ドル	外国株式	3銘柄	3.89%	3.94%
香港・ドル	外国株式	8銘柄	11.84%	11.99%
シンガポール・ドル	外国株式	1銘柄	0.91%	0.92%
台湾・ドル	外国株式	2銘柄	3.17%	3.21%
イギリス・ポンド	外国株式	8銘柄	8.97%	9.08%
スイス・フラン	外国株式	6銘柄	7.70%	7.79%
デンマーク・クローネ	外国株式	1銘柄	0.52%	0.53%
ノルウェー・クローネ	外国株式	1銘柄	1.50%	1.52%
韓国・ウォン	外国株式	1銘柄	1.14%	1.16%
ユーロ	外国株式	12銘柄	15.68%	15.87%
シンガポール・ドル	投資証券	1銘柄	0.36%	0.37%

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](#)

新興国債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成29年3月27日現在 金額（円）	平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	371,169,878	127,190,191
コール・ローン	150,027,859	150,094,503
国債証券	5,707,889,908	5,921,285,200
特殊債券	683,869,997	760,957,586
社債券	2,205,258,858	2,531,319,453
派生商品評価勘定	178,474	31,329
未収入金	124,471,402	-
未収利息	107,780,116	111,832,172
前払費用	22,563,679	19,054,729
流動資産合計	9,373,210,171	9,621,765,163
資産合計	9,373,210,171	9,621,765,163
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,609,692	1,934,293
未払金	253,147,586	-
流動負債合計	255,757,278	1,934,293
負債合計	255,757,278	1,934,293
純資産の部		
元本等		
元本	4,203,735,328	4,120,097,935
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,913,717,565	5,499,732,935
元本等合計	9,117,452,893	9,619,830,870
純資産合計	9,117,452,893	9,619,830,870
負債純資産合計	9,373,210,171	9,621,765,163

[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29年 3月28日 至 平成29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	<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29年 3月27日現在	平成29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	3,977,082,619円	4,203,735,328円
期中追加設定元本額	882,101,944円	312,755,918円
期中一部解約元本額	655,449,235円	396,393,311円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	503,103,909円	428,125,690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）	1,623,497,833円	1,460,905,651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）	2,077,133,586円	2,231,066,594円
合計	4,203,735,328円	4,120,097,935円
2. 受益権の総数	4,203,735,328口	4,120,097,935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29年 3月28日 至 平成29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29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、当該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29年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	8,173,273
特殊債券	5,872,602
社債券	6,878,844
合計	20,924,719

「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11月8日から平成29年3月27日まで）を指しております。

(平成29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	98,125,689
特殊債券	11,610,589
社債券	50,668,570
合計	160,404,848

「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29年5月9日から平成29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29年3月27日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	53,158,271	-	51,178,803	1,979,468
	売建 メキシコ・ペソ	53,158,271	-	53,610,021	451,750
合計		-	-	104,788,824	2,431,218

区分	種類	平成29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	195,232,938	-	194,354,337	878,601
	売建 メキシコ・ペソ	195,232,938	-	196,257,301	1,024,363
合計		-	-	390,611,638	1,902,964

(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29年3月28日 至 平成29年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年3月27日現在	平成29年9月27日現在
1口当たり純資産額 2.1689円 「1口 = 1円(10,000口 = 21,689円)」	1口当たり純資産額 2.3349円 「1口 = 1円(10,000口 = 23,349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	ARGENT 6.875 01/26/27	250,000.000	271,375.000	
	国債証券	ARGENT 7.125 06/28/17	143,000.000	141,570.000	
	国債証券	ARGENT 7.5 04/22/26	2,125,000.000	2,399,125.000	
	国債証券	ARGENT 8.28 12/31/33	1,184,722.110	1,380,793.560	
	国債証券	BRAZIL 4.25 01/07/25	625,000.000	630,781.250	
	国債証券	BRAZIL 4.875 01/22/21	150,000.000	160,530.000	
	国債証券	BRAZIL 5 01/27/45	859,000.000	794,575.000	
	国債証券	BRAZIL 5.625 01/07/41	100,000.000	100,750.000	
	国債証券	CHILE 3.125 03/27/25	800,000.000	825,200.000	
	国債証券	COLOM 4 02/26/24	1,250,000.000	1,302,812.500	
	国債証券	COLOM 4.375 07/12/21	400,000.000	427,000.000	
	国債証券	COLOM 5 06/15/45	200,000.000	206,750.000	
	国債証券	COLOM 6.125 01/18/41	650,000.000	768,625.000	
	国債証券	DOMREP 5.5 01/27/25	855,000.000	904,162.500	
	国債証券	DOMREP 5.95 01/25/27	700,000.000	752,500.000	
	国債証券	DOMREP 6.85 01/27/45	360,000.000	403,650.000	
	国債証券	DOMREP 7.45 04/30/44	300,000.000	359,625.000	
	国債証券	EGYPT 5.875 06/11/25	400,000.000	402,540.000	
	国債証券	EGYPT 6.875 04/30/40	100,000.000	97,845.000	
	国債証券	EGYPT 7.5 01/31/27	1,060,000.000	1,162,449.000	
	国債証券	EGYPT 8.5 01/31/47	600,000.000	670,680.000	
	国債証券	ELSALV 5.875 01/30/25	560,000.000	536,200.000	
	国債証券	ELSALV 6.375 01/18/27	240,000.000	231,600.000	
	国債証券	ELSALV 7.75 01/24/23	465,000.000	491,737.500	
	国債証券	ELSALV 8.625 02/28/29	165,000.000	180,881.250	
	国債証券	GHANA 10.75 10/14/30	200,000.000	259,390.000	
	国債証券	GHANA 7.875 08/07/23	200,000.000	212,250.000	
	国債証券	GHANA 8.125 01/18/26	600,000.000	636,750.000	
	国債証券	GHANA 9.25 09/15/22	1,200,000.000	1,334,100.000	
	国債証券	INDOIS 4.35 09/10/24	1,400,000.000	1,494,570.000	
	国債証券	INDOIS 4.55 03/29/26	450,000.000	483,187.500	
	国債証券	IVYCST FL 12/31/32	965,000.000	952,339.180	
	国債証券	JAMAN 6.75 04/28/28	700,000.000	808,500.000	
	国債証券	JAMAN 7.875 07/28/45	400,000.000	494,000.000	
	国債証券	JAMAN 8 03/15/39	845,000.000	1,049,912.500	
	国債証券	LEBAN 6.6 11/27/26	520,000.000	514,482.800	
	国債証券	LEBAN 6.85 03/23/27	1,230,000.000	1,233,210.300	
	国債証券	LEBAN 8.25 04/12/21	900,000.000	972,414.000	
	国債証券	MEX 3.6 01/30/25	250,000.000	257,202.500	
	国債証券	OMAN 4.75 06/15/26	750,000.000	743,497.500	
国債証券	OMAN 6.5 03/08/47	200,000.000	206,714.000		
国債証券	OMANIB 4.75 06/15/26	500,000.000	495,665.000		
国債証券	PANAMA 6.7 01/26/36	300,000.000	400,500.000		
国債証券	PKSTAN 6.75 12/03/19	775,000.000	812,944.000		
国債証券	POLAND 5 03/23/22	500,000.000	555,500.000		
国債証券	RUSSIA 12.75 06/24/28	100,000.000	176,645.000		
国債証券	RUSSIA 4.875 09/16/23	800,000.000	875,048.000		

国債証券	SENEGL 6.25 05/23/33	400,000.000	412,712.000
国債証券	SERBIA 5.875 12/03/18	340,000.000	353,532.000
国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	3,200,000.000	3,709,504.000
国債証券	SERBIA FL 11/01/24	306,478.390	313,763.370
国債証券	SOAF 4.665 01/17/24	2,198,000.000	2,259,500.040
国債証券	SRILAN 5.875 07/25/22	1,850,000.000	1,979,703.500
国債証券	SRILAN 6.2 05/11/27	400,000.000	423,400.000
国債証券	SRILAN 6.25 07/27/21	1,200,000.000	1,297,464.000
国債証券	SRILAN 6.25 10/04/20	200,000.000	214,130.000
国債証券	SRILAN 6.85 11/03/25	200,000.000	221,508.000
国債証券	TURKEY 11.875 01/15/30	130,000.000	207,356.500
国債証券	TURKEY 5.125 03/25/22	200,000.000	209,644.000
国債証券	TURKEY 5.75 05/11/47	200,000.000	196,000.000
国債証券	TURKEY 6 03/25/27	200,000.000	214,532.000
国債証券	TURKEY 6.25 09/26/22	1,350,000.000	1,481,274.000
国債証券	TURKEY 7.375 02/05/25	950,000.000	1,103,596.000
国債証券	TURKSK 4.489 11/25/24	925,000.000	919,265.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/21	2,100,000.000	2,230,452.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/22	400,000.000	424,200.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/25	500,000.000	517,670.000
国債証券	VIETNM 4.8 11/19/24	1,450,000.000	1,555,096.000
国債証券	ZAMBIN 8.97 07/30/27	200,000.000	214,940.000
特殊債券	BNCE FL 08/11/26	1,000,000.000	1,007,500.000
特殊債券	BNDES 5.5 07/12/20	1,200,000.000	1,265,160.000
特殊債券	DBKAZ 4.125 12/10/22	1,000,000.000	1,016,800.000
特殊債券	ESKOM 7.125 02/11/25	820,000.000	857,129.600
特殊債券	EXCRTU 5.375 02/08/21	200,000.000	207,256.000
特殊債券	EXCRTU 5.875 04/24/19	400,000.000	415,200.000
特殊債券	PEMEX 5.5 06/27/44	106,000.000	98,601.200
特殊債券	PEMEX 6.5 06/02/41	1,754,000.000	1,831,526.800
社債券	AKBNK FL 03/16/27	200,000.000	210,752.000
社債券	ALFAA 6.875 03/25/44	200,000.000	226,000.000
社債券	ALLLBZ 7.375 02/09/24	200,000.000	219,000.000
社債券	AVALCB 4.75 09/26/22	200,000.000	205,440.000
社債券	BANBOG 6.25 05/12/26	200,000.000	218,500.000
社債券	BANBRA FL PERPETUAL	200,000.000	214,500.000
社債券	BANORT FL 10/04/31	250,000.000	257,125.000
社債券	BANORT FL PERPETUAL	200,000.000	219,500.000
社債券	BBVASM FL 11/12/29	200,000.000	203,500.000
社債券	BDOPM 2.95 03/06/23	200,000.000	199,470.000
社債券	BEEFBZ 6.5 09/20/26	200,000.000	202,400.000
社債券	BEEFBZ 7.75 01/31/23	200,000.000	210,250.000
社債券	CEMEX 7.75 04/16/26	200,000.000	230,000.000
社債券	CHGRID 4.125 05/07/24	300,000.000	322,503.000
社債券	CHGRID 4.375 05/22/43	500,000.000	548,935.000
社債券	CIFIHG FL PERPETUAL	200,000.000	200,062.000
社債券	CIKLIS 4.95 09/14/26	200,000.000	204,500.000
社債券	CWCLN 6.875 09/15/27	200,000.000	208,500.000
社債券	DIALIN 6.125 10/31/26	200,000.000	216,750.000
社債券	EBIUH FL PERPETUAL	200,000.000	204,038.000
社債券	EMAAAR 3.635 09/15/26	200,000.000	197,452.000
社債券	ENAPCL 4.5 09/14/47	200,000.000	193,800.000
社債券	EQPTRC 4.25 11/03/26	400,000.000	412,988.000
社債券	EXIMBK 3.375 08/05/26	900,000.000	890,253.000
社債券	EXIMBK 4 01/14/23	500,000.000	525,345.000
社債券	GALIAR 8.25 07/19/26	200,000.000	224,294.000
社債券	GARAN FL 05/24/27	200,000.000	200,466.000
社債券	GCCAMM 5.25 06/23/24	200,000.000	208,500.000
社債券	GTLKOA 5.125 05/31/24	695,000.000	705,404.150
社債券	HKHKD 3.875 04/08/23	200,000.000	205,078.000
社債券	ICTPM 5.875 09/17/25	200,000.000	221,232.000
社債券	INDYIJ 6.375 01/24/23	200,000.000	203,448.000
社債券	IRCPAR 8.75 03/23/23	60,000.000	67,663.800
社債券	IRCPAR 8.75 03/23/23	200,000.000	225,546.000
社債券	ISRELE 5 11/12/24	400,000.000	435,388.000
社債券	KERPW 8.75 01/31/22	200,000.000	220,494.000
社債券	KIONET 8.25 11/07/21	200,000.000	205,764.000

社債券	KZOKZ 5.75 04/30/43	950,000.000	962,625.500	
社債券	KZOKZ 7 05/05/20	450,000.000	491,670.000	
社債券	METINR 4.85 05/02/24	200,000.000	203,684.000	
社債券	MEXCAT 5.5 07/31/47	200,000.000	204,140.000	
社債券	MIICF 6 03/15/25	200,000.000	213,752.000	
社債券	MRFGBZ 8 06/08/23	200,000.000	207,990.000	
社債券	MTNSJ 6.5 10/13/26	200,000.000	215,050.000	
社債券	NSBLK 8.875 09/18/18	200,000.000	210,540.000	
社債券	PEMEX 5.625 01/23/46	200,000.000	188,300.000	
社債券	PEMEX 6.75 09/21/47	810,000.000	860,989.500	
社債券	PEMEX 6.875 08/04/26	800,000.000	915,024.000	
社債券	PERTIJ 5.625 05/20/43	1,225,000.000	1,337,528.500	
社債券	PETBRA 6.85 06/05/15	589,000.000	558,813.750	
社債券	PETBRA 8.375 05/23/21	740,000.000	854,788.800	
社債券	PETBRA 8.75 05/23/26	650,000.000	778,830.000	
社債券	PETRTT 9.75 08/14/19	500,000.000	533,415.000	
社債券	PGASIJ 5.125 05/16/24	200,000.000	217,740.000	
社債券	RPCUH 6 08/31/36	200,000.000	234,250.000	
社債券	RSHB 8.5 10/16/23	200,000.000	224,338.000	
社債券	RURAIL 5.7 04/05/22	400,000.000	434,516.000	
社債券	SANTAN FL PERPETUAL	200,000.000	213,094.000	
社債券	SBERRU 6.125 02/07/22	300,000.000	328,443.000	
社債券	SBERRU FL 02/26/24	200,000.000	204,242.000	
社債券	SGCAZE 6.875 03/24/26	500,000.000	561,065.000	
社債券	TCZIRA 4.75 04/29/21	650,000.000	658,755.500	
社債券	TNEMAK 5.5 02/28/23	200,000.000	206,000.000	
社債券	VIP 7.25 04/26/23	200,000.000	227,654.000	
社債券	VMETAL 5.375 05/04/27	200,000.000	210,560.000	
	小計(アメリカ・ドル) 142銘柄	74,875,200.500	80,253,635.350 (9,019,706,077)	
メキシコ ・ペソ	国債証券	MBONO 6.5 06/10/21	18,500,000.000	18,434,695.000
	国債証券	MBONO 7.5 06/03/27	10,700,000.000	11,248,803.000
	特殊債券	PEMEX 7.19 09/12/24	1,400,000.000	1,283,940.000
		小計(メキシコ・ペソ) 3銘柄	30,600,000.000	30,967,438.000 (193,856,162)
合計			9,213,562,239 (9,213,562,239)	

- (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	93.75%	97.90%
	特殊債券		
	社債券		
メキシコ・ペソ	国債証券	2.02%	2.10%
	特殊債券		

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)

欧州債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成29年3月27日現在 金額（円）	平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	20,029,272	153,202,866
コール・ローン	448,858	437,960
国債証券	750,912,805	671,043,853
特殊債券	33,702,475	5,759,568
社債券	240,083,737	182,431,810
派生商品評価勘定	2,690,712	5,911,118
未収利息	13,056,434	8,276,088
前払費用	1,927,676	709,670
流動資産合計	1,062,851,969	1,027,772,933
資産合計	1,062,851,969	1,027,772,933
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,861,188	4,511,263
流動負債合計	2,861,188	4,511,263
負債合計	2,861,188	4,511,263
純資産の部		
元本等		
元本	872,516,386	743,375,258
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	187,474,395	279,886,412
元本等合計	1,059,990,781	1,023,261,670
純資産合計	1,059,990,781	1,023,261,670
負債純資産合計	1,062,851,969	1,027,772,933

[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29年3月28日 至 平成29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29年3月27日現在	平成29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	872,516,386円	872,516,386円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	-	129,141,128円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	872,516,386円	743,375,258円
合計	872,516,386円	743,375,258円
2. 受益権の総数	872,516,386口	743,375,258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29年3月28日 至 平成29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29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、当該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29年3月27日現在)

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	16,897,319
特殊債券	133,696
社債券	3,914,165
合計	12,849,458

「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29年3月27日まで）を指しております。

(平成29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	8,889,396
特殊債券	51,576
社債券	2,251,578
合計	11,192,550

「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29年3月28日から平成29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29年3月27日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	イギリス・ボンド	6,919,881	-	6,842,231	77,650
	スイス・フラン	4,291,577	-	4,251,440	40,137
	スウェーデン・クローナ	5,306,566	-	5,182,960	123,606
	セルビア・ディナール	591,422	-	586,271	5,151
	チェコ・コルナ	10,530,619	-	10,271,380	259,239
	ロシア・ルーブル	9,717,739	-	10,007,594	289,855
	ユーロ	116,074,988	-	113,796,153	2,278,835
	売建				
	イギリス・ボンド	3,079,145	-	3,007,214	71,931
	デンマーク・クローネ	9,638,768	-	9,615,805	22,963
	ノルウェー・クローネ	1,378,650	-	1,314,010	64,640
	スウェーデン・クローナ	16,136,572	-	15,908,940	227,632
	セルビア・ディナール	20,989,351	-	20,563,173	426,178
	ルーマニア・レイ	28,870,427	-	27,956,268	914,159
	ロシア・ルーブル	18,131,310	-	18,132,231	921
	ポーランド・ズロチ	17,850,765	-	17,787,239	63,526
	ユーロ	37,357,804	-	36,823,625	534,179
	合計	-	-	302,046,534	170,476

区分	種類	平成29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	68,842,553	-	71,564,090	2,721,537
	スイス・フラン	3,869,432	-	3,940,260	70,828
	デンマーク・クローネ	5,292,704	-	5,341,792	49,088
	ノルウェー・クローネ	6,352,366	-	6,493,970	141,604
	スウェーデン・クローナ	753,598	-	763,853	10,255
	セルビア・ディナール	1,965,809	-	1,987,825	22,016
	チェコ・コルナ	10,530,619	-	11,722,270	1,191,651
	ルーマニア・レイ	7,867,803	-	7,999,019	131,216
	ポーランド・ズロチ	4,535,953	-	4,553,892	17,939
	ユーロ	96,958,606	-	98,502,263	1,543,657
	売建				
	イギリス・ポンド	12,608,172	-	13,012,531	404,359
	スイス・フラン	228,140	-	231,780	3,640
	デンマーク・クローネ	3,578,353	-	3,626,555	48,202
	ノルウェー・クローネ	490,000	-	497,350	7,350
	スウェーデン・クローナ	21,813,999	-	22,643,237	829,238
	セルビア・ディナール	13,678,996	-	13,815,286	136,290
	チェコ・コルナ	1,519,480	-	1,577,900	58,420
	ルーマニア・レイ	21,466,274	-	22,025,132	558,858
	ロシア・ルーブル	8,378,373	-	8,601,202	222,829
	ポーランド・ズロチ	13,196,819	-	13,272,991	76,172
	ユーロ	110,010,837	-	112,165,415	2,154,578
	合計	-	-	424,338,613	1,399,855

(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29年3月28日 至 平成29年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年3月27日現在	平成29年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.2149円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,149円)」	1口当たり純資産額 1.3765円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,765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	202,000.000	307,070.300	
	国債証券	UKT 4.75 12/07/30	16,000.000	22,072.160	
	国債証券	UKT 4.75 12/07/38	149,000.000	223,868.030	
	小計(イギリス・ポンド) 3銘柄		367,000.000	553,010.490 (83,559,885)	
デンマーク ・ク ローネ	国債証券	DGB 4.5 11/15/39	140,000.000	236,537.000	
	社債券	RDKRE 2 04/01/24	350,000.000	384,261.500	
	小計(デンマーク・クローネ) 2銘柄		490,000.000	620,798.500 (11,044,005)	
スウェー デン・ク ローナ	特殊債券	EIB 1.75 11/12/26	400,000.000	416,756.000	
	社債券	NDASS 1 04/08/22	800,000.000	813,080.000	
	社債券	NDASS 1.25 05/19/21	500,000.000	516,125.000	
	社債券	SEB 1.5 06/17/20	500,000.000	518,850.000	
	小計(スウェーデン・クローナ) 4銘柄		2,200,000.000	2,264,811.000 (31,299,688)	
セルビ ア・ディ ナール	国債証券	SERBGB 10 08/21/19	18,000,000.000	19,985,040.000	
	小計(セルビア・ディナール) 1銘柄		18,000,000.000	19,985,040.000 (22,165,408)	
ルーマニ	国債証券	ROMGB 5.85 04/26/23	420,000.000	476,271.600	

ア・レイ	小計(ルーマニア・レイ) 1銘柄		420,000.000	476,271.600 (13,716,622)
ロシア・ルーブル	国債証券	RFLB 8.15 02/03/27	4,100,000.000	4,282,245.000
	小計(ロシア・ルーブル) 1銘柄		4,100,000.000	4,282,245.000 (8,307,555)
ポーランド・ズロチ	国債証券	POLGB 2.25 04/25/22	220,000.000	217,250.000
	国債証券	POLGB 2.5 07/25/26	55,000.000	51,994.250
	国債証券	POLGB 5.75 09/23/22	90,000.000	102,969.000
	小計(ポーランド・ズロチ) 3銘柄		365,000.000	372,213.250 (11,505,112)
ユーロ	国債証券	ALBANI 5.75 11/12/20	100,000.000	112,867.000
	国債証券	BGB 0.8 06/22/25	38,000.000	39,319.740
	国債証券	BGB 4.25 03/28/41	80,000.000	123,488.000
	国債証券	BGB 4.5 03/28/26	70,000.000	94,105.900
	国債証券	BGB 5 03/28/35	26,000.000	41,534.220
	国債証券	BTPS 2 12/01/25	132,000.000	133,851.960
	国債証券	BTPS 4.5 03/01/24	172,000.000	204,981.000
	国債証券	BTPS 4.75 09/01/28	29,000.000	35,870.100
	国債証券	BTPS 4.75 09/01/44	162,000.000	205,286.400
	国債証券	BTPS 5 03/01/22	74,000.000	87,993.400
	国債証券	BTPS 5 09/01/40	94,000.000	121,893.560
	国債証券	BTPS 5.5 09/01/22	274,000.000	335,499.300
	国債証券	BTPS 5.75 02/01/33	29,000.000	40,232.570
	国債証券	CYPRUS 3.75 07/26/23	23,000.000	26,074.180
	国債証券	CYPRUS 3.875 05/06/22	130,000.000	146,575.000
	国債証券	DBR 0.25 02/15/27	19,000.000	18,848.570
	国債証券	DBR 2 01/04/22	181,000.000	200,142.560
	国債証券	DBR 2.5 07/04/44	14,000.000	18,258.380
	国債証券	DBR 2.5 08/15/46	27,000.000	35,485.290
	国債証券	FRTR 0.25 11/25/26	207,000.000	200,142.090
	国債証券	FRTR 1.25 05/25/36	143,000.000	139,261.980
	国債証券	FRTR 3.25 05/25/45	231,000.000	309,777.930
	国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	56,000.000	92,041.600
	国債証券	INDON 2.875 07/08/21	149,000.000	160,861.890
	国債証券	IRISH 2 02/18/45	21,000.000	21,725.130
	国債証券	IRISH 5.4 03/13/25	38,000.000	51,720.660
	国債証券	ISRAEL 2.875 01/29/24	100,000.000	113,739.000
	国債証券	MEX 3.625 04/09/29	100,000.000	114,271.000
	国債証券	PGB 3.875 02/15/30	88,000.000	96,613.440
	国債証券	PGB 4.95 10/25/23	32,000.000	38,716.480
	国債証券	RAGB 3.8 01/26/62	13,000.000	21,420.490
	国債証券	SLOREP 1.25 03/22/27	116,000.000	118,845.480
	国債証券	SLOREP 1.5 03/25/35	15,000.000	14,610.750
	国債証券	SLOREP 2.25 03/03/32	13,000.000	14,591.980
	国債証券	SLOREP 5.125 03/30/26	83,000.000	113,805.450
	国債証券	SPGB 5.15 10/31/44	33,000.000	47,967.150
	国債証券	SPGB 5.9 07/30/26	212,000.000	292,935.240
	社債券	CMZB 4 03/23/26	50,000.000	55,814.000
	社債券	DEXGRP 0.625 01/21/22	50,000.000	51,269.500
	社債券	HETAR 2.375 12/13/22	300,000.000	329,664.000
	社債券	ISLBAN 1.75 09/07/20	140,000.000	144,796.400
	社債券	LOXAM 7 07/23/22	100,000.000	106,125.000
	社債券	NWIDE 6.75 07/22/20	50,000.000	58,892.000
	社債券	PEMEX 2.75 04/21/27	110,000.000	103,440.700
	社債券	PEMEX 5.5 02/24/25	10,000.000	11,591.000
	社債券	PSMGR 2.625 04/15/21	7,000.000	7,422.170
	社債券	UNICZ 0.625 04/30/20	100,000.000	101,013.000
	社債券	VERALL 8.25 02/15/22	100,000.000	106,976.000
	社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	56,518.500
小計(ユーロ) 49銘柄		4,391,000.000	5,118,877.140 (677,636,956)	
合計			859,235,231 (859,235,231)	

- (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	8.17%	9.72%
デンマーク・クローネ	国債証券 1銘柄	1.08%	1.29%
	社債券 1銘柄		
スウェーデン・クローナ	特殊債券 1銘柄	3.06%	3.64%
	社債券 3銘柄		
セルビア・ディナール	国債証券 1銘柄	2.17%	2.58%
ルーマニア・レイ	国債証券 1銘柄	1.34%	1.60%
ロシア・ルーブル	国債証券 1銘柄	0.81%	0.97%
ポーランド・ズロチ	国債証券 3銘柄	1.12%	1.34%
ユーロ	国債証券 37銘柄	66.22%	78.86%
	社債券 12銘柄		

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)

アジア・オセアニア債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成29年3月27日現在 金額（円）	平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	97,986,465	17,515,481
コール・ローン	9,690,467	48,317,209
国債証券	248,737,539	256,953,841
特殊債券	702,850,707	702,216,204
未収利息	6,410,987	6,619,742
前払費用	886,626	1,829,560
流動資産合計	1,066,562,791	1,033,452,037
資産合計	1,066,562,791	1,033,452,037
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	797,606,853	739,216,954
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	268,955,938	294,235,083
元本等合計	1,066,562,791	1,033,452,037
純資産合計	1,066,562,791	1,033,452,037
負債純資産合計	1,066,562,791	1,033,452,037

[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29年3月28日 至 平成29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29年3月27日現在	平成29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	855,464,668円	797,606,853円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	57,857,815円	58,389,899円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	797,606,853円	739,216,954円
合計	797,606,853円	739,216,954円
2. 受益権の総数	797,606,853口	739,216,954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29年3月28日 至 平成29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29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、当該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29年3月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,221,395
特殊債券	4,839,482
合計	10,060,877

「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29年3月27日まで)を指しております。

(平成29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	43,189
特殊債券	2,596,008
合計	2,639,197

「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29年3月28日から平成29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29年3月27日現在)

該当事項はありません。

(平成29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29年3月28日 至 平成29年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年3月27日現在	平成29年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.3372円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,372円)」	1口当たり純資産額 1.3980円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,980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	1,495,000.000	1,514,584.500	
	特殊債券	EUROF 6 03/30/22	500,000.000	565,685.000	
	特殊債券	IBRD 2.8 01/12/22	2,000,000.000	2,013,760.000	
	小計(オーストラリア・ドル) 3銘柄		3,995,000.000	4,094,029.500 (362,403,491)	
香港・ドル	国債証券	HKGB 0.79 06/18/18	2,000,000.000	2,005,320.000	
	国債証券	HKGB 2.44 12/07/20	2,000,000.000	2,088,200.000	
	小計(香港・ドル) 2銘柄		4,000,000.000	4,093,520.000 (58,905,753)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.5 06/01/19	700,000.000	713,594.000	
	小計(シンガポール・ドル) 1銘柄		700,000.000	713,594.000 (59,149,807)	
ニュージーランド・ドル	特殊債券	EIB 7.5 12/15/17	1,200,000.000	1,213,824.000	
	特殊債券	IBRD 3.5 01/22/21	1,000,000.000	1,025,500.000	
	特殊債券	NIB 4.875 01/22/19	900,000.000	930,168.000	
	特殊債券	RENTEN 4 01/30/20	1,000,000.000	1,033,510.000	
	小計(ニュージーランド・ドル) 4銘柄		4,100,000.000	4,203,002.000 (339,812,712)	
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 4.25 06/10/21	300,000,000.000	324,558,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1銘柄		300,000,000.000	324,558,000.000 (32,066,330)	
マレーシ	国債証券	MGS 3.8 08/17/23	4,000,000.000	4,007,200.000	

ア・リン ギット	小計(マレーシア・リングット) 1 銘柄	4,000,000.000	4,007,200.000 (106,831,952)	
合計			959,170,045 (959,170,045)	

- (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 3 銘柄	35.07%	37.78%
香港・ドル	国債証券 2 銘柄	5.70%	6.14%
シンガポール・ドル	国債証券 1 銘柄	5.72%	6.17%
ニュージーランド・ドル	特殊債券 4 銘柄	32.88%	35.43%
韓国・ウォン	国債証券 1 銘柄	3.10%	3.34%
マレーシア・リングット	国債証券 1 銘柄	10.34%	11.14%

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29年3月27日現在 金額（円）	平成29年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,201,244	1,020,153
社債券	516,108,208	526,771,930
未収利息	2,031,700	4,475,379
流動資産合計	519,341,152	532,267,462
資産合計	519,341,152	532,267,462
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	1,013,097,372	1,013,118,413
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	493,756,220	480,850,951
元本等合計	519,341,152	532,267,462
純資産合計	519,341,152	532,267,462
負債純資産合計	519,341,152	532,267,462

[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29年3月28日 至 平成29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た価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年3月27日現在	平成29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	1,157,551,219円	1,013,097,372円
期中追加設定元本額	-	21,041円
期中一部解約元本額	144,453,847円	-
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,013,097,372円	1,013,118,413円
合計	1,013,097,372円	1,013,118,413円
2. 受益権の総数	1,013,097,372口	1,013,118,413口
3. 元本の欠損		
	493,756,220円	480,850,951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29年3月28日 至 平成29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、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29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、当該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29年3月27日現在）

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
社債券	25,826,836
合計	25,826,836

「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29年3月27日まで）を指しております。

（平成29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	1,550,982
合計	1,550,982

「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29年3月28日から平成29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29年3月27日現在）

該当事項はありません。

（平成29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29年3月28日 至 平成29年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成29年3月27日現在	平成29年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.5126円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,126円）」	1口当たり純資産額 0.5254円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,254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	5,000,000.000	4,687,000.000	
	小計（アメリカ・ドル）1銘柄		5,000,000.000	4,687,000.000 (526,771,930)	
合計				526,771,930 (526,771,930)	

（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	98.96%	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12月31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12月31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。

ティー・ロウ・プライス・ファンズ SICAV

貸借対照表

2016年12月31日現在

	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）	1,255,471,535	1,622,784,065	322,218,572
評価（損）益	89,972,140	25,137,089	(5,040,791)
有価証券（時価）	1,345,443,675	1,647,921,154	317,177,781
TBA取引（時価）	-	-	13,014,354
現金預金	40,970,267	29,755,418	21,565,377
有価証券売却に係る未収入金	320,089	27	3,620,595
未収配当金および未収利息	4,140,269	28,293,492	1,697,183
発行未収金	1,538,083	2,151,522	2,739,967
為替予約取引に係る評価益	-	2,694,786	80,956
オプション（時価）	-	-	19,297
先物取引に係る評価益	-	-	119,500
スワップ契約（時価）	-	1,190,407	-
委託証拠金	-	-	-
その他の資産	6,085	5,201	6,224
資産 合計	1,392,418,468	1,712,012,007	360,041,234
負 債			
有価証券購入に係る未払金	-	-	16,970,504
買戻未払金	189,231	443,455	771,686
為替予約取引に係る評価損	-	29,546,626	3,904,732
未払運用報酬	1,211,079	1,226,809	94,258
オプション（時価）	-	97,895	-
スワップ契約（時価）	-	387,439	-
委託証拠金	-	-	14,861
先物取引に係る評価損	-	-	110,436
当座貸越	-	433	-

その他の負債	414,865	406,934	78,762
負債 合計	1,815,175	32,109,591	21,945,239
純資産	1,390,603,293	1,679,902,416	338,095,995

ティー・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12月31日に終了した期間

	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）	39,258	107,560,234	7,506,330
受取配当金（源泉税控除後）	24,686,283	603,609	3,061
スワップに係る利息	-	142,007	-
その他収益	-	-	-
収益 合計	24,725,541	108,305,850	7,509,391
費用			
運用報酬	13,873,368	14,796,393	913,823
預金費用	408,670	196,884	29,801
管理会社報酬	271,698	342,735	75,981
専門家報酬	173,660	135,789	42,170
年次税	257,587	648,524	57,435
スワップに係る利息	-	451,217	-
支払利息	20	3,183	28
その他の費用	138,361	120,663	23,979
費用 合計	15,123,364	16,695,388	1,143,217
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	9,602,177	91,610,462	6,366,174
運用会社により免除または 負担された費用	27,470	51,915	31,309
投資（損）益 合計	9,629,647	91,662,377	6,397,483
実現（損）益の内訳：			
スイング・プライシング	730,900	894,170	49,734
有価証券（外国税控除後）	(175,095)	(28,182,079)	(184,622)
TBA取引	-	-	115,795
為替予約取引	145,000	4,912,815	(3,244,540)
先物取引	-	-	(373,714)
オプション	-	63,000	6,828
スワップ	-	(567,477)	-
外貨取引	(214,418)	821,075	(514,161)
実現（損）益 合計	486,387	(22,058,496)	(4,144,680)
評価（損）益の内訳：			
有価証券（外国税控除後）	137,906,871	142,610,974	(3,695,278)

TBA取引	-	-	(13,978)
為替予約取引	-	(15,263,128)	(3,597,463)
先物取引	-	-	(55,979)
オプション	-	23,547	2,031
スワップ	-	720,576	-
外貨建のその他の資産および負債	(83,194)	35,695	-
評価(損)益 合計	137,823,677	128,127,664	(7,360,667)
運用による純資産の純増(減)額	147,939,711	197,731,545	(5,107,864)
分配金:			
分配による純資産の減少額	(93,187)	(9,994,041)	(1,384,426)
資本取引:			
投資証券発行受領額	458,374,831	710,981,149	229,862,677
投資証券買戻支払額	(357,563,492)	(657,660,779)	(61,840,800)
資本取引による純資産の純増(減)額	100,811,339	53,320,370	168,021,877
純資産の増(減)額 合計	248,657,863	241,057,874	161,529,587
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	1,390,603,293	1,679,902,416	338,095,995

ティー・ロウ・プライス・ファンズ SICAV

投資証券口数変動計算書

2016年12月31日に終了した期間

(特段の注記のない限り金額は米ドル) クラスJd	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
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	13,124	572,348	475,435
買戻投資証券口数	(200,161)	(1,300,475)	(681,339)
期末現在発行済投資証券	646,494	5,099,459	4,672,065

ティー・ロウ・プライス・ファンズ SICAV

一口当たり純資産額

(特段の注記のない限り金額は米ドル) 以下の時点のクラスJd証券一口当たり純資産額:	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
2016年12月31日	7.08	9.79	10.72
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12月31日現在

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	66,900	10,528,722	0.76
Tenaris SA, ADR	USD	211,000	7,564,350	0.54
			18,093,072	1.30
ベルギー				
Anheuser-Busch InBev SA/NV	EUR	53,783	5,705,422	0.41
			5,705,422	0.41
ブラジル				
Banco Bradesco SA Preference	BRL	1,677,021	14,942,578	1.07
BR Malls Participacoes SA	BRL	2,044,190	7,505,475	0.54
BRF SA	BRL	502,412	7,448,115	0.54
Itau Unibanco Holding SA Preference	BRL	5,154,924	53,612,984	3.86
Lojas Renner SA	BRL	6,101,400	43,435,474	3.12
Multipian Empreendimentos Imobiliarios SA	BRL	410,900	7,496,618	0.54
Raia Drogasil SA	BRL	1,017,000	19,120,112	1.37
Telefonica Brasil SA, ADR Preference	USD	449,900	6,015,163	0.43
			159,576,519	11.47
チリ				
Banco Santander Chile, ADR	USD	569,443	12,459,413	0.90
SACI Falabella	CLP	1,196,698	9,495,443	0.68
			21,954,856	1.58
中国				
58.com, Inc., ADR	USD	134,400	3,757,824	0.27
Alibaba Group Holding Ltd., ADR	USD	501,763	43,864,121	3.15
Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'A' **	CNY	1,860,446	4,538,934	0.33
Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'H'	HKD	1,300,500	3,524,278	0.25
BAIC Motor Corp. Ltd. 'H'	HKD	3,041,500	2,703,000	0.19
Baidu, Inc., ADR	USD	185,100	30,846,915	2.22
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	HKD	553,500	2,609,424	0.19
China Longyuan Power Group Corp. Ltd. 'H'	HKD	7,904,000	6,150,811	0.44
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	HKD	7,645,000	14,670,816	1.05
CNOOC Ltd.	HKD	4,763,000	5,919,451	0.42
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	HKD	7,920,000	8,429,462	0.61
Dongfeng Motor Group Co. Ltd. 'H'	HKD	1,302,000	1,267,395	0.09
Hengan International Group Co. Ltd.	HKD	2,459,000	18,029,711	1.30
Huaneng Renewables Corp. Ltd. 'H'	HKD	18,442,000	5,969,624	0.43
Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A' **	CNY	169,546	8,152,729	0.59
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'A' **	CNY	541,800	2,761,331	0.20
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	HKD	3,691,600	18,384,192	1.32
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	HKD	1,685,000	7,347,708	0.53
Tencent Holdings Ltd.	HKD	3,075,100	74,929,410	5.39
Vipshop Holdings Ltd., ADR	USD	669,000	7,345,620	0.53
			271,202,756	19.50
コロンビア				
Grupo Aval Acciones y Valores SA, ADR Preference	USD	746,909	6,064,901	0.44
			6,064,901	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	6,320,000	35,515,527	2.56
ACM Pacific Technology Ltd.	HKD	448,900	4,749,564	0.34
			40,265,091	2.90
インド				
Axis Bank Ltd.	INR	2,457,473	16,195,072	1.17
Glenmark Pharmaceuticals Ltd.	INR	582,273	7,593,414	0.55
HDFC Bank Ltd.	INR	289,896	5,642,702	0.41
Housing Development Finance Corp. Ltd.	INR	1,291,909	23,958,499	1.72
ICICI Bank Ltd.	INR	2,979,263	11,124,394	0.80
Infosys Ltd.	INR	2,259,605	33,547,146	2.41
Maruti Suzuki India Ltd.	INR	136,984	10,678,214	0.77
NTPC Ltd.	INR	3,122,074	7,552,659	0.54
Power Grid Corp. of India Ltd.	INR	3,072,313	8,297,454	0.60
Tata Consultancy Services Ltd.	INR	205,421	7,141,460	0.51
Tata Motors Ltd.	INR	1,858,488	12,854,758	0.92
Yes Bank Ltd.	INR	392,392	6,652,469	0.48
			151,238,241	10.88
インドネシア				
Astra International Tbk. PT	IDR	24,314,700	14,887,314	1.07
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	17,077,300	19,650,063	1.41
Matahari Department Store Tbk. PT	IDR	5,782,900	6,482,217	0.47
			41,019,594	2.95
マレーシア				
Astro Malaysia Holdings Bhd.	MYR	4,598,000	2,664,561	0.19
			2,664,561	0.19
メキシコ				
Fresnillo plc	GBP	529,311	8,003,640	0.57
Grupo Financiero Santander Mexico SAB de CV, ADR	USD	960,900	6,908,871	0.50
WalMart de Mexico SAB de CV	MXN	10,252,840	18,616,227	1.34
			33,528,738	2.41
フィリピン				
BDO Unbank, Inc.	PHP	3,113,150	7,032,456	0.50
GT Capital Holdings, Inc.	PHP	314,485	8,052,319	0.58
GM Investments Corp.	PHP	1,219,578	16,122,222	1.16
Universal Robina Corp.	PHP	4,760,060	15,677,075	1.13
			46,884,072	3.37
ロシア				
Magnit PJSC, GDR	USD	848,624	37,466,749	2.69
Sberbank of Russia PJSC, ADR	USD	3,673,829	42,524,571	3.06
Yandex NV 'A'	USD	365,300	7,455,773	0.54
			87,447,093	6.29
南アフリカ				
Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	ZAR	683,474	14,148,342	1.02
FirstRand Ltd.	ZAR	5,020,056	19,484,227	1.40
Mr Price Group Ltd.	ZAR	666,081	7,757,679	0.56
Naspers Ltd. 'N'	ZAR	72,028	10,589,811	0.76
Sanlam Ltd.	ZAR	3,258,481	14,961,454	1.08
Shoprite Holdings Ltd.	ZAR	630,985	7,897,503	0.57
Woolworths Holdings Ltd.	ZAR	3,364,294	17,441,450	1.25
			92,280,466	6.64
韓国				
AMOREPACIFIC Group	KRW	65,606	7,242,473	0.52
Hyundai Glovis Co. Ltd.	KRW	21,164	2,716,518	0.20
Hyundai Motor Co.	KRW	120,218	14,572,879	1.05
LG Household & Health Care Ltd.	KRW	42,533	30,251,946	2.18
NAVER Corp.	KRW	20,650	13,282,199	0.95

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	42,792	63,981,924	4.60
Samsung Electronics Co. Ltd. Preference	KRW	10,091	12,002,955	0.86
SK Hynix, Inc.	KRW	427,621	15,845,251	1.14
			159,896,145	11.50
台湾				
Catcher Technology Co. Ltd.	TWD	3,124,000	21,473,766	1.54
Delta Electronics, Inc.	TWD	1,591,268	7,800,039	0.56
Largan Precision Co. Ltd.	TWD	162,000	18,838,551	1.36
Quanta Computer, Inc.	TWD	3,849,000	7,134,005	0.51
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	9,331,050	52,049,436	3.74
Uni-President Enterprises Corp.	TWD	13,139,783	21,625,669	1.56
			126,921,466	9.27
タイ				
CP ALL PCL	THB	8,833,300	15,432,040	1.11
Kasikornbank PCL, NVDR	THB	2,051,900	10,148,160	0.73
Siam Cement PCL (The), NVDR	THB	537,050	7,442,549	0.53
			33,022,749	2.37
トルコ				
BİM Birlesik Magazalar A/S	TRY	719,874	10,033,914	0.72
Türkiye Garanti Bankasi A/S	TRY	3,237,988	7,007,119	0.50
			17,041,033	1.22
アラブ首長国連邦				
DP World Ltd.	USD	769,300	13,470,443	0.97
Emaar Malls PJSC	AED	8,280,883	5,907,186	0.42
First Gulf Bank PJSC	AED	2,646,494	9,259,271	0.67
			28,636,900	2.06
株式 計			1,345,443,675	96.75
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			1,345,443,675	96.75
有価証券 計			1,345,443,675	96.75
現金				
			40,970,267	2.95
その他資産（負債）				
			4,189,351	0.30
純資産 計			1,390,603,293	100.00

国別投資比率

	純資産比率 (%)
中国	19.50
韓国	11.50
ブラジル	11.47
インド	10.88
台湾	9.27
南アフリカ	6.64
ロシア	6.29
フィリピン	3.37
インドネシア	2.95
香港	2.90
メキシコ	2.41
タイ	2.37
アラブ首長国連邦	2.06
チリ	1.58
アルゼンチン	1.30
トルコ	1.22
コロンビア	0.44
ベルギー	0.41
マレーシア	0.19
有価証券 計	96.75
現金及びその他資産（負債）	3.25
合計	100.00

ティー・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12月31日現在

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				
Codere Finance 2 Luxembourg SA, Reg. S 6.75% 01/11/2021	EUR	1,775,000	1,902,801	0.11
Codere Finance 2 Luxembourg SA, Reg. S 7.625% 01/11/2021	USD	2,250,000	2,205,000	0.13
YFF SA, 144A 8.5% 23/03/2021	USD	8,240,000	8,872,956	0.53
			12,980,757	0.77
オーストリア				
Erste Group Bank AG, Reg. S, FRN 8.875% Perpetual	EUR	1,800,000	2,049,117	0.12
			2,049,117	0.12
ブラジル				
Minerva Luxembourg SA, 144A 7.75% 31/01/2023	USD	3,975,000	4,189,710	0.25
Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026	USD	4,100,000	4,425,540	0.26
Petrobras Global Finance BV 6.875% 20/01/2040	USD	2,075,000	1,783,660	0.10
Petrobras Global Finance BV 6.75% 27/01/2041	USD	3,175,000	2,679,684	0.16
Vale Overseas Ltd. 5.875% 10/06/2021	USD	3,650,000	3,833,905	0.23
Vale Overseas Ltd. 6.25% 10/08/2026	USD	3,500,000	3,661,175	0.22
			20,573,674	1.22
カナダ				
Alberta Energy Co. Ltd. 8.125% 15/09/2030	USD	765,000	919,675	0.05
Alberta Energy Co. Ltd. 7.375% 01/11/2031	USD	6,865,000	7,888,242	0.47
Encana Corp. 7.2% 01/11/2031	USD	4,115,000	4,628,799	0.28
Entertainment One Ltd., Reg. S 6.875% 15/12/2022	GBP	3,000,000	4,040,298	0.24
			17,477,014	1.04
中国				
Nord Anglia Education Finance LLC, Reg. S 5.75% 15/07/2022	CHF	2,660,000	2,773,013	0.17
			2,773,013	0.17
クロアチア				
Agrokor dd, Reg. S 9.875% 01/05/2019	EUR	425,000	466,023	0.03
Agrokor dd, Reg. S 9.125% 01/02/2020	EUR	3,525,000	3,879,641	0.23
			4,345,664	0.26
フランス				
ContourGlobal Power Holdings SA, Reg. S 5.125% 15/06/2021	EUR	1,575,000	1,749,724	0.10
Credit Agricole SA, FRN, 144A 6.625% Perpetual	USD	4,200,000	4,100,082	0.24
Horizon Holdings I SAS, Reg. S 7.25% 01/08/2023	EUR	4,700,000	5,317,026	0.32
SFR Group SA, Reg. S 6.25% 15/05/2024	USD	4,990,000	5,021,637	0.30
Synlab Bondco plc, Reg. S 6.25% 01/07/2022	EUR	3,200,000	3,688,350	0.22
Synlab Unsecured Bondco plc, Reg. S 8.25% 01/07/2023	EUR	1,600,000	1,848,403	0.11
			21,726,222	1.29
ドイツ				
Garfunkelux Holdco 3 SA, Reg. S 8.5% 01/11/2022	GBP	2,275,000	2,940,140	0.17

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Kirk Beauty One GmbH, Reg. S 8.75% 15/07/2023	EUR	1,975,000	2,292,343	0.14
Pleiderer GmbH, Reg. S 7.875% 01/08/2019	EUR	3,400,000	3,747,213	0.22
Safari Holding Verwaltungs GmbH, Reg. S 8.25% 15/02/2021	EUR	1,925,000	2,139,344	0.13
			11,119,040	0.66
ギリシャ				
Intrakot Capital Luxembourg SA, Reg. S 6.75% 15/09/2021	EUR	2,400,000	2,577,371	0.15
OTE plc, Reg. S 7.875% 07/02/2018	EUR	1,750,000	1,960,684	0.12
			4,538,255	0.27
インドネシア				
TBG Global Pte. Ltd., Reg. S 5.25% 10/02/2022	USD	1,825,000	1,829,030	0.11
			1,829,030	0.11
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance plc, 144A 7.25% 15/05/2024	USD	5,878,000	6,179,247	0.37
			6,179,247	0.37
イタリア				
Bormioli Rocco Holdings SA, Reg. S 10% 01/08/2018	EUR	4,000,000	4,358,330	0.26
Guala Closures SpA, Reg. S, FRN 4.75% 15/11/2021	EUR	850,000	923,975	0.06
International Game Technology plc, 144A 6.25% 15/02/2022	USD	4,750,000	5,118,125	0.30
International Game Technology plc, 144A 6.5% 15/02/2025	USD	8,150,000	8,761,250	0.52
Schumann SpA, Reg. S 7% 31/07/2023	EUR	675,000	742,974	0.04
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 8% Perpetual	USD	1,800,000	1,656,981	0.10
Wind Acquisition Finance SA, Reg. S 7.375% 23/04/2021	USD	6,025,000	6,237,140	0.37
			27,798,775	1.65
日本				
Universal Entertainment Corp., Reg. S, 144A 8.5% 24/08/2020	USD	3,500,000	3,535,000	0.21
			3,535,000	0.21
カザフスタン				
Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC, Reg. S 7.25% 28/01/2021	USD	640,000	687,616	0.04
			687,616	0.04
ルクセンブルグ				
Alice Financing SA, 144A 7.5% 15/05/2026	USD	6,050,000	6,280,142	0.37
Alice Financing SA, Reg. S 6.5% 15/01/2022	USD	5,025,000	5,236,502	0.31
Alice Finco SA, 144A 8.125% 15/01/2024	USD	5,127,000	5,346,410	0.32
Alice Luxembourg SA, 144A 7.75% 15/05/2022	USD	1,675,000	1,790,081	0.11
Alice Luxembourg SA, Reg. S 7.75% 15/05/2022	USD	11,450,000	12,275,545	0.73
LSP9 Balta Issuer SA, Reg. S 7.75% 15/09/2022	EUR	4,740,000	5,532,129	0.33
Millicom International Cellular SA, Reg. S 6.625% 15/10/2021	USD	1,200,000	1,264,272	0.08
			37,725,061	2.25
メキシコ				
Cemex SAB de CV, 144A 7.75% 16/04/2026	USD	4,025,000	4,467,287	0.27
			4,467,287	0.27

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	3,965,660	0.24
Nyrstar Netherlands Holdings BV, Reg. S 8.5% 15/09/2019	EUR	4,850,000	5,575,519	0.33
UPC Holding BV, Reg. S 6.75% 15/03/2023	EUR	3,625,000	4,179,968	0.25
UPC Holding BV, Reg. S 6.75% 15/03/2023	CHF	1,900,000	2,037,380	0.12
Ziggo Bond Finance BV, 144A 6% 15/01/2027	USD	3,675,000	3,573,019	0.21
			19,332,546	1.15
ロシア				
Gazprom OAO, Reg. S 9.25% 23/04/2019	USD	2,800,000	3,178,406	0.19
VimpelCom Holdings BV, Reg. S 5.2% 13/02/2019	USD	1,675,000	1,732,754	0.10
			4,911,160	0.29
スペイン				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S, FRN 7% Perpetual	EUR	3,600,000	3,652,188	0.22
Banco Santander SA, Reg. S, FRN 6.375% Perpetual	USD	5,600,000	5,219,368	0.31
Cirsa Funding Luxembourg SA, 144A 5.75% 15/05/2021	EUR	1,500,000	1,707,154	0.10
Cirsa Funding Luxembourg SA, Reg. S 5.875% 15/05/2023	EUR	2,475,000	2,779,204	0.17
			13,357,914	0.80
スイス				
SIG Combibloc Holdings SCA, Reg. S 7.75% 15/02/2023	EUR	3,800,000	4,329,080	0.26
Transocean, Inc. 6% 15/03/2018	USD	2,244,000	2,282,215	0.14
Transocean, Inc. 6.5% 15/11/2020	USD	400,000	399,580	0.02
Transocean, Inc. 6.8% 15/03/2038	USD	1,325,000	1,038,343	0.06
			8,049,218	0.48
イギリス				
Arqiva Broadcast Finance plc, Reg. S 9.5% 31/03/2020	GBP	7,325,000	9,687,083	0.58
Cabot Financial Luxembourg SA, Reg. S 7.5% 01/10/2023	GBP	2,400,000	2,991,761	0.18
Debenhams plc, Reg. S 5.25% 15/07/2021	GBP	800,000	1,042,257	0.06
HSBC Holdings plc, FRN 6.875% Perpetual	USD	2,115,000	2,231,484	0.13
INEOS Group Holdings SA, Reg. S 5.375% 01/08/2024	EUR	4,000,000	4,263,568	0.25
Infinis plc, Reg. S 7% 15/02/2019	GBP	1,325,000	1,680,589	0.10
Iron Mountain Europe plc, REIT, Reg. S 6.125% 15/09/2022	GBP	2,175,000	2,886,551	0.17
Matalan Finance plc, Reg. S 6.875% 01/06/2019	GBP	660,000	683,966	0.04
New Look Secured Issuer plc, Reg. S 6.5% 01/07/2022	GBP	3,650,000	4,330,245	0.26
New Look Senior Issuer plc, Reg. S 8% 01/07/2023	GBP	1,210,000	1,298,794	0.08
Standard Chartered plc, FRN, 144A 7.5% Perpetual	USD	4,425,000	4,432,036	0.26
Virgin Media Finance plc, Reg. S 7% 15/04/2023	GBP	2,750,000	3,694,991	0.22
Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC, Reg. S 5.5% 15/09/2024	GBP	1,975,000	2,452,627	0.15
Virgin Media Secured Finance plc, Reg. S 6.25% 28/03/2029	GBP	150,000	195,350	0.01
			41,871,302	2.49

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
アメリカ				
AES Corp. 5.5% 15/03/2024	USD	4,575,000	4,649,641	0.28
AES Corp. 6% 15/05/2026	USD	2,050,000	2,080,750	0.12
AGCO Corp. 5.875% 01/12/2021	USD	3,000,000	3,214,833	0.19
Aircastle Ltd. 5.5% 15/02/2022	USD	2,225,000	2,366,644	0.14
AK Steel Corp. 7.625% 15/05/2020	USD	1,225,000	1,256,819	0.07
AK Steel Corp. 7.625% 01/10/2021	USD	500,000	538,750	0.03
Alliance Data Systems Corp., Reg. S 5.25% 15/11/2023	EUR	4,300,000	4,540,828	0.27
Ally Financial, Inc. 5.125% 30/09/2024	USD	725,000	740,852	0.04
Ally Financial, Inc. 5.75% 20/11/2025	USD	3,025,000	3,026,210	0.18
AMC Entertainment Holdings, Inc. 5.75% 15/06/2025	USD	6,625,000	6,807,188	0.41
AMC Entertainment Holdings, Inc., Reg. S 6.375% 15/11/2024	GBP	1,550,000	2,040,661	0.12
Boardwalk Pipelines LP 4.95% 15/12/2024	USD	1,630,000	1,668,867	0.10
Boardwalk Pipelines LP 5.95% 01/06/2026	USD	1,270,000	1,375,162	0.08
Calpine Corp. 5.375% 15/01/2023	USD	3,225,000	3,169,272	0.19
Carlson Travel, Inc., 144A 6.75% 15/12/2023	USD	750,000	781,875	0.05
Centene Corp. 5.625% 15/02/2021	USD	1,325,000	1,402,844	0.08
Centene Corp. 6.125% 15/02/2024	USD	900,000	950,625	0.06
CenturyLink, Inc. 7.5% 01/04/2024	USD	6,925,000	7,287,281	0.43
CF Industries, Inc. 7.125% 01/05/2020	USD	1,600,000	1,745,272	0.10
CF Industries, Inc. 5.375% 15/03/2044	USD	950,000	790,295	0.05
Chesapeake Energy Corp. 6.125% 15/02/2021	USD	1,800,000	1,755,117	0.10
CNO Financial Group, Inc. 4.5% 30/05/2020	USD	75,000	77,250	-
CNO Financial Group, Inc. 5.25% 30/05/2025	USD	3,750,000	3,764,063	0.22
Community Health Systems, Inc. 6.875% 01/02/2022	USD	900,000	630,000	0.04
Comstock Resources, Inc. 10% 15/03/2020	USD	2,225,000	2,286,187	0.14
Concho Resources, Inc. 5.5% 01/04/2023	USD	4,325,000	4,478,775	0.27
CONSOL Energy, Inc. 5.875% 15/04/2022	USD	2,550,000	2,525,775	0.15
CONSOL Energy, Inc. 8% 01/04/2023	USD	1,175,000	1,211,719	0.07
Continental Resources, Inc. 5% 15/09/2022	USD	1,475,000	1,486,689	0.09
Continental Resources, Inc. 4.9% 01/06/2044	USD	5,625,000	4,819,753	0.29
Crestwood Midstream Partners LP 6.25% 01/04/2023	USD	4,850,000	4,971,250	0.30
Crown Cork & Seal Co., Inc. 7.375% 15/12/2026	USD	250,000	281,250	0.02
DaVita, Inc. 5.125% 15/07/2024	USD	4,650,000	4,631,051	0.28
DaVita, Inc. 5% 01/05/2025	USD	4,650,000	4,603,849	0.27
DCP Midstream Operating LP 5.6% 01/04/2044	USD	475,000	432,250	0.03
DPL, Inc. 7.25% 15/10/2021	USD	4,375,000	4,488,334	0.27
Energy Transfer Equity LP 5.875% 15/01/2024	USD	225,000	232,786	0.01
Enscopl 4.7% 15/03/2021	USD	3,425,000	3,308,670	0.20
Enscopl 5.2% 15/03/2025	USD	3,450,000	3,001,707	0.18
Enscopl 5.75% 01/10/2044	USD	1,150,000	836,366	0.05
EP Energy LLC 9.375% 01/05/2020	USD	3,250,000	3,012,328	0.18
Ferrelgas LP 6.5% 01/05/2021	USD	425,000	421,538	0.03
Ferrelgas LP 6.75% 15/06/2023	USD	925,000	913,437	0.05
Freeport-McMoRan, Inc. 2.375% 15/03/2018	USD	2,350,000	2,347,509	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(%)
Freeport-McMoRan, Inc. 4% 14/11/2021	USD	1,625,000	1,585,391	0.09
Freeport-McMoRan, Inc. 5.4% 14/11/2034	USD	2,275,000	1,918,553	0.11
Group 1 Automotive, Inc. 5% 01/06/2022	USD	2,000,000	1,994,220	0.12
HCA, Inc. 5% 15/03/2024	USD	7,050,000	7,252,758	0.43
HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	275,000	276,156	0.02
HCA, Inc. 5.25% 15/06/2026	USD	3,400,000	3,516,841	0.21
Hess Corp. 7.875% 01/10/2029	USD	7,015,000	8,445,471	0.50
Hess Corp. 7.3% 15/06/2031	USD	1,605,000	1,866,233	0.11
Hess Corp. 7.125% 15/03/2033	USD	375,000	427,672	0.03
HRG Group, Inc. 7.875% 15/07/2019	USD	3,450,000	3,598,781	0.21
Huntsman International LLC 4.875% 15/11/2020	USD	350,000	363,862	0.02
Intelcat Jackson Holdings SA 7.25% 15/10/2020	USD	1,825,000	1,423,500	0.08
JC Penney Corp., Inc. 8.125% 01/10/2019	USD	7,025,000	7,564,028	0.45
Kosmos Energy Ltd., 144A 7.875% 01/08/2021	USD	3,900,000	3,906,084	0.23
Kosmos Energy Ltd., 144A 7.875% 01/08/2021	USD	4,550,000	4,550,000	0.27
Level 3 Communications, Inc. 5.75% 01/12/2022	USD	1,875,000	1,929,394	0.11
Level 3 Financing, Inc. 5.625% 01/02/2023	USD	3,650,000	3,744,955	0.22
Level 3 Financing, Inc. 5.375% 01/05/2025	USD	1,500,000	1,516,973	0.09
LIN Television Corp. 5.875% 15/11/2022	USD	2,425,000	2,485,625	0.15
Manitowoc Foodservice, Inc. 9.5% 15/02/2024	USD	2,300,000	2,662,250	0.16
Matador Resources Co. 6.875% 15/04/2023	USD	5,475,000	5,776,125	0.34
Men's Wearhouse, Inc. (The) 7% 01/07/2022	USD	6,025,000	5,934,053	0.35
MGM Resorts International 6% 15/03/2023	USD	2,325,000	2,518,080	0.15
Molina Healthcare, Inc. 5.375% 15/11/2022	USD	2,300,000	2,346,000	0.14
MPG Holdco I, Inc. 7.375% 15/10/2022	USD	4,100,000	4,305,000	0.26
MPT Operating Partnership LP, REIT 6.375% 01/03/2024	USD	2,125,000	2,233,906	0.13
Nationstar Mortgage LLC 6.5% 01/07/2021	USD	700,000	709,331	0.04
New Albertsons, Inc. 7.45% 01/08/2029	USD	1,625,000	1,543,750	0.09
New Albertsons, Inc. 8% 01/05/2031	USD	950,000	916,750	0.05
NGL Energy Partners LP 5.125% 15/07/2019	USD	800,000	798,000	0.05
Noble Holding International Ltd. 7.2% 01/04/2025	USD	1,350,000	1,272,375	0.08
Noble Holding International Ltd. 8.2% 01/04/2045	USD	1,725,000	1,444,687	0.09
NuStar Logistics LP 4.8% 01/09/2020	USD	400,000	403,000	0.02
ONEOK, Inc. 7.5% 01/09/2023	USD	2,975,000	3,428,688	0.20
Outfront Media Capital LLC 5.625% 15/02/2024	USD	1,325,000	1,383,187	0.08
Penske Automotive Group, Inc. 5.75% 01/10/2022	USD	3,600,000	3,726,432	0.22
Pride International, Inc. 8.5% 15/06/2019	USD	2,545,000	2,850,400	0.17
Pride International, Inc. 6.875% 15/08/2020	USD	890,000	954,525	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 (%)
QEP Resources, Inc. 6.875% 01/03/2021	USD	3,900,000	4,159,720	0.25
Range Resources Corp. 4.875% 15/05/2025	USD	1,725,000	1,679,719	0.10
Regal Entertainment Group 5.75% 15/03/2022	USD	4,925,000	5,163,025	0.31
Rowan Cos., Inc. 4.875% 01/06/2022	USD	2,050,000	1,947,500	0.12
Rowan Cos., Inc. 4.75% 15/01/2024	USD	2,150,000	1,967,250	0.12
Rowan Cos., Inc. 7.375% 15/06/2025	USD	1,850,000	1,902,022	0.11
SEGI LLC 6.375% 01/05/2019	USD	975,000	975,268	0.06
SEGI LLC 7.125% 15/12/2021	USD	11,075,000	11,339,194	0.68
SM Energy Co. 6.5% 01/01/2023	USD	5,740,000	5,861,975	0.35
Southwestern Energy Co. 7.5% 01/02/2018	USD	250,000	262,500	0.02
Southwestern Energy Co. 5.8% 23/01/2020	USD	5,975,000	6,161,838	0.37
Southwestern Energy Co. 6.7% 23/01/2025	USD	1,075,000	1,101,585	0.07
Springleaf Finance Corp. 8.25% 15/12/2020	USD	3,350,000	3,654,666	0.22
Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	USD	6,023,000	6,632,949	0.39
Sprint Communications, Inc. 7% 15/08/2020	USD	2,250,000	2,388,668	0.14
Sprint Communications, Inc. 11.5% 15/11/2021	USD	4,050,000	4,976,012	0.30
Sprint Corp. 7.25% 15/09/2021	USD	9,100,000	9,703,103	0.58
Sunoco LP 6.25% 15/04/2021	USD	2,950,000	3,020,682	0.18
Sunoco LP 6.375% 01/04/2023	USD	1,700,000	1,727,965	0.10
Targa Resources Partners LP 6.75% 15/03/2024	USD	3,300,000	3,555,750	0.21
Tempur Sealy International, Inc. 5.625% 15/10/2023	USD	6,175,000	6,406,563	0.38
Tempur Sealy International, Inc. 5.5% 15/06/2026	USD	2,075,000	2,090,563	0.12
Tenet Healthcare Corp. 8.125% 01/04/2022	USD	5,100,000	4,835,539	0.29
Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	USD	6,375,000	5,662,913	0.34
Terex Corp. 6% 15/05/2021	USD	3,200,000	3,295,408	0.20
Tesoro Logistics LP 6.125% 15/10/2021	USD	875,000	916,978	0.05
Tesoro Logistics LP 5.25% 15/01/2025	USD	1,650,000	1,685,062	0.10
TransDigm, Inc. 6.5% 15/07/2024	USD	1,900,000	1,985,918	0.12
TransDigm, Inc. 6.5% 15/05/2025	USD	1,575,000	1,651,781	0.10
Tribune Media Co. 5.875% 15/07/2022	USD	4,475,000	4,570,094	0.27
United Continental Holdings, Inc. 6% 01/12/2020	USD	3,300,000	3,522,569	0.21
United States Steel Corp. 7.375% 01/04/2020	USD	425,000	454,446	0.03
United States Steel Corp. 6.875% 01/04/2021	USD	550,000	557,785	0.03
VEREIT Operating Partnership LP, REIT 4.125% 01/06/2021	USD	1,375,000	1,402,500	0.08
Vista Outdoor, Inc. 5.875% 01/10/2023	USD	1,975,000	2,069,435	0.12
William Lyon Homes, Inc. 7% 15/08/2022	USD	3,800,000	3,952,000	0.24
WPX Energy, Inc. 7.5% 01/08/2020	USD	1,664,000	1,792,960	0.11
Zayo Group LLC 6.375% 15/05/2025	USD	5,075,000	5,309,719	0.32
			340,668,962	20.29
債券 計			608,194,914	36.20

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				
アルゼンチン				
YPF SA, ADR	USD	120,975	1,948,907	0.12
			1,948,907	0.12
カナダ				
New Gold, Inc.	USD	457,975	1,712,827	0.10
			1,712,827	0.10
コロンビア				
Pacific Exploration and Production Corp.	CAD	103,235	4,342,384	0.26
Pacific Exploration and Production Corp.	USD	21,600	879,012	0.05
			5,221,396	0.31
オランダ				
Alice NV 'A'	EUR	37,779	746,732	0.04
Alice NV 'B'	EUR	12,593	249,841	0.02
			996,573	0.06
イギリス				
Liberty Global plc	USD	22,800	676,248	0.04
Liberty Global plc LILAC 'C'	USD	2,844	60,008	-
			736,256	0.04
アメリカ				
Allergan plc Preference 5.5%	USD	3,829	2,917,698	0.17
American Tower Corp., REIT Preference 5.25%	USD	12,240	1,288,750	0.08
American Tower Corp., REIT Preference 5.5%	USD	10,453	1,092,234	0.06
Crown Castle International Corp., REIT	USD	17,760	1,543,699	0.09
Eldorado Resorts, Inc.	USD	127,675	2,132,173	0.13
First Data Corp. 'A'	USD	94,000	1,334,800	0.08
Hostess Brands, Inc.	USD	165,900	2,148,405	0.13
Howard Hughes Corp. (The)	USD	15,375	1,761,206	0.10
Lands' End, Inc.	USD	1,375	20,900	-
Liberty Broadband Corp. 'C'	USD	28,825	2,120,367	0.13
NextEra Energy, Inc. Preference 6.123%	USD	107,350	5,314,362	0.32
NRG Energy, Inc.	USD	176,187	2,170,624	0.13
Rowan Cos. plc 'A'	USD	145,975	2,783,013	0.17
T-Mobile US, Inc.	USD	80,200	4,581,826	0.27
T-Mobile US, Inc. Preference 5.5%	USD	12,341	1,160,424	0.07
			32,370,481	1.93
株式 計			42,966,440	2.56
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			651,181,354	38.76

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 6.5% 15/05/2021	USD	4,275,000	4,528,849	0.27
FMG Resources August 2006 Pty. Ltd., 144A 9.75% 01/03/2022	USD	14,125,000	16,456,614	0.98
James Hardie International Finance Ltd., 144A 5.875% 15/02/2023	USD	2,300,000	2,392,000	0.14
			23,377,463	1.39

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
ベルギー				
Barry Callebaut Services NV, Reg. S 5.5% 15/06/2023	USD	9,900,000	10,518,651	0.63
			10,518,651	0.63
ブラジル				
Avon International Operations, Inc., 144A 7.875% 15/08/2022	USD	2,675,000	2,832,156	0.17
			2,832,156	0.17
カナダ				
1011778 BC ULC, 144A 4.625% 15/01/2022	USD	2,350,000	2,401,371	0.14
Air Canada, Reg. S 7.75% 15/04/2021	USD	3,150,000	3,535,875	0.21
Bombardier, Inc., 144A 8.75% 01/12/2021	USD	5,850,000	6,222,937	0.37
Cascades, Inc., 144A 5.5% 15/07/2022	USD	1,275,000	1,300,500	0.08
Cascades, Inc., 144A 5.75% 15/07/2023	USD	6,250,000	6,375,000	0.38
Great Canadian Gaming Corp., 144A 6.625% 25/07/2022	CAD	4,100,000	3,227,878	0.19
HudBay Minerals, Inc., 144A 7.25% 15/01/2023	USD	1,600,000	1,664,000	0.10
HudBay Minerals, Inc., 144A 7.625% 15/01/2025	USD	2,475,000	2,586,375	0.16
Lundin Mining Corp., 144A 7.5% 01/11/2020	USD	4,300,000	4,595,625	0.27
Lundin Mining Corp., 144A 7.875% 01/11/2022	USD	1,225,000	1,338,312	0.08
Masonite International Corp., 144A 5.625% 15/03/2023	USD	1,425,000	1,478,438	0.09
New Gold, Inc., 144A 6.25% 15/11/2022	USD	6,025,000	6,205,750	0.37
Norbord, Inc., 144A 6.25% 15/04/2023	USD	2,025,000	2,106,000	0.13
Reliance Intermediate Holdings LP, 144A 6.5% 01/04/2023	USD	3,775,000	3,992,063	0.24
Seven Generations Energy Ltd., 144A 8.25% 15/05/2020	USD	5,075,000	5,404,875	0.32
Seven Generations Energy Ltd., 144A 6.75% 01/05/2023	USD	4,400,000	4,708,000	0.28
Seven Generations Energy Ltd., 144A 6.875% 30/06/2023	USD	1,450,000	1,544,250	0.09
Seven Generations Energy Ltd., Reg. S 6.25% 15/05/2020	USD	2,250,000	2,396,250	0.14
Teck Resources Ltd., 144A 8% 01/08/2021	USD	1,725,000	1,901,812	0.11
Tervita Escrow Corp., 144A 7.625% 01/12/2021	USD	1,000,000	1,022,500	0.06
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 5.375% 15/03/2020	USD	3,425,000	2,911,250	0.17
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 7% 01/10/2020	USD	7,000,000	6,068,125	0.36
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 6.375% 15/10/2020	USD	12,750,000	11,016,765	0.66
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 6.75% 15/08/2021	USD	3,650,000	3,047,750	0.18
			87,051,701	5.18
チリ				
VTR Finance BV, Reg. S 6.875% 15/01/2024	USD	2,475,000	2,587,823	0.15
			2,587,823	0.15
コロンビア				
Pacific Exploration and Production Corp., Reg. S 10% 02/11/2021	USD	4,039,000	4,574,168	0.27
			4,574,168	0.27

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				
Unitymedia GmbH, 144A 6.125% 15/01/2025	USD	450,000	463,090	0.03
Unitymedia GmbH, Reg. S 6.125% 15/01/2025	USD	3,525,000	3,648,375	0.22
Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG, Reg. S 5% 15/01/2025	USD	3,575,000	3,597,344	0.21
			7,708,809	0.46
香港				
Nexteer Automotive Group Ltd., Reg. S 5.875% 15/11/2021	USD	2,675,000	2,798,411	0.17
			2,798,411	0.17
ジャマイカ				
Digicel Group Ltd., 144A 8.25% 30/09/2020	USD	4,375,000	3,781,706	0.23
Digicel Group Ltd., Reg. S 8.25% 30/09/2020	USD	7,750,000	6,685,073	0.40
Digicel Ltd., Reg. S 6% 15/04/2021	USD	2,275,000	2,061,059	0.12
			12,527,838	0.75
ルクセンブルグ				
Alice Luxembourg SA, 144A 7.625% 15/02/2025	USD	10,200,000	10,773,750	0.64
ARD Finance SA, 144A 7.125% 15/09/2023	USD	275,000	272,594	0.02
ARD Finance SA, Reg. S 6.625% 15/09/2023	EUR	5,500,000	5,820,017	0.35
ARD Finance SA, Reg. S 7.125% 15/09/2023	USD	4,800,000	4,758,000	0.28
			21,624,361	1.29
メキシコ				
Petroleos Mexicanos, 144A 5.375% 13/03/2022	USD	1,300,000	1,325,850	0.08
Playa Resorts Holding BV, 144A 8% 15/08/2020	USD	625,000	654,687	0.04
Playa Resorts Holding BV, Reg. S 8% 15/08/2020	USD	2,025,000	2,121,188	0.12
			4,101,725	0.24
オランダ				
Constellium NV, 144A 7.875% 01/04/2021	USD	3,350,000	3,613,813	0.21
Constellium NV, 144A 8% 15/01/2023	USD	750,000	783,750	0.05
Sensata Technologies UK Financing Co. plc, 144A 6.25% 15/02/2026	USD	3,650,000	3,814,250	0.23
Ziggo Bond Finance BV, Reg. S 5.875% 15/01/2025	USD	1,000,000	995,760	0.06
			9,207,573	0.55
パナマ				
Sable International Finance Ltd., Reg. S 6.875% 01/08/2022	USD	2,350,000	2,479,955	0.15
			2,479,955	0.15
スイス				
Transocean, Inc., 144A 9% 15/07/2023	USD	5,450,000	5,613,500	0.33
			5,613,500	0.33
トリニダード・トバゴ				
Consolidated Energy Finance SA, Reg. S 6.75% 15/10/2019	USD	4,750,000	4,773,750	0.28
			4,773,750	0.28
イギリス				
Ashtead Capital, Inc., Reg. S 6.5% 15/07/2022	USD	2,950,000	3,104,875	0.19
Globe Luxembourg SCA, 144A 9.625% 01/05/2018	USD	2,625,000	2,605,313	0.16

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Virgin Media Finance plc, 144A 6.375% 15/04/2023	USD	2,125,000	2,212,677	0.13
Virgin Media Finance plc, Reg. S 6% 15/10/2024	USD	1,900,000	1,964,125	0.12
Virgin Media Secured Finance plc, 144A 5.25% 15/01/2026	USD	1,600,000	1,576,856	0.09
Virgin Media Secured Finance plc, 144A 5.5% 15/08/2026	USD	2,900,000	2,886,631	0.17
			14,350,477	0.86
アメリカ				
24 Hour Holdings III LLC, 144A 8% 01/06/2022	USD	225,000	192,375	0.01
24 Hour Holdings III LLC, Reg. S 8% 01/06/2022	USD	2,775,000	2,372,625	0.14
Accudyne Industries Borrower, 144A 7.75% 15/12/2020	USD	3,775,000	3,171,000	0.19
ADT Corp. (The), 144A 4.875% 15/07/2032	USD	2,250,000	1,867,500	0.11
ADT Corp. (The) 6.25% 15/10/2021	USD	7,375,000	8,047,784	0.48
ADT Corp. (The) 4.125% 15/06/2023	USD	325,000	312,535	0.02
Advanced Disposal Services, Inc., 144A 5.625% 15/11/2024	USD	1,775,000	1,770,562	0.11
Advanced Micro Devices, Inc. 7.5% 15/08/2022	USD	550,000	594,907	0.04
Advanced Micro Devices, Inc. 7% 01/07/2024	USD	3,975,000	4,131,913	0.25
Albertsons Cos. LLC, 144A 6.625% 15/06/2024	USD	4,250,000	4,430,625	0.26
Albertsons Cos. LLC, 144A 5.75% 15/03/2025	USD	4,275,000	4,253,625	0.25
Alcoa Nederland Holding BV, 144A 6.75% 30/09/2024	USD	1,625,000	1,764,912	0.11
Alcoa Nederland Holding BV, 144A 7% 30/09/2026	USD	750,000	823,125	0.05
Aleris International, Inc., 144A 9.5% 01/04/2021	USD	1,550,000	1,670,125	0.10
Aleris International, Inc. 7.875% 01/11/2020	USD	1,300,000	1,309,750	0.08
Alliance Data Systems Corp., 144A 5.875% 01/11/2021	USD	3,125,000	3,179,687	0.19
Alliance Data Systems Corp., 144A 5.375% 01/08/2022	USD	4,525,000	4,389,250	0.26
Alliance Data Systems Corp., Reg. S 5.375% 01/08/2022	USD	3,075,000	2,962,750	0.18
Alliant Holdings Intermediate LLC, 144A 8.25% 01/08/2023	USD	7,950,000	8,228,250	0.49
Allison Transmission, Inc., 144A 5% 01/10/2024	USD	1,850,000	1,877,750	0.11
AMC Entertainment Holdings, Inc., 144A 5.875% 15/11/2026	USD	1,675,000	1,716,875	0.10
AMC Networks, Inc. 4.75% 15/12/2022	USD	3,000,000	3,024,120	0.18
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 'B', 144A 5.625% 15/01/2021	USD	734,695	761,328	0.05
American Builders & Contractors Supply Co., Inc., 144A 5.75% 15/12/2023	USD	1,300,000	1,342,250	0.08
Antero Midstream Partners LP, 144A 5.375% 15/09/2024	USD	2,075,000	2,106,125	0.13
Apex Tool Group LLC, 144A 7% 01/02/2021	USD	4,700,000	4,230,000	0.25
Archrock Partners LP 6% 01/04/2021	USD	2,475,000	2,413,125	0.14
Archrock Partners LP 6% 01/10/2022	USD	2,650,000	2,563,875	0.15
Avis Budget Car Rental LLC, 144A 5.25% 15/03/2025	USD	4,100,000	3,854,000	0.23

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Bankrate, Inc., Reg. S 6.125% 15/08/2018	USD	3,125,000	3,171,875	0.19
BlueLine Rental Finance Corp., 144A 7% 01/02/2019	USD	1,275,000	1,246,312	0.07
BlueLine Rental Finance Corp., Reg. S 7% 01/02/2019	USD	2,425,000	2,370,437	0.14
Boyd Gaming Corp., 144A 6.375% 01/04/2026	USD	2,725,000	2,936,188	0.17
Cable One, Inc., 144A 5.75% 15/06/2022	USD	1,650,000	1,703,955	0.10
Calumet Specialty Products Partners LP, 144A 11.5% 15/01/2021	USD	1,375,000	1,577,812	0.09
CCO Holdings LLC, 144A 5.875% 01/04/2024	USD	7,600,000	8,113,000	0.48
CCO Holdings LLC, 144A 5.5% 01/05/2026	USD	11,050,000	11,298,625	0.67
CCO Holdings LLC 5.75% 01/09/2023	USD	1,900,000	1,990,250	0.12
CEB, Inc., 144A 5.625% 15/06/2023	USD	8,850,000	8,628,750	0.51
Central Garden & Pet Co. 6.125% 15/11/2023	USD	5,800,000	6,148,000	0.37
Cequel Communications Holdings I LLC, 144A 6.375% 15/09/2020	USD	6,900,000	7,117,350	0.42
Cequel Communications Holdings I LLC, 144A 5.125% 15/12/2021	USD	3,300,000	3,366,000	0.20
Cequel Communications Holdings I LLC, 144A 7.75% 15/07/2025	USD	5,710,000	6,355,230	0.38
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 144A 7% 30/06/2024	USD	3,925,000	4,290,496	0.26
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 144A 5.875% 31/03/2025	USD	2,225,000	2,275,062	0.14
Chesapeake Energy Corp., 144A 8% 15/01/2025	USD	2,100,000	2,152,500	0.13
Chesapeake Energy Corp., Reg. S 8% 15/12/2022	USD	4,644,000	5,044,545	0.30
Citigroup, Inc., FRN 5.95% Perpetual	USD	3,825,000	3,888,533	0.23
Claire's Stores, Inc. 10.5% 01/06/2017	USD	3,338,000	1,702,380	0.10
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 6.5% 15/11/2022	USD	3,025,000	3,119,153	0.19
ClubCorp Club Operations, Inc., 144A 8.25% 15/12/2023	USD	3,200,000	3,408,000	0.20
CommScope Technologies Finance LLC, 144A 6% 15/06/2025	USD	5,000,000	5,309,350	0.32
Consolidated Container Co. LLC, Reg. S 10.125% 15/07/2020	USD	3,925,000	4,032,938	0.24
CrownRock LP, 144A 7.125% 15/04/2021	USD	2,575,000	2,690,875	0.16
CrownRock LP, 144A 7.75% 15/02/2023	USD	6,000,000	6,510,000	0.39
CSC Holdings LLC, 144A 10.125% 15/01/2023	USD	7,300,000	8,458,875	0.50
CSC Holdings LLC, 144A 6.625% 15/10/2025	USD	3,225,000	3,531,375	0.21
CSC Holdings LLC, 144A 10.875% 15/10/2025	USD	2,800,000	3,325,000	0.20
CVR Partners LP, 144A 9.25% 15/06/2023	USD	2,450,000	2,532,688	0.15
DCP Midstream LLC, 144A 9.75% 15/03/2019	USD	1,100,000	1,234,750	0.07
DCP Midstream LLC, 144A 6.45% 03/11/2036	USD	1,550,000	1,573,250	0.09
DCP Midstream LLC 8.125% 16/08/2030	USD	475,000	532,000	0.03
Dean Foods Co., 144A 6.5% 15/03/2023	USD	3,825,000	4,026,884	0.24
Diamond 1 Finance Corp., 144A 5.875% 15/06/2021	USD	1,700,000	1,808,581	0.11

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Diamond 1 Finance Corp., 144A 7.125% 15/06/2024	USD	2,925,000	3,229,127	0.19
DISH DBS Corp. 6.75% 01/06/2021	USD	3,675,000	3,994,468	0.24
DISH DBS Corp. 5.875% 15/07/2022	USD	3,100,000	3,273,259	0.20
DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	USD	4,125,000	4,671,563	0.28
DPx Holdings BV, 144A 7.5% 01/02/2022	USD	2,700,000	2,865,375	0.17
Eco Services Operations LLC, 144A 8.5% 01/11/2022	USD	3,425,000	3,656,188	0.22
Eldorado Resorts, Inc. 7% 01/08/2023	USD	4,425,000	4,712,625	0.28
EMI Music Publishing Group North America Holdings, 144A 7.625% 15/06/2024	USD	1,150,000	1,250,625	0.07
Endo Ltd., 144A 6.5% 01/02/2025	USD	2,800,000	2,359,000	0.14
Energizer Holdings, Inc., 144A 5.5% 15/06/2025	USD	6,075,000	6,135,750	0.37
EP Energy LLC, 144A 8% 29/11/2024	USD	1,075,000	1,160,677	0.07
Equinix, Inc., REIT 5.375% 01/01/2022	USD	2,450,000	2,586,392	0.15
Equinix, Inc., REIT 5.75% 01/01/2025	USD	1,325,000	1,392,906	0.08
Ferrelgas LP 6.75% 15/01/2022	USD	75,000	74,438	-
First Data Corp., 144A 5.375% 15/08/2023	USD	2,550,000	2,652,000	0.16
First Data Corp., 144A 7% 01/12/2023	USD	11,750,000	12,587,188	0.75
Frontier Communications Corp. 8.875% 15/09/2020	USD	3,800,000	4,047,874	0.24
Frontier Communications Corp. 10.5% 15/09/2022	USD	4,250,000	4,489,190	0.27
Gardner Denver, Inc., 144A 6.875% 15/08/2021	USD	3,625,000	3,625,000	0.22
Gibson Energy, Inc., 144A 6.75% 15/07/2021	USD	2,750,000	2,866,875	0.17
Greystar Real Estate Partners LLC, 144A 8.25% 01/12/2022	USD	2,675,000	2,909,063	0.17
Grinding Media, Inc., 144A 7.375% 15/12/2023	USD	3,125,000	3,289,062	0.20
Group 1 Automotive, Inc., 144A 5.25% 15/12/2023	USD	2,375,000	2,375,000	0.14
Gulfport Energy Corp., 144A 6% 15/10/2024	USD	2,175,000	2,223,937	0.13
Gulfport Energy Corp., 144A 6.375% 15/05/2025	USD	1,600,000	1,626,416	0.10
Gulfport Energy Corp. 6.625% 01/05/2023	USD	3,465,000	3,638,250	0.22
H&E Equipment Services, Inc. 7% 01/09/2022	USD	3,475,000	3,674,812	0.22
Harland Clarke Holdings Corp., 144A 9.75% 01/08/2018	USD	1,500,000	1,537,500	0.09
Harland Clarke Holdings Corp., 144A 6.875% 01/03/2020	USD	1,800,000	1,746,000	0.10
HD Supply, Inc., 144A 5.25% 15/12/2021	USD	3,725,000	3,949,375	0.24
Hexion, Inc. 6.625% 15/04/2020	USD	7,500,000	6,661,762	0.40
Hexion, Inc. 10% 15/04/2020	USD	1,375,000	1,373,281	0.08
Hill-Pom Holdings, Inc., 144A 5.75% 01/09/2023	USD	1,425,000	1,480,219	0.09
Howard Hughes Corp. (The), 144A 6.875% 01/10/2021	USD	4,125,000	4,367,550	0.26
Howard Hughes Corp. (The), Reg. S 6.875% 01/10/2021	USD	6,525,000	6,908,670	0.41
Hub Holdings LLC, 144A 8.125% 15/07/2019	USD	3,575,000	3,583,938	0.21
HUB International Ltd., 144A 9.25% 15/02/2021	USD	1,150,000	1,194,563	0.07
HUB International Ltd., 144A 7.875% 01/10/2021	USD	6,100,000	6,450,750	0.38

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Hughes Satellite Systems Corp., 144A 6.625% 01/08/2026	USD	6,000,000	6,045,660	0.36
Huntington Ingalls Industries, Inc., 144A 5% 15/11/2025	USD	2,275,000	2,368,844	0.14
iHeartCommunications, Inc. 9% 15/12/2019	USD	8,175,000	6,775,031	0.40
Inception Merger Sub, Inc., 144A 8.625% 15/11/2024	USD	3,825,000	4,058,134	0.24
InSite Issuer LLC, Series 2016-1A 'C', 144A 6.414% 15/11/2046	USD	1,330,000	1,320,431	0.08
Intelsat Jackson Holdings SA, 144A 9.5% 30/09/2022	USD	2,475,000	2,747,250	0.16
Intelsat Jackson Holdings SA, 144A 8% 15/02/2024	USD	15,275,000	15,695,062	0.93
Iron Mountain Canada Operations ULLC, REIT, 144A 5.375% 15/09/2023	CAD	2,675,000	2,008,909	0.12
J.P. Morgan Chase & Co., FRN 5.3% Perpetual	USD	10,370,000	10,614,421	0.63
JC Penney Corp., Inc., 144A 5.875% 01/07/2023	USD	3,050,000	3,158,031	0.19
Jo-Ann Stores Holdings, Inc., 144A 9.75% 15/10/2019	USD	4,375,000	4,178,125	0.25
Jo-Ann Stores LLC, 144A 8.125% 15/03/2019	USD	1,330,000	1,326,675	0.08
Joseph T Ryerson & Son, Inc., 144A 11% 15/05/2022	USD	5,500,000	6,063,750	0.36
Kenan Advantage Group, Inc. (The), 144A 7.875% 31/07/2023	USD	1,875,000	1,700,125	0.10
KFC Holding Co., 144A 5% 01/06/2024	USD	1,275,000	1,308,418	0.08
KFC Holding Co., 144A 5.25% 01/06/2026	USD	6,800,000	6,918,796	0.41
Kinetic Concepts, Inc., 144A 9.625% 01/10/2021	USD	4,825,000	5,120,531	0.30
Kinetic Concepts, Inc. 12.5% 01/11/2019	USD	1,250,000	1,306,250	0.08
Kissner Holdings LP, 144A 8.375% 01/12/2022	USD	3,050,000	3,088,125	0.18
Ladder Capital Finance Holdings LLLP, 144A 5.875% 01/08/2021	USD	1,875,000	1,788,281	0.11
Lamb Weston Holdings, Inc., 144A 4.625% 01/11/2024	USD	2,375,000	2,286,875	0.14
LTF Merger Sub, Inc., 144A 8.5% 15/06/2023	USD	3,600,000	3,744,000	0.22
Matador Resources Co., 144A 6.875% 15/04/2023	USD	2,250,000	2,373,750	0.14
Match Group, Inc. 6.75% 15/12/2022	USD	2,950,000	3,123,313	0.19
Match Group, Inc. 6.375% 01/06/2024	USD	3,345,000	3,541,519	0.21
McGraw-Hill Global Education Holdings LLC, 144A 7.875% 15/05/2024	USD	3,025,000	3,055,250	0.18
MDC Partners, Inc., 144A 6.5% 01/05/2024	USD	5,150,000	4,660,750	0.28
Mercer International, Inc. 7% 01/12/2019	USD	3,200,000	3,308,000	0.20
Mercer International, Inc. 7.75% 01/12/2022	USD	1,700,000	1,793,500	0.11
MGM Growth Properties Operating Partnership LP, REIT, 144A 5.625% 01/05/2024	USD	1,650,000	1,732,500	0.10
Micron Technology, Inc., 144A 5.25% 01/08/2023	USD	1,775,000	1,781,665	0.11
Microsemi Corp., 144A 9.125% 15/04/2023	USD	7,050,000	8,248,500	0.49
Milacron LLC, 144A 7.75% 15/02/2021	USD	3,325,000	3,433,062	0.20

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
MPH Acquisition Holdings LLC, 144A 7.125% 01/06/2024	USD	1,200,000	1,267,500	0.08
MSCI, Inc., 144A 6.25% 15/11/2024	USD	2,225,000	2,347,375	0.14
MSCI, Inc., 144A 5.75% 15/08/2025	USD	2,675,000	2,855,563	0.17
Navient Corp. 8% 25/03/2020	USD	2,525,000	2,802,119	0.17
Navient Corp. 5% 26/10/2020	USD	7,250,000	7,379,558	0.44
Netflix, Inc. 5.75% 01/03/2024	USD	900,000	989,750	0.06
Nexstar Escrow Corp., 144A 5.625% 01/08/2024	USD	3,725,000	3,697,062	0.22
NFP Corp., 144A 9% 15/07/2021	USD	900,000	952,875	0.06
NGL Energy Partners LP, 144A 7.5% 01/11/2023	USD	5,025,000	5,213,437	0.31
Noble Holding International Ltd. 7.75% 15/01/2024	USD	2,575,000	2,460,078	0.15
Novelis Corp., 144A 6.25% 15/08/2024	USD	3,475,000	3,692,187	0.22
Novelis Corp., 144A 5.875% 30/09/2025	USD	1,875,000	1,898,438	0.11
NRG Energy, Inc., 144A 7.25% 15/05/2026	USD	7,525,000	7,525,000	0.45
NRG Energy, Inc., 144A 6.625% 15/01/2027	USD	1,975,000	1,861,437	0.11
NRG Energy, Inc. 6.625% 15/03/2023	USD	5,550,000	5,572,034	0.33
Ocwen Loan Servicing LLC, Reg. S 8.375% 15/11/2022	USD	1,225,000	1,252,562	0.07
OneMain Financial Holdings LLC, 144A 7.25% 15/12/2021	USD	3,450,000	3,578,789	0.21
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc., 144A 6.625% 15/05/2022	USD	2,425,000	2,121,875	0.13
Pacific Exploration 12% 21/02/2021	USD	1,775,000	2,010,187	0.12
Pactiv LLC 7.95% 15/12/2025	USD	1,575,000	1,677,375	0.10
PetSmart, Inc., 144A 7.125% 15/03/2023	USD	6,675,000	6,827,324	0.41
PF Chang's China Bistro, Inc., 144A 10.25% 30/06/2020	USD	1,525,000	1,498,313	0.09
Platform Specialty Products Corp., 144A 10.375% 01/05/2021	USD	5,825,000	6,465,750	0.39
Platform Specialty Products Corp., 144A 6.5% 01/02/2022	USD	2,325,000	2,354,063	0.14
PQ Corp., 144A 6.75% 15/11/2022	USD	1,725,000	1,850,062	0.11
Prime Security Services Borrower LLC, 144A 9.25% 15/05/2023	USD	1,575,000	1,720,688	0.10
Quicken Loans, Inc., 144A 5.75% 01/05/2025	USD	3,450,000	3,372,375	0.20
Reynolds Group Issuer, Inc., 144A 7% 15/07/2024	USD	2,800,000	2,982,000	0.18
Reynolds Group Issuer, Inc. 8.25% 15/02/2021	USD	1,603,920	1,664,567	0.10
Rite Aid Corp., 144A 6.125% 01/04/2023	USD	6,025,000	6,499,469	0.39
Rockies Express Pipeline LLC, 144A 6% 15/01/2019	USD	822,000	867,210	0.05
RP Crown Parent LLC, 144A 7.375% 15/10/2024	USD	3,300,000	3,423,750	0.20
RSI Home Products, Inc., 144A 6.5% 15/03/2023	USD	3,900,000	4,095,000	0.24
Sabine Pass Liquefaction LLC, 144A 5.875% 30/06/2026	USD	1,425,000	1,541,636	0.09
Sabine Pass Liquefaction LLC 6.25% 15/03/2022	USD	4,975,000	5,447,625	0.32
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/05/2024	USD	1,600,000	1,713,600	0.10
Sabre Global, Inc., 144A 5.375% 15/04/2023	USD	1,175,000	1,204,375	0.07
Scientific Games International, Inc., 144A 7% 01/01/2022	USD	5,625,000	6,060,938	0.36

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Scientific Games International, Inc. 10% 01/12/2022	USD	12,400,000	12,293,298	0.73
Geminole Hard Rock Entertainment, Inc., 144A 5.875% 15/05/2021	USD	2,820,000	2,805,900	0.17
Shea Homes LP, 144A 5.875% 01/04/2023	USD	1,800,000	1,764,000	0.11
Shearer's Foods LLC, 144A 9% 01/11/2019	USD	2,250,000	2,348,438	0.14
Shingle Springs Tribal Gaming Authority, 144A 9.75% 01/09/2021	USD	3,700,000	4,042,250	0.24
Sinclair Television Group, Inc., 144A 5.875% 15/03/2026	USD	1,200,000	1,207,500	0.07
Sirius XM Radio, Inc., 144A 6% 15/07/2024	USD	4,030,000	4,233,475	0.25
Sonic Automotive, Inc. 5% 15/05/2023	USD	3,225,000	3,144,375	0.19
Springs Industries, Inc. 6.25% 01/06/2021	USD	1,600,000	1,655,352	0.10
SPX FLOW, Inc., 144A 5.625% 15/09/2024	USD	3,925,000	3,964,250	0.24
SPX FLOW, Inc., 144A 5.875% 15/09/2026	USD	3,950,000	3,959,875	0.24
SS&C Technologies Holdings, Inc. 5.875% 15/07/2023	USD	1,975,000	2,047,048	0.12
StandardAero Aviation Holdings, Inc., 144A 10% 15/07/2023	USD	4,450,000	4,705,875	0.28
Surgery Center Holdings, Inc., 144A 8.875% 15/04/2021	USD	2,150,000	2,297,812	0.14
Tallgrass Energy Partners LP, 144A 5.5% 15/09/2024	USD	2,200,000	2,194,500	0.13
Targa Resources Partners LP, 144A 5.125% 01/02/2025	USD	4,200,000	4,184,250	0.25
Targa Resources Partners LP 5.25% 01/05/2023	USD	4,175,000	4,225,538	0.25
Taylor Morrison Communities, Inc., 144A 5.875% 15/04/2023	USD	2,250,000	2,295,000	0.14
Tenet Healthcare Corp., FRN 4.463% 15/06/2020	USD	375,000	379,688	0.02
Tenet Healthcare Corp., 144A 7.5% 01/01/2022	USD	1,450,000	1,517,969	0.09
TerraForm Power Operating LLC, STEP, 144A 9.375% 01/02/2023	USD	1,100,000	1,120,625	0.07
TerraForm Power Operating LLC, STEP, 144A 6.625% 15/06/2025	USD	800,000	828,000	0.05
Ti Group Automotive Systems LLC, 144A 8.75% 15/07/2023	USD	4,480,000	4,726,400	0.28
T-Mobile USA, Inc. 6.5% 15/01/2024	USD	825,000	886,137	0.05
T-Mobile USA, Inc. 6% 15/04/2024	USD	1,925,000	2,031,616	0.12
T-Mobile USA, Inc. 6.375% 01/03/2025	USD	1,575,000	1,686,959	0.10
T-Mobile USA, Inc. 6.5% 15/01/2026	USD	7,000,000	7,594,335	0.45
Townsquare Media, Inc., 144A 6.5% 01/04/2023	USD	3,927,000	3,779,738	0.23
TransDigm, Inc., 144A 6.375% 15/06/2026	USD	2,525,000	2,605,800	0.16
Transworld Systems, Inc., 144A 9.5% 15/08/2021	USD	3,350,000	2,077,000	0.12
United Airlines Pass Through Trust, Series 2014-2 B' 4.625% 03/03/2024	USD	655,565	671,134	0.04
United Rentals North America, Inc. 5.5% 15/05/2027	USD	2,225,000	2,228,549	0.13
Univar USA, Inc., 144A 6.75% 15/07/2023	USD	2,625,000	2,723,438	0.16
Univision Communications, Inc., 144A 5.125% 15/02/2025	USD	5,525,000	5,304,000	0.32
Univision Communications, Inc., Reg. S 6.75% 15/09/2022	USD	304,000	320,340	0.02
UFI, Inc., 144A 7.75% 15/01/2021	USD	5,125,000	5,240,312	0.31

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 7.5% 15/07/2021	USD	4,650,000	3,935,062	0.23
VB-G1 Issuer LLC, Series 2016-1A 'P', 144A 6.901% 15/06/2046	USD	960,000	994,620	0.06
Veritas US, Inc., 144A 7.5% 01/02/2023	USD	4,875,000	4,594,687	0.27
Veritas US, Inc., 144A 10.5% 01/02/2024	USD	6,575,000	6,032,562	0.36
Watco Cos. LLC, 144A 6.375% 01/04/2023	USD	2,475,000	2,574,000	0.15
West Corp., 144A 5.375% 15/07/2022	USD	5,600,000	5,439,000	0.32
Western Digital Corp., 144A 7.375% 01/04/2023	USD	5,625,000	6,201,562	0.37
Western Digital Corp., 144A 10.5% 01/04/2024	USD	10,750,000	12,738,750	0.76
WideOpenWest Finance LLC 10.25% 15/07/2019	USD	3,525,000	3,727,687	0.22
William Lyon Homes, Inc. 8.5% 15/11/2020	USD	4,225,000	4,436,250	0.26
Wise Metals Group LLC, 144A 8.75% 15/12/2018	USD	8,025,000	8,386,125	0.50
WR Grace & Co-Corn, 144A 5.125% 01/10/2021	USD	2,550,000	2,664,750	0.16
Zebra Technologies Corp. 7.25% 15/10/2022	USD	3,075,000	3,346,569	0.20
Zekelman Industries, Inc., 144A 9.875% 15/06/2023	USD	5,100,000	5,673,750	0.34
			776,808,064	46.36
債券 計			994,936,425	59.23
転換社債 アメリカ				
Comstock Resources, Inc. 7.75% 01/04/2019	USD	2,100,000	1,803,375	0.11
			1,803,375	0.11
転換社債 計			1,803,375	0.11
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			996,739,800	59.34

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			1,647,921,154	98.10

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	5,189	USD	5,454	12/04/2017	J.P. Morgan	49	-
EUR	38,180,300	USD	40,593,401	15/06/2017	Societe Generale	9,199	-
EUR	1,497,380	USD	1,574,722	15/06/2017	J.P. Morgan	18,491	-
GBP	128,712	USD	157,563	13/01/2017	RBC	1,888	-
GBP	96,250	USD	118,524	13/01/2017	J.P. Morgan	712	-

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(%)
NOK	861,387	USD	99,285	15/05/2017	J.P. Morgan	856	-
NOK	21,079	USD	2,428	15/06/2017	J.P. Morgan	23	-
SEK	2,673,000	USD	293,743	12/04/2017	J.P. Morgan	3,124	-
SEK	13,590,600	USD	1,508,006	15/05/2017	Skandinaviska Enskilda Banken	4,132	-
SEK	3,051,100	USD	337,188	15/05/2017	J.P. Morgan	2,288	-
SEK	13,456,300	USD	1,479,348	15/06/2017	Goldman Sachs	20,400	-
SEK	2,700,125	USD	295,232	15/06/2017	J.P. Morgan	5,705	-
USD	10,356,731	CAD	13,831,000	31/03/2017	RBC	48,928	-
USD	4,907,597	CHF	4,891,000	15/02/2017	Citibank	83,343	0.01
USD	8,223,019	EUR	7,407,658	13/01/2017	Morgan Stanley	402,140	0.02
USD	17,177,343	EUR	16,116,014	13/01/2017	J.P. Morgan	162,330	0.01
USD	26,850,766	EUR	24,819,922	15/02/2017	J.P. Morgan	606,586	0.04
USD	11,218,331	EUR	10,117,588	15/03/2017	J.P. Morgan	505,512	0.03
USD	24,190,327	EUR	22,216,242	12/04/2017	J.P. Morgan	629,910	0.04
USD	6,975,892	GBP	5,488,566	13/01/2017	Bank of America	176,551	0.01
USD	741,474	NOK	6,274,401	13/01/2017	J.P. Morgan	12,619	-
為替予約取引にかかる評価益 計						2,694,785	0.16
EUR	67,525,300	USD	75,429,136	13/01/2017	Deutsche Bank	(4,137,078)	(0.25)
EUR	11,260,382	USD	12,728,534	13/01/2017	J.P. Morgan	(840,015)	(0.05)
EUR	82,143,500	USD	92,656,225	15/02/2017	HSBC	(5,799,032)	(0.35)
EUR	7,331,758	USD	8,344,280	15/02/2017	J.P. Morgan	(591,799)	(0.04)
EUR	78,442,400	USD	88,781,108	15/03/2017	UBS	(5,723,838)	(0.34)
EUR	5,755,216	USD	6,428,094	15/03/2017	J.P. Morgan	(334,291)	(0.02)
EUR	68,683,900	USD	76,581,175	12/04/2017	Westpac Banking	(3,741,612)	(0.22)
EUR	24,105,898	USD	26,801,629	12/04/2017	J.P. Morgan	(1,237,435)	(0.07)
EUR	52,380,900	USD	57,403,705	15/05/2017	Societe Generale	(1,759,094)	(0.11)
EUR	1,350,672	USD	1,453,719	15/05/2017	J.P. Morgan	(18,890)	-
GBP	2,555,475	USD	3,183,721	13/01/2017	RBC	(17,949)	-
GBP	147,461	USD	186,859	13/01/2017	Bank of America	(4,181)	-
NOK	146,509,900	USD	17,388,857	13/01/2017	Deutsche Bank	(369,781)	(0.02)
NOK	8,988,558	USD	1,060,414	13/01/2017	J.P. Morgan	(16,273)	-
NOK	38,000,000	USD	4,633,950	13/01/2017	Barclays	(219,744)	(0.01)
NOK	188,066,700	USD	22,738,635	15/02/2017	Barclays	(887,902)	(0.05)
NOK	7,868,441	USD	954,741	15/02/2017	J.P. Morgan	(40,538)	-
NOK	191,256,700	USD	23,173,361	15/03/2017	UBS	(949,132)	(0.06)
NOK	4,401,020	USD	538,126	15/03/2017	J.P. Morgan	(26,723)	-
NOK	180,139,300	USD	22,094,578	12/04/2017	Societe Generale	(1,158,399)	(0.07)
NOK	4,545,906	USD	554,666	12/04/2017	J.P. Morgan	(26,331)	-
NOK	165,477,200	USD	19,726,673	15/05/2017	Skandinaviska Enskilda Banken	(489,070)	(0.03)
NOK	8,441,659	USD	757,870	15/05/2017	J.P. Morgan	(8,993)	-
NOK	192,955,700	USD	22,747,101	15/06/2017	Goldman Sachs	(308,967)	(0.02)
SEK	11,324,400	USD	1,342,573	13/01/2017	Deutsche Bank	(91,061)	(0.01)
SEK	4,099,509	USD	477,109	13/01/2017	J.P. Morgan	(30,684)	-
SEK	13,509,600	USD	1,608,745	15/02/2017	Barclays	(112,987)	(0.01)
SEK	3,049,251	USD	364,813	15/02/2017	J.P. Morgan	(27,206)	-
SEK	15,537,900	USD	1,840,741	15/03/2017	UBS	(117,870)	(0.01)
SEK	1,368,581	USD	161,681	15/03/2017	J.P. Morgan	(9,930)	-
SEK	13,362,600	USD	1,535,402	12/04/2017	Societe Generale	(51,330)	-
SEK	1,357,114	USD	153,142	12/04/2017	J.P. Morgan	(2,419)	-

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 (%)
USD	400,764	EUR	382,834	13/01/2017	J.P. Morgan	(3,426)	-
USD	87,225,972	EUR	82,475,000	24/02/2017	RBC	(15,098)	-
USD	7,310	EUR	6,966	12/04/2017	J.P. Morgan	(77)	-
USD	34,819,162	GBP	28,399,000	13/01/2017	Citibank	(362,064)	(0.02)
USD	1,500,543	GBP	1,221,167	13/01/2017	Barclays	(12,262)	-
USD	22,855	NOK	197,956	13/01/2017	J.P. Morgan	(140)	-
USD	99,710	SEK	929,440	13/01/2017	J.P. Morgan	(3,006)	-
為替予約取引にかかる評価損 計						(29,546,626)	(1.76)
為替予約取引にかかる評価(損) 益 計						(26,851,840)	(1.60)

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	参照先	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	Olares Stores, Inc. 7.75% 01/06/2020	Buy	5.00%	20/06/2017	1,113,296	1,113,296	0.07
625,000	EUR	Goldman Sachs	TW Finance Corp. II AB 7.375% 15/12/2020	Sell	5.00%	20/06/2019	77,111	77,111	-
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかる評価益 計							1,190,407	1,190,407	0.07
2,475,000	USD	Goldman Sachs	Community Health Systems, Inc. 6% 15/11/2019	Sell	5.00%	20/12/2018	(260,658)	(260,658)	(0.02)
1,825,000	USD	Goldman Sachs	Freeport- McMoran, Inc. 3.55% 01/03/2022	Sell	1.00%	20/06/2019	(29,964)	(29,964)	-
1,300,000	USD	Barclays	Terracocean, Inc. 7.375% 15/04/2018	Sell	1.00%	20/06/2019	(65,383)	(65,383)	-
625,000	USD	Citibank	Terracocean, Inc. 7.375% 15/04/2018	Sell	1.00%	20/06/2019	(31,434)	(31,434)	-
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかる評価損 計							(387,439)	(387,439)	(0.02)
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかる評価(損) 益 計							802,968	802,968	0.05

スワップション取引

数量	銘柄名	通貨	取引相手先	グローバル・エ クスボージャー 評価額 USD	評価額 USD
(41,000,000)	CDG Buy CDX.NA.HY.27-V1, Put, 1%, 15/02/2017	USD	Barclays	(41,000,000)	(42,856)
(41,000,000)	CDG Buy CDX.NA.HY.27-V1, Put, 1.01%, 15/02/2017	USD	Barclays	(41,410,000)	(55,039)
スワップション取引にかかる売建評価額					(97,895)
スワップション取引にかかる評価額					(97,895)

現金	29,754,985	1.77
その他資産（負債）	2,226,277	0.13
純資産 計	1,579,902,415	100.00

国別投資比率

	純資産比率（％）
アメリカ	68.69
カナダ	6.32
ルクセンブルグ	3.54
イギリス	3.39
オランダ	1.76
イタリア	1.65
ブラジル	1.39
オーストラリア	1.39
フランス	1.29
ドイツ	1.12
アルゼンチン	0.89
スイス	0.81
スペイン	0.80
ジャマイカ	0.75
ベルギー	0.63
コロンビア	0.58
メキシコ	0.51
アイルランド	0.37
ロシア	0.29
トリニダード・トバゴ	0.28
ギリシャ	0.27
クロアチア	0.26
日本	0.21
香港	0.17
中国	0.17
チリ	0.15
パナマ	0.15
オーストリア	0.12
インドネシア	0.11
カザフスタン	0.04
有価証券 計	98.10
現金及びその他資産（負債）	1.90
合計	100.00

ティー・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12月31日現在

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				
SGSP Australia Assets Pty. Ltd., Reg. S 3.3% 09/04/2023	USD	400,000	394,558	0.12
			394,558	0.12
ベルギー				
Solvay Finance America LLC, 144A 4.45% 03/12/2025	USD	550,000	565,881	0.17
			565,881	0.17
バミューダ				
Bermuda Government Bond, 144A 4.854% 06/02/2024	USD	205,000	213,923	0.06
			213,923	0.06
カナダ				
Enbridge, Inc. 4% 01/10/2023	USD	165,000	167,542	0.05
Encana Corp. 3.9% 15/11/2021	USD	100,000	101,457	0.03
Province of Manitoba Canada 1.3% 03/04/2017	USD	275,000	275,224	0.08
Province of Ontario Canada 2.5% 10/09/2021	USD	230,000	231,594	0.07
Thomson Reuters Corp. 3.35% 15/05/2026	USD	80,000	77,919	0.02
TransCanada PipeLines Ltd. 4.875% 15/01/2026	USD	315,000	349,288	0.11
			1,203,024	0.36
中国				
Alibaba Group Holding Ltd. 3.125% 28/11/2021	USD	740,000	740,811	0.22
Alibaba Group Holding Ltd. 3.6% 28/11/2024	USD	865,000	857,911	0.25
CCCI Treasure Ltd., Reg. S, FRN 3.5% Perpetual	USD	200,000	201,165	0.06
CNOOC Finance 2015 USA LLC 3.5% 05/05/2025	USD	450,000	438,162	0.13
CRCC Yupeng Ltd., Reg. S, FRN 3.95% Perpetual	USD	350,000	358,251	0.11
JD.com, Inc. 3.875% 29/04/2026	USD	690,000	656,677	0.19
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.8% 11/02/2025	USD	1,025,000	1,037,054	0.31
			4,290,031	1.27
香港				
IFC Development Corporate Treasury Ltd., Reg. S 2.375% 21/05/2019	USD	300,000	300,545	0.09
			300,545	0.09
インドネシア				
Indonesia Government Bond, 144A 3.7% 08/01/2022	USD	200,000	200,950	0.06
Pertamina Persero PT, 144A 6.45% 30/05/2044	USD	400,000	406,510	0.12
			607,460	0.18
アイルランド				
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	160,000	154,553	0.04
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/09/2023	USD	525,000	498,052	0.15
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2026	USD	715,000	667,431	0.20
			1,320,036	0.39

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
イスラエル				
Teva Pharmaceutical Finance IV BV 3.65% 10/11/2021	USD	515,000	521,479	0.15
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.8% 21/07/2023	USD	170,000	160,020	0.05
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	USD	970,000	894,097	0.27
			1,575,596	0.47
メキシコ				
BBVA Bancomer SA, 144A 4.375% 10/04/2024	USD	295,000	298,033	0.09
Mexico Government Bond 3.6% 30/01/2025	USD	225,000	217,243	0.06
Mexico Government Bond 4.125% 21/01/2026	USD	565,000	561,782	0.17
Petroleos Mexicanos, 144A 6.375% 04/02/2021	USD	505,000	537,335	0.16
			1,634,393	0.48
オランダ				
ING Bank NV, Reg. S, FRN 4.125% 21/11/2023	USD	500,000	507,302	0.15
Shell International Finance BV 2.125% 11/05/2020	USD	515,000	513,880	0.15
Shell International Finance BV 3.25% 11/05/2025	USD	1,160,000	1,158,985	0.35
			2,180,167	0.65
パナマ				
Autoridad del Canal de Panama, 144A 4.95% 29/07/2035	USD	200,000	212,000	0.06
			212,000	0.06
スペイン				
Telefonica Emisiones SAU 4.57% 27/04/2023	USD	235,000	246,209	0.07
			246,209	0.07
スウェーデン				
Svensk Exportkredit AB 5.125% 01/03/2017	USD	350,000	352,265	0.10
			352,265	0.10
イギリス				
Barclays Bank plc 5.14% 14/10/2020	USD	560,000	591,542	0.17
Barclays plc 5.2% 12/05/2026	USD	685,000	699,638	0.21
Delphi Automotive plc 4.25% 15/01/2026	USD	75,000	77,548	0.02
Heathrow Funding Ltd., 144A 4.875% 15/07/2023	USD	180,000	189,355	0.06
HSBC Holdings plc 2.95% 25/05/2021	USD	335,000	334,054	0.10
HSBC Holdings plc 2.65% 05/01/2022	USD	495,000	482,771	0.14
Imperial Brands Finance plc, 144A 4.25% 21/07/2025	USD	645,000	665,314	0.20
Nationwide Building Society, 144A 4% 14/09/2026	USD	760,000	722,608	0.21
Royal Bank of Scotland Group plc 3.875% 12/09/2023	USD	495,000	474,413	0.14
Royal Bank of Scotland Group plc 4.8% 05/04/2026	USD	805,000	803,603	0.24
Santander UK Group Holdings plc 2.875% 16/10/2020	USD	70,000	69,386	0.02
Santander UK Group Holdings plc 2.875% 05/08/2021	USD	550,000	540,584	0.16
WPP Finance 2010 3.75% 19/09/2024	USD	500,000	502,493	0.15
			6,153,309	1.82
アメリカ				
Abbott Laboratories 2.9% 30/11/2021	USD	485,000	483,208	0.14
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	855,000	849,101	0.25

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
AbbVie, Inc. 4.45% 14/05/2046	USD	435,000	411,671	0.12
Aetna, Inc. 3.2% 15/06/2026	USD	1,360,000	1,343,449	0.40
Agilent Technologies, Inc. 3.2% 01/10/2022	USD	25,000	25,137	0.01
Agilent Technologies, Inc. 3.875% 15/07/2023	USD	20,000	20,554	0.01
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.95% 15/01/2027	USD	530,000	526,872	0.16
Anthem, Inc. 3.5% 15/08/2024	USD	1,200,000	1,196,922	0.35
Anthem, Inc. 4.65% 15/01/2043	USD	500,000	500,945	0.15
Arconic, Inc. 5.72% 23/02/2019	USD	130,000	137,660	0.04
Arconic, Inc. 6.15% 15/08/2020	USD	385,000	421,496	0.12
Arconic, Inc. 5.87% 23/02/2022	USD	295,000	317,495	0.09
Arrow Electronics, Inc. 3.5% 01/04/2022	USD	85,000	84,350	0.03
Arrow Electronics, Inc. 4% 01/04/2025	USD	225,000	221,421	0.07
AT&T, Inc. 4.8% 15/05/2044	USD	630,000	593,740	0.18
Avnet, Inc. 4.625% 15/04/2026	USD	845,000	822,198	0.24
Bank of America Corp. 3.3% 11/01/2023	USD	1,665,000	1,669,279	0.49
Bank of America Corp. 4.2% 26/08/2024	USD	105,000	106,837	0.03
Bank of America Corp. 3.248% 21/10/2027	USD	385,000	367,201	0.11
Boardwalk Pipelines LP 5.95% 01/06/2026	USD	295,000	319,427	0.09
Boston Properties LP, REIT 3.65% 01/02/2026	USD	365,000	361,657	0.11
Boston Properties LP, REIT 2.75% 01/10/2026	USD	730,000	667,278	0.20
Brixmor Operating Partnership LP, REIT 3.875% 15/08/2022	USD	650,000	663,133	0.20
Brixmor Operating Partnership LP, REIT 4.125% 15/06/2026	USD	335,000	333,256	0.10
CC Holdings GS V LLC, REIT 3.849% 15/04/2023	USD	710,000	721,758	0.21
Chubb INA Holdings, Inc. 4.35% 03/11/2045	USD	115,000	119,996	0.04
Citigroup, Inc. 3.2% 21/10/2026	USD	1,780,000	1,696,224	0.50
CNA Financial Corp. 5.875% 15/08/2020	USD	625,000	689,838	0.20
Constellation Energy Group, Inc. 5.15% 01/12/2020	USD	135,000	146,090	0.04
Crown Castle International Corp., REIT 5.25% 15/01/2023	USD	195,000	211,370	0.06
CVS Health Corp. 3.5% 20/07/2022	USD	145,000	148,985	0.04
CVS Health Corp. 5% 01/12/2024	USD	110,000	120,281	0.04
CVS Health Corp. 3.875% 20/07/2025	USD	124,000	127,548	0.04
DDR Corp., REIT 4.25% 01/02/2026	USD	235,000	235,853	0.07
Discover Bank 3.1% 04/06/2020	USD	830,000	839,142	0.25
Discover Financial Services 3.75% 04/03/2025	USD	785,000	765,422	0.23
Duke Energy Corp. 2.65% 01/09/2026	USD	225,000	209,989	0.06
Duke Energy Corp. 3.75% 01/09/2046	USD	185,000	166,485	0.05
Ecolab, Inc. 2.7% 01/11/2026	USD	190,000	180,411	0.05
EnLink Midstream Partners LP 4.85% 15/07/2026	USD	225,000	227,422	0.07
Enterprise Products Operating LLC 3.95% 15/02/2027	USD	1,020,000	1,041,920	0.31
EQT Corp. 4.875% 15/11/2021	USD	115,000	122,710	0.04
Essex Portfolio LP, REIT 3.375% 15/04/2026	USD	440,000	424,881	0.13
Exelon Generation Co. LLC 2.95% 15/01/2020	USD	945,000	954,757	0.28

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
FirstEnergy Corp. 7.375% 15/11/2031	USD	155,000	199,650	0.06
GATX Corp. 2.5% 15/03/2019	USD	150,000	150,087	0.04
GATX Corp. 2.5% 30/07/2019	USD	180,000	180,290	0.05
GATX Corp. 4.85% 01/06/2021	USD	150,000	161,769	0.05
GATX Corp. 3.25% 30/03/2025	USD	260,000	248,941	0.07
General Motors Co. 4% 01/04/2025	USD	1,630,000	1,590,538	0.47
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 5.75% 24/01/2022	USD	715,000	803,707	0.24
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.625% 22/01/2023	USD	695,000	708,056	0.21
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.5% 15/11/2026	USD	620,000	606,171	0.18
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 6.75% 01/10/2037	USD	205,000	252,324	0.07
Harris Corp. 3.832% 27/04/2025	USD	930,000	943,666	0.28
Hess Corp. 4.3% 01/04/2027	USD	175,000	173,464	0.05
Hess Corp. 5.8% 01/04/2047	USD	140,000	145,447	0.04
Humana, Inc. 3.85% 01/10/2024	USD	515,000	524,175	0.16
Humana, Inc. 4.95% 01/10/2044	USD	250,000	262,990	0.08
International Paper Co. 4.4% 15/08/2047	USD	560,000	530,765	0.16
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 4% 15/03/2022	USD	845,000	873,769	0.26
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 3.75% 15/02/2023	USD	70,000	70,476	0.02
Kilroy Realty LP, REIT 4.375% 01/10/2025	USD	440,000	452,978	0.13
Kimco Realty Corp., REIT 3.4% 01/11/2022	USD	210,000	212,985	0.06
Kimco Realty Corp., REIT 2.8% 01/10/2026	USD	690,000	640,548	0.19
Kinder Morgan, Inc. 5.55% 01/06/2045	USD	453,000	473,138	0.14
Kinder Morgan, Inc. 5.05% 15/02/2046	USD	85,000	83,874	0.03
Life Technologies Corp. 6% 01/03/2020	USD	310,000	339,221	0.10
Lockheed Martin Corp. 3.55% 15/01/2026	USD	140,000	142,865	0.04
Lockheed Martin Corp. 3.6% 01/03/2035	USD	195,000	185,468	0.06
Lockheed Martin Corp. 3.8% 01/03/2045	USD	500,000	472,843	0.14
Magellan Midstream Partners LP 4.25% 15/09/2046	USD	625,000	586,319	0.17
Martin Marietta Materials, Inc. 4.25% 02/07/2024	USD	370,000	374,296	0.11
Mead Johnson Nutrition Co. 4.125% 15/11/2025	USD	355,000	363,145	0.11
Morgan Stanley 2.625% 17/11/2021	USD	680,000	670,861	0.20
Morgan Stanley 3.75% 25/02/2023	USD	690,000	706,905	0.21
Morgan Stanley 3.7% 23/10/2024	USD	885,000	894,514	0.26
Morgan Stanley 3.125% 27/07/2026	USD	295,000	281,353	0.08
Morgan Stanley 4.35% 08/09/2026	USD	810,000	827,334	0.24
MPT Operating Partnership LP, REIT 5.25% 01/08/2026	USD	75,000	73,875	0.02
Newell Brands, Inc. 5.5% 01/04/2046	USD	180,000	206,346	0.06
Omnicom Group, Inc. 3.625% 01/06/2022	USD	70,000	72,072	0.02
Omnicom Group, Inc. 3.65% 01/11/2024	USD	775,000	779,534	0.23
Perrigo Co. plc 4% 15/11/2023	USD	375,000	372,887	0.11
Perrigo Finance Unlimited Co. 3.5% 15/03/2021	USD	284,000	286,991	0.09
Reinsurance Group of America, Inc. 6.45% 15/11/2019	USD	145,000	160,897	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 (%)
Reinsurance Group of America, Inc. 5% 01/06/2021	USD	105,000	113,436	0.03
Reinsurance Group of America, Inc. 4.7% 15/09/2023	USD	170,000	180,051	0.05
Reynolds American, Inc. 4% 12/06/2022	USD	115,000	120,291	0.04
Reynolds American, Inc. 3.25% 01/11/2022	USD	90,000	89,685	0.03
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/05/2025	USD	200,000	211,004	0.06
Reynolds American, Inc. 5.85% 15/08/2045	USD	400,000	472,906	0.14
Gempra Energy 2.85% 15/11/2020	USD	110,000	110,815	0.03
Simon Property Group LP, REIT 2.5% 01/09/2020	USD	260,000	261,541	0.08
Southern California Gas Co. 3.2% 15/06/2025	USD	335,000	338,648	0.10
Southern Co. (The) 2.95% 01/07/2023	USD	665,000	654,806	0.19
Spectra Energy Partners LP 3.375% 15/10/2026	USD	365,000	347,883	0.10
Spectra Energy Partners LP 4.5% 15/03/2045	USD	75,000	70,817	0.02
Thermo Fisher Scientific, Inc. 3.3% 15/02/2022	USD	1,000,000	1,013,785	0.30
Unum Group 5.625% 15/09/2020	USD	80,000	87,175	0.03
Unum Group 3% 15/05/2021	USD	140,000	139,725	0.04
US Treasury 0.625% 30/06/2018	USD	4,630,000	4,601,063	1.36
US Treasury 1.25% 31/10/2018	USD	5,845,000	5,853,448	1.73
US Treasury 1.5% 31/05/2019	USD	1,005,000	1,009,475	0.30
US Treasury 1.5% 30/11/2019	USD	4,685,000	4,691,954	1.39
US Treasury 2% 31/08/2021	USD	13,025,000	13,059,598	3.86
US Treasury 5.375% 15/02/2031	USD	410,000	543,891	0.16
US Treasury 2.75% 15/08/2042	USD	700,000	657,125	0.19
US Treasury 3.375% 15/05/2044	USD	1,310,000	1,379,901	0.41
US Treasury 3% 15/11/2044	USD	1,670,000	1,638,818	0.49
US Treasury 2.5% 15/02/2045	USD	1,480,000	1,309,222	0.39
US Treasury 3% 15/05/2045	USD	2,710,000	2,655,377	0.79
US Treasury 3% 15/11/2045	USD	1,000,000	979,609	0.29
US Treasury 2.5% 15/02/2046	USD	2,255,000	1,989,861	0.59
US Treasury 2.5% 15/05/2046	USD	4,190,000	3,697,020	1.09
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/07/2026	USD	3,595,000	3,492,582	1.03
VEREIT Operating Partnership LP, REIT 4.875% 01/06/2026	USD	810,000	818,100	0.24
Verizon Communications, Inc. 6.4% 15/09/2033	USD	1,620,000	1,959,900	0.58
Verizon Communications, Inc. 4.862% 21/08/2046	USD	665,000	668,704	0.20
Visa, Inc. 4.3% 14/12/2045	USD	560,000	589,005	0.17
Western Gas Partners LP 4% 01/07/2022	USD	140,000	142,472	0.04
Western Gas Partners LP 5.45% 01/04/2044	USD	290,000	298,493	0.09
Williams Partners LP 4.5% 15/11/2023	USD	100,000	102,784	0.03
			96,033,875	28.40
債券 計			117,283,272	34.69
株式				
アメリカ				
American Tower Corp., REIT Preference 5.25%	USD	833	87,707	0.02
			87,707	0.02
株式 計			87,707	0.02
公認の証券取引所の上場 または取引されている有価証券 計			117,370,979	34.71

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
その他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	431,651	0.13
Brambles USA, Inc., 144A 4.125% 23/10/2025	USD	85,000	86,425	0.03
Origin Energy Finance Ltd., 144A 3.5% 09/10/2018	USD	405,000	409,645	0.12
SMART ABC Trust, Series 2013-2UG 'AAA' 1.18% 14/02/2019	USD	49,279	49,178	0.01
SMART ABC Trust, Series 2014-1UG 'AAA' 1.68% 14/12/2019	USD	275,000	274,656	0.08
SMART ABC Trust, Series 2015-1UG 'AAA' 1.5% 14/09/2018	USD	70,322	70,250	0.02
SMART ABC Trust, Series 2016-2UG 'A3' 1.71% 15/03/2021	USD	550,000	544,140	0.16
SMART ABC Trust, Series 2016-2UG 'AAA' 2.05% 14/12/2022	USD	695,000	687,390	0.20
Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 144A 4.125% 02/02/2026	USD	150,000	151,972	0.05
Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 144A 3.375% 22/03/2027	USD	605,000	571,537	0.17
WEA Finance LLC, REIT, 144A 3.25% 05/10/2020	USD	350,000	355,919	0.11
Woodside Finance Ltd., 144A 3.65% 05/03/2025	USD	155,000	151,225	0.04
Woodside Finance Ltd., 144A 3.7% 15/09/2026	USD	672,000	645,735	0.19
			4,429,723	1.31
カナダ				
Enbridge, Inc., FRN 6% 15/01/2077	USD	285,000	284,639	0.08
Enbridge, Inc. 4.25% 01/12/2026	USD	140,000	143,031	0.04
Enbridge, Inc. 5.5% 01/12/2046	USD	210,000	223,496	0.07
Toronto-Dominion Bank (The), FRN 3.625% 15/09/2031	USD	710,000	694,916	0.21
			1,346,082	0.40
チリ				
Banco Santander Chile, 144A 3.875% 20/09/2022	USD	150,000	153,923	0.05
Cencosud SA, Reg. 5 5.15% 12/02/2025	USD	450,000	455,123	0.13
			609,046	0.18
ルクセンブルグ				
SES SA, 144A 3.6% 04/04/2023	USD	95,000	93,043	0.03
			93,043	0.03
メキシコ				
Petroleos Mexicanos, 144A 5.375% 13/03/2022	USD	105,000	107,068	0.03
Petroleos Mexicanos 3.5% 23/07/2020	USD	45,000	44,200	0.01
Petroleos Mexicanos 4.875% 24/01/2022	USD	435,000	435,833	0.13
Trust F/1401, REIT, Reg. S 5.25% 15/12/2024	USD	600,000	586,581	0.17
			1,173,702	0.34
オランダ				
Airbus Group Finance BV, 144A 2.7% 17/04/2023	USD	450,000	444,028	0.13
			444,028	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(%)
シンガポール				
HPHT Finance 15 Ltd., 144A 2.25% 17/03/2018	USD	200,000	199,890	0.06
			199,890	0.06
スイス				
Holcim US Finance Sarl & Cie SCS, 144A 6% 30/12/2019	USD	135,000	147,756	0.04
UBS Group Funding Jersey Ltd., 144A 4.125% 24/09/2025	USD	820,000	833,670	0.25
			981,626	0.29
イギリス				
HSBC Holdings plc, FRN 6.375% Perpetual	USD	200,000	199,440	0.06
Nationwide Building Society, 144A 3.9% 21/07/2025	USD	795,000	813,639	0.24
Sky plc, 144A 3.75% 16/09/2024	USD	255,000	255,222	0.08
WFP Finance 2010 4.75% 21/11/2021	USD	355,000	383,870	0.11
			1,652,171	0.49
アメリカ				
21st Century Fox America, Inc. 4.75% 15/09/2044	USD	530,000	529,399	0.16
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L 'A', 144A 3.597% 10/02/2036	USD	100,000	102,433	0.03
Ally Master Owner Trust, Series 2014-1 'A2' 1.29% 15/01/2019	USD	145,000	145,003	0.04
Ally Master Owner Trust, Series 2014-4 'A2' 1.43% 17/06/2019	USD	800,000	800,527	0.24
Ally Master Owner Trust, Series 2015-3 'A' 1.63% 15/05/2020	USD	575,000	574,399	0.17
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 'A' 4% 15/01/2027	USD	63,787	65,780	0.02
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-2 'A' 4.95% 15/07/2024	USD	159,823	170,611	0.05
American Airlines Pass Through Trust, Series 2014-1 'B' 4.375% 01/04/2024	USD	135,525	135,356	0.04
American Airlines Pass Through Trust, Series 2015-1 'B' 3.7% 01/11/2024	USD	42,874	41,856	0.01
American Airlines Pass Through Trust, Series 2016-1 'AA' 3.575% 15/07/2029	USD	279,314	279,663	0.08
American Airlines Pass Through Trust, Series 2016-2 'A' 3.65% 15/12/2029	USD	1,405,000	1,397,097	0.41
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2013-5 'D' 2.86% 09/12/2019	USD	345,000	349,357	0.10
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2014-1 'C' 2.15% 09/03/2020	USD	350,000	352,026	0.10
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2014-2 'C' 2.18% 08/06/2020	USD	525,000	528,355	0.16
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-1 'A3' 1.26% 08/11/2019	USD	43,591	43,594	0.01
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-3 'B' 2.08% 08/09/2020	USD	170,000	170,574	0.05
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2016-1 'A3' 1.81% 08/10/2020	USD	55,000	55,130	0.02
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2016-1 'C' 2.89% 10/01/2022	USD	345,000	349,347	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 (%)
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2016-2 'C' 2.87% 08/11/2021	USD	85,000	85,487	0.03
ARI Fleet Lease Trust, Series 2016-A 'A3', 144A 2.11% 15/07/2024	USD	300,000	298,519	0.09
Ascension Health 3.945% 15/11/2046	USD	390,000	371,446	0.11
Accentium Equipment Receivables LLC, Series 2015-1A 'A3', 144A 1.61% 13/10/2020	USD	39,376	39,427	0.01
Accentium Equipment Receivables Trust, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.92% 10/12/2019	USD	170,000	170,050	0.05
Avis Budget Rental Car Funding AEGOP LLC, Series 2013-1A 'A', 144A 1.92% 20/09/2019	USD	420,000	417,972	0.12
Avis Budget Rental Car Funding AEGOP LLC, Series 2013-2A 'A', 144A 2.97% 20/02/2020	USD	160,000	161,683	0.05
Avis Budget Rental Car Funding AEGOP LLC, Series 2014-1A 'A', 144A 2.46% 20/07/2020	USD	1,135,000	1,132,443	0.33
Avis Budget Rental Car Funding AEGOP LLC, Series 2014-2A 'A', 144A 2.5% 20/02/2021	USD	120,000	119,534	0.04
Banc of America Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2006-3 'AM' 6.058% 10/07/2044	USD	140,000	108,057	0.03
Banc of America Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2007-4 'AM' 6.007% 10/02/2051	USD	370,000	376,882	0.11
Banc of America Commercial Mortgage Trust, Series 2007-5 'A4' 5.492% 10/02/2051	USD	100,273	102,017	0.03
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-A '2A2' 2.947% 25/02/2034	USD	9,173	9,078	-
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-B '2A2' 3.045% 25/03/2034	USD	52,881	52,639	0.02
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-D '2A2' 3.257% 25/05/2034	USD	116,544	116,772	0.03
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-H '2A2' 3.197% 25/09/2034	USD	66,554	65,140	0.02
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-I '3A2' 3.282% 25/10/2034	USD	19,895	19,773	0.01
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J '2A1' 3.401% 25/11/2035	USD	132,982	123,581	0.04
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J '3A1' 3.602% 25/11/2035	USD	62,854	60,447	0.02
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2014-3 'A' 2.41% 15/07/2022	USD	325,000	328,765	0.10
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2015-1 'A' 2.2% 15/12/2022	USD	100,000	100,449	0.03
Barclays Dryrock Issuance Trust, Series 2015-2 'A' 1.56% 15/03/2021	USD	410,000	410,005	0.12
Bay Area Toll Authority F-2' 6.263% 01/04/2049	USD	255,000	345,757	0.10
Baylor Scott & White Holdings 3.967% 15/11/2046	USD	375,000	352,598	0.10
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-PW17 'A4' 5.694% 11/06/2050	USD	100,605	102,361	0.03
BMW Vehicle Lease Trust, Series 2016-2 'A4' 1.57% 20/02/2020	USD	425,000	421,522	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 (%)
Cabela's Credit Card Master Note Trust, Series 2012-1A 'A1', 144A 1.63% 18/02/2020	USD	100,000	100,069	0.03
Cabela's Credit Card Master Note Trust, Series 2012-2A 'A1', 144A 1.45% 15/06/2020	USD	500,000	500,606	0.15
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2014-1 'C' 2.84% 22/04/2019	USD	30,000	30,331	0.01
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2015-2 'A3' 1.73% 20/09/2019	USD	240,000	240,658	0.07
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2015-4 'A4' 2.01% 20/07/2020	USD	35,000	35,055	0.01
CarMax Auto Owner Trust, Series 2013-3 'B' 1.91% 15/03/2019	USD	225,000	226,005	0.07
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 'B' 1.69% 15/08/2019	USD	25,000	25,061	0.01
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 'C' 1.93% 15/11/2019	USD	35,000	35,186	0.01
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-1 'A4' 1.88% 15/06/2021	USD	340,000	338,792	0.10
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-2 'A4' 1.68% 15/09/2021	USD	280,000	276,731	0.08
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-2 'B' 2.16% 15/12/2021	USD	90,000	89,268	0.03
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-4 'A3' 1.4% 15/08/2021	USD	585,000	578,754	0.17
CGG Receivables Trust, Series 2016-1 'A2', 144A 1.69% 14/09/2022	USD	220,000	219,851	0.07
Celgene Corp. 3.625% 15/05/2024	USD	400,000	401,230	0.12
Celgene Corp. 3.875% 15/08/2025	USD	1,090,000	1,105,821	0.33
Charter Communications Operating LLC 4.908% 23/07/2025	USD	1,110,000	1,162,736	0.34
Charter Communications Operating LLC 6.384% 23/10/2035	USD	40,000	45,508	0.01
Charter Communications Operating LLC 6.484% 23/10/2045	USD	255,000	294,612	0.09
Chase Issuance Trust, Series 2015-A2 'A2' 1.59% 18/02/2020	USD	265,000	265,776	0.08
Chicago Metropolitan Water Reclamation 5.72% 01/12/2038	USD	410,000	489,638	0.14
Chicago O Hare International Airport 'B' 6.395% 01/01/2040	USD	170,000	221,053	0.07
Chrysler Capital Auto Receivables Trust, Series 2016-BA 'A2', 144A 1.36% 15/01/2020	USD	175,000	174,786	0.05
Chrysler Capital Auto Receivables Trust, Series 2016-BA 'A3', 144A 1.64% 15/07/2021	USD	165,000	163,686	0.05
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2014-GC25 'A4' 3.635% 10/10/2047	USD	625,000	646,653	0.19
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC27 'A5' 3.137% 10/02/2048	USD	225,000	224,463	0.07
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC33 'A4' 3.778% 10/09/2058	USD	175,000	182,174	0.05
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC35 'A4' 3.818% 10/11/2048	USD	190,000	198,508	0.06
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-P1 'A5' 3.717% 15/09/2048	USD	700,000	729,391	0.22
City of Los Angeles Department of Airports 7.053% 15/05/2040	USD	70,000	95,624	0.03
City of New York 6.271% 01/12/2037	USD	165,000	213,848	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(%)
CNH Equipment Trust, Series 2012-D 'B' 1.27% 15/05/2020	USD	105,000	105,059	0.03
CNH Equipment Trust, Series 2015-A 'A4' 1.85% 15/04/2021	USD	1,009,000	1,012,429	0.30
CNH Equipment Trust, Series 2016-C 'A3' 1.44% 15/12/2021	USD	240,000	237,637	0.07
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2014-TWC 'A', 144A 1.389% 13/02/2032	USD	100,000	100,003	0.03
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2014-UBS4 'C' 4.781% 10/08/2047	USD	150,000	147,348	0.04
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LG21 'B' 4.455% 10/07/2048	USD	170,000	169,187	0.05
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-PC1 'AM' 4.29% 10/07/2050	USD	50,000	51,564	0.02
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-PC1 'B' 4.591% 10/07/2050	USD	85,000	83,835	0.02
COMM Mortgage Trust, Series 2014-UBS5 'A4' 3.838% 10/09/2047	USD	395,000	411,954	0.12
COMM Mortgage Trust, Series 2014-UBS6 'A5' 3.644% 10/12/2047	USD	580,000	596,354	0.18
COMM Mortgage Trust, Series 2015-CR24 'A5' 3.696% 10/08/2048	USD	160,000	165,947	0.05
COMM Mortgage Trust, Series 2015-CR26 'A4' 3.63% 10/10/2048	USD	345,000	354,805	0.10
COMM Mortgage Trust, Series 2015-LG23 'A4' 3.774% 10/10/2053	USD	180,000	187,459	0.06
COMM Mortgage Trust, Series 2015-PC1 'A2' 3.148% 10/07/2050	USD	65,000	66,711	0.02
COMM Mortgage Trust, Series 2015-PC1 'A5' 3.902% 10/07/2050	USD	1,775,000	1,853,265	0.55
COMM Mortgage Trust, Series 2016-CR28 'AHR' 3.651% 10/02/2049	USD	129,830	130,364	0.04
Commercial Mortgage Trust, Series 2007-GG9 'AM' 5.475% 10/03/2039	USD	96,309	96,285	0.03
Commonwealth of Virginia Transportation Board 5.35% 15/05/2035	USD	265,000	315,816	0.09
Continental Airlines Pass Through Trust, Series 2012-1 'A' 4.15% 11/10/2025	USD	37,248	38,319	0.01
Credit Suisse Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2008-C1 'A3' 6.266% 15/02/2041	USD	385,000	392,869	0.12
Crown Castle Towers LLC, 144A 6.113% 15/01/2040	USD	113,000	122,533	0.04
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.222% 15/05/2042	USD	25,000	25,444	0.01
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.663% 15/05/2045	USD	255,000	256,010	0.08
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C3 'A4' 3.718% 15/08/2048	USD	590,000	614,820	0.18
CSMC Trust, FRN, Series 2015-GLPB 'B', 144A 3.938% 15/11/2034	USD	170,000	175,324	0.05
CSMC Trust, Series 2015-GLPB 'A', 144A 3.639% 15/11/2034	USD	410,000	427,084	0.13
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2010-2 'A' 4.95% 23/11/2020	USD	31,274	32,814	0.01
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2011-1 'A' 5.3% 15/10/2020	USD	33,816	35,718	0.01
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2015-1 'AA' 3.625% 30/01/2029	USD	114,993	118,874	0.04
Denver City & County School 4.242% 15/12/2037	USD	70,000	70,883	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（%）
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2013-2 'A', 144A 2.27% 20/05/2026	USD	128,576	128,068	0.04
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2015-1 'A', 144A 2.73% 20/07/2027	USD	41,142	40,904	0.01
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2015-2 'A', 144A 2.99% 22/05/2028	USD	96,293	95,650	0.03
Discover Card Execution Note Trust, Series 2016-A3 'A3' 1.85% 15/10/2023	USD	740,000	724,509	0.21
District of Columbia 5.591% 01/12/2034	USD	60,000	73,151	0.02
Domino's Pizza Master Issuer LLC, Series 2012-1A 'A2', 144A 5.216% 25/01/2042	USD	174,600	178,637	0.05
East Bay Municipal Utility District Water System 5.874% 01/06/2040	USD	515,000	637,266	0.19
Elara HGV Timeshare Issuer LLC, Series 2014-A 'A', 144A 2.53% 25/02/2027	USD	42,781	42,639	0.01
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2015-1 'A2', 144A 1.3% 20/09/2020	USD	292,694	292,503	0.09
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2016-1 'A3', 144A 2.08% 20/09/2021	USD	560,000	555,716	0.16
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2016-2 'A2', 144A 1.74% 22/02/2022	USD	475,000	473,741	0.14
ERAC USA Finance LLC, 144A 3.8% 01/11/2025	USD	160,000	160,909	0.05
Expedia, Inc. 5% 15/02/2026	USD	1,070,000	1,101,655	0.33
Express Scripts Holding Co. 4.5% 25/02/2026	USD	980,000	1,006,607	0.30
Express Scripts Holding Co. 4.8% 15/07/2046	USD	220,000	211,001	0.06
FHLMC, FRN, Series 2014-HQ2 'M2' 2.784% 25/09/2024	USD	250,000	255,374	0.08
FHLMC, FRN, Series 2014-HQ3 'M2' 3.234% 25/10/2024	USD	503,719	508,124	0.15
FHLMC, FRN, Series 2015-DN1 'M2' 2.984% 25/01/2025	USD	123,228	123,747	0.04
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA1 'M2' 2.434% 25/10/2027	USD	250,000	253,681	0.08
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA2 'M2' 3.184% 25/12/2027	USD	228,037	230,451	0.07
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA3 'M2' 3.442% 25/04/2028	USD	1,100,000	1,132,273	0.34
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ1 'M2' 2.784% 25/03/2025	USD	213,341	215,290	0.06
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ2 'M2' 2.534% 25/05/2025	USD	250,000	253,867	0.08
FHLMC, FRN, Series 2015-HQA1 'M2' 3.234% 25/03/2028	USD	230,764	235,511	0.07
FHLMC, FRN, Series 2015-HQA2 'M2' 3.384% 25/05/2028	USD	850,000	872,851	0.26
FHLMC, FRN, Series 2016-DNA1 'M2' 3.656% 25/07/2028	USD	250,000	257,481	0.08
FHLMC, FRN, Series 2016-DNA3 'M2' 2.584% 25/12/2028	USD	430,000	434,223	0.13
FHLMC, Series K025 'A1' 1.875% 25/04/2022	USD	98,277	97,836	0.03
FHLMC, Series K502 'A2' 1.426% 25/08/2017	USD	24,985	25,005	0.01
FHLMC A26586 6% 01/09/2034	USD	3,473	3,990	-
FHLMC A71375 6% 01/01/2038	USD	2,438	2,756	-
FHLMC A71803 6% 01/01/2038	USD	2,375	2,685	-
FHLMC A90053 4.5% 01/12/2039	USD	62,611	67,662	0.02
FHLMC A91947 5% 01/04/2040	USD	13,054	14,190	-

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
FHLMC A93451 4.5% 01/08/2040	USD	234,022	252,101	0.07
FHLMC A94185 4% 01/10/2040	USD	3,010	3,172	-
FHLMC A94251 4% 01/10/2040	USD	2,027	2,136	-
FHLMC A94576 4% 01/10/2040	USD	973	1,025	-
FHLMC A94713 4% 01/11/2040	USD	1,956	2,060	-
FHLMC A95734 4% 01/12/2040	USD	17,282	18,236	0.01
FHLMC A96312 4% 01/01/2041	USD	74,993	79,019	0.02
FHLMC A97620 4.5% 01/03/2041	USD	2,586	2,776	-
FHLMC C01787 6% 01/02/2034	USD	61,313	70,185	0.02
FHLMC C04238 3.5% 01/09/2042	USD	364,112	373,860	0.11
FHLMC C09036 3.5% 01/03/2043	USD	216,576	222,284	0.07
FHLMC C09042 3.5% 01/05/2043	USD	163,982	168,341	0.05
FHLMC E01341 5.5% 01/03/2018	USD	2,902	2,956	-
FHLMC E01497 5.5% 01/11/2018	USD	1,443	1,486	-
FHLMC G01777 6% 01/02/2035	USD	53,054	60,206	0.02
FHLMC G01899 6% 01/09/2035	USD	18,572	21,254	0.01
FHLMC G02712 6% 01/12/2028	USD	8,933	10,244	-
FHLMC G03551 6% 01/11/2037	USD	67,716	76,818	0.02
FHLMC G04814 5.5% 01/10/2038	USD	239,151	266,202	0.08
FHLMC G05535 4.5% 01/07/2039	USD	131,845	141,579	0.04
FHLMC G05659 4.5% 01/10/2039	USD	195,096	210,183	0.06
FHLMC G05955 5% 01/08/2040	USD	127,093	138,337	0.04
FHLMC G05958 5% 01/08/2040	USD	323,662	352,356	0.10
FHLMC G06231 4% 01/12/2040	USD	116,853	122,823	0.04
FHLMC G06252 4% 01/02/2041	USD	3,217	3,392	-
FHLMC G06506 4% 01/12/2040	USD	612	644	-
FHLMC G07543 4.5% 01/08/2041	USD	30,290	32,661	0.01
FHLMC G08016 6% 01/10/2034	USD	302,236	344,991	0.10
FHLMC G08534 3% 01/06/2043	USD	336,631	334,897	0.10
FHLMC G08677 4% 01/11/2045	USD	1,082,112	1,134,918	0.34
FHLMC G18465 2.5% 01/05/2028	USD	128,088	128,091	0.04
FHLMC G60038 3.5% 01/01/2044	USD	174,527	179,204	0.05
FHLMC G60180 4.5% 01/05/2042	USD	151,735	163,065	0.05
FHLMC G60334 4.5% 01/10/2041	USD	115,557	124,210	0.04
FHLMC G60440 3.5% 01/03/2046	USD	1,204,049	1,234,094	0.36
FHLMC J03640 6% 01/10/2021	USD	20,587	21,733	0.01
FHLMC J15139 4% 01/05/2026	USD	53,751	56,616	0.02
FHLMC Q04674 4% 01/12/2041	USD	46,706	49,100	0.01
FHLMC Q14426 3% 01/01/2043	USD	468,734	466,906	0.14
FHLMC Q40547 3.5% 01/05/2045	USD	441,985	452,241	0.13
FHLMC U90932 3% 01/02/2043	USD	43,751	43,539	0.01
FHLMC U91090 3% 01/03/2043	USD	19,654	19,559	0.01
FHLMC V80025 3% 01/04/2043	USD	37,490	37,343	0.01
FHLMC REMIC, FRN, Series 4614 'FG' 1.204% 15/09/2046	USD	378,238	376,216	0.11
FHLMC REMIC, FRN, Series 4621 'FK' 1.204% 15/10/2046	USD	209,351	209,446	0.06
FHLMC REMIC, FRN, Series 4623 'EP' 1.154% 15/10/2046	USD	130,170	129,562	0.04
FHLMC REMIC, FRN, Series 4623 'MF' 1.204% 15/10/2046	USD	119,617	119,696	0.04
FirstEnergy Transmission LLC, 144A 4.35% 15/01/2025	USD	480,000	496,050	0.15
FNMA, FRN 763199 2.45% 01/10/2033	USD	13,776	14,285	-
FNMA, FRN 848522 2.234% 01/12/2035	USD	12,049	12,688	-
FNMA 7.125% 15/01/2030	USD	100,000	143,049	0.04
FNMA 190360 5% 01/08/2035	USD	28,060	30,662	0.01
FNMA 254140 5.5% 01/01/2017	USD	7	7	-
FNMA 254869 5.5% 01/09/2033	USD	89,418	100,323	0.03
FNMA 254903 5% 01/10/2033	USD	16,835	18,442	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 545759 6.5% 01/07/2032	USD	28,936	33,537	0.01
FNMA 555526 5.5% 01/05/2018	USD	2,287	2,321	-
FNMA 670373 6.5% 01/09/2017	USD	1,520	1,524	-
FNMA 725027 5% 01/11/2033	USD	17,631	19,371	0.01
FNMA 725229 6% 01/03/2034	USD	89,282	102,668	0.03
FNMA 725232 5% 01/03/2034	USD	7,282	7,999	-
FNMA 725238 5% 01/03/2034	USD	30,341	33,311	0.01
FNMA 725423 5.5% 01/05/2034	USD	228,319	256,093	0.08
FNMA 735061 6% 01/11/2034	USD	10,023	11,429	-
FNMA 735115 6% 01/12/2034	USD	3,175	3,627	-
FNMA 735141 5.5% 01/01/2035	USD	55,298	61,955	0.02
FNMA 735318 4.5% 01/11/2019	USD	6,949	7,156	-
FNMA 735500 5.5% 01/05/2035	USD	19,137	21,438	0.01
FNMA 735502 6% 01/04/2035	USD	5,967	6,804	-
FNMA 735575 5.5% 01/12/2018	USD	1,241	1,254	-
FNMA 735578 5% 01/06/2035	USD	47,659	52,119	0.02
FNMA 735579 5% 01/06/2035	USD	7,284	7,990	-
FNMA 735580 5% 01/06/2035	USD	4,241	4,625	-
FNMA 735591 5% 01/06/2035	USD	2,057	2,259	-
FNMA 735667 5% 01/07/2035	USD	13,940	15,308	-
FNMA 735669 5% 01/04/2035	USD	11,274	12,381	-
FNMA 735676 5% 01/07/2035	USD	1,364,099	1,497,119	0.44
FNMA 735997 5.5% 01/11/2035	USD	17,421	19,510	0.01
FNMA 745428 5.5% 01/01/2036	USD	116,673	130,676	0.04
FNMA 745458 6% 01/04/2036	USD	312	355	-
FNMA 745947 6.5% 01/10/2036	USD	5,289	6,091	-
FNMA 750412 6.5% 01/11/2033	USD	16,371	18,528	0.01
FNMA 888223 5.5% 01/01/2036	USD	21,955	24,627	0.01
FNMA 888284 5.5% 01/04/2037	USD	83,545	93,258	0.03
FNMA 888430 5% 01/11/2033	USD	17,878	19,610	0.01
FNMA 888437 5.5% 01/11/2036	USD	325,174	364,543	0.11
FNMA 888567 5.5% 01/12/2036	USD	149,093	166,968	0.05
FNMA 889117 5% 01/10/2035	USD	263,893	289,930	0.09
FNMA 889298 5% 01/12/2036	USD	56,256	61,263	0.02
FNMA 889307 5% 01/07/2037	USD	21,156	23,227	0.01
FNMA 889479 5% 01/07/2037	USD	176,590	192,941	0.06
FNMA 889579 6% 01/05/2038	USD	4,443	5,033	-
FNMA 889829 5% 01/07/2035	USD	192,659	212,858	0.06
FNMA 890263 4% 01/11/2025	USD	88,336	93,214	0.03
FNMA 890527 4.5% 01/09/2042	USD	86,974	93,786	0.03
FNMA 890565 3% 01/11/2043	USD	215,268	214,559	0.06
FNMA 890738 3.5% 01/09/2043	USD	229,764	236,272	0.07
FNMA 900724 5.5% 01/08/2021	USD	3,365	3,537	-
FNMA 901646 6.5% 01/12/2036	USD	1,319	1,494	-
FNMA 902382 6.5% 01/11/2036	USD	10,267	11,630	-
FNMA 906064 6% 01/01/2037	USD	920	1,042	-
FNMA 933051 6.5% 01/10/2037	USD	53,817	61,741	0.02
FNMA 942477 6% 01/08/2022	USD	2,612	2,835	-
FNMA 948410 6% 01/08/2022	USD	2,538	2,673	-
FNMA 995024 5.5% 01/08/2037	USD	246,056	275,727	0.08
FNMA 995051 6% 01/03/2037	USD	76,577	87,173	0.03
FNMA 995112 5.5% 01/07/2036	USD	37,461	41,972	0.01
FNMA 995113 5.5% 01/09/2036	USD	231,864	260,075	0.08
FNMA 995203 5% 01/07/2035	USD	106,595	117,060	0.03
FNMA 995388 5.5% 01/08/2037	USD	11,782	13,188	-
FNMA 995434 5% 01/09/2023	USD	45,489	46,814	0.01
FNMA 995629 6.5% 01/12/2032	USD	32,993	38,235	0.01
FNMA AA4328 4% 01/04/2024	USD	63,734	67,237	0.02
FNMA AB5615 3.5% 01/07/2042	USD	45,751	47,062	0.01
FNMA AB5807 3.5% 01/08/2042	USD	94,156	96,867	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(%)
FNMA AB6317 3.5% 01/09/2042	USD	24,582	25,309	0.01
FNMA AB6491 3% 01/10/2042	USD	62,742	62,535	0.02
FNMA AB6670 3% 01/10/2042	USD	49,015	48,854	0.01
FNMA AB6768 3% 01/10/2042	USD	79,485	79,223	0.02
FNMA AB6812 2.5% 01/11/2027	USD	182,530	182,653	0.05
FNMA AB7143 2.5% 01/12/2027	USD	178,370	178,491	0.05
FNMA AB7733 3% 01/01/2043	USD	238,566	237,779	0.07
FNMA AB7846 3% 01/02/2043	USD	130,088	129,659	0.04
FNMA AB8898 3% 01/04/2043	USD	239,167	238,378	0.07
FNMA AC3237 5% 01/10/2039	USD	413,286	455,940	0.13
FNMA AC9580 4.5% 01/02/2040	USD	888,739	955,809	0.28
FNMA AC9582 5.5% 01/01/2040	USD	60,968	67,954	0.02
FNMA AD0163 6% 01/11/2034	USD	292,861	336,897	0.10
FNMA AD0220 6% 01/10/2038	USD	407,617	461,663	0.14
FNMA AE0624 4% 01/11/2040	USD	92,561	97,290	0.03
FNMA AE0698 4.5% 01/12/2040	USD	37,419	40,298	0.01
FNMA AE0949 4% 01/02/2041	USD	583,186	614,800	0.18
FNMA AE3049 4.5% 01/09/2040	USD	30,205	32,497	0.01
FNMA AE7723 4% 01/11/2040	USD	68,297	71,797	0.02
FNMA AH1111 4% 01/12/2040	USD	424,001	445,836	0.13
FNMA AH3394 4% 01/01/2041	USD	122,740	129,054	0.04
FNMA AH5859 4% 01/02/2041	USD	125,222	131,936	0.04
FNMA AL0065 4.5% 01/04/2041	USD	131,310	141,314	0.04
FNMA AL0251 5% 01/07/2037	USD	4,134	4,534	-
FNMA AL0546 5% 01/07/2041	USD	156,143	170,938	0.05
FNMA AL0803 4% 01/09/2041	USD	248,578	261,965	0.08
FNMA AL1105 4.5% 01/12/2040	USD	98,027	105,610	0.03
FNMA AL1371 4% 01/01/2027	USD	159,361	168,175	0.05
FNMA AL1524 4.5% 01/12/2040	USD	26,639	28,658	0.01
FNMA AL1577 5% 01/01/2042	USD	28,986	31,674	0.01
FNMA AL1697 4% 01/10/2041	USD	351,641	370,527	0.11
FNMA AL1938 4% 01/12/2028	USD	46,736	48,980	0.01
FNMA AL2462 2.5% 01/10/2027	USD	364,911	365,158	0.11
FNMA AL2579 4% 01/12/2026	USD	178,784	188,470	0.06
FNMA AL2645 4.5% 01/01/2027	USD	184,271	194,903	0.06
FNMA AL2661 4% 01/10/2026	USD	18,979	19,997	0.01
FNMA AL2726 2.5% 01/12/2027	USD	178,430	178,550	0.05
FNMA AL3192 5% 01/05/2042	USD	136,143	149,077	0.04
FNMA AL3195 2.5% 01/03/2028	USD	218,890	219,039	0.06
FNMA AL3657 3.5% 01/06/2043	USD	67,173	69,048	0.02
FNMA AL4010 3.5% 01/07/2043	USD	43,817	45,059	0.01
FNMA AL4061 3.5% 01/08/2043	USD	31,803	32,700	0.01
FNMA AL4301 4.5% 01/04/2042	USD	64,715	69,630	0.02
FNMA AL5224 5% 01/02/2038	USD	14,621	16,031	-
FNMA AL5362 5% 01/09/2039	USD	226,262	247,905	0.07
FNMA AL5590 5.5% 01/09/2041	USD	10,474	11,746	-
FNMA AL6078 5% 01/03/2042	USD	31,683	34,603	0.01
FNMA AL6167 3.5% 01/01/2044	USD	41,480	42,675	0.01
FNMA AL6549 5% 01/07/2042	USD	314,108	342,977	0.10
FNMA AL6964 5.5% 01/03/2041	USD	442,394	496,123	0.15
FNMA AL6966 6.5% 01/08/2038	USD	44,740	52,557	0.02
FNMA AL7033 5% 01/06/2039	USD	27,425	29,992	0.01
FNMA AL7035 5% 01/12/2038	USD	38,944	42,613	0.01
FNMA AL7121 3% 01/01/2044	USD	1,465,723	1,460,890	0.43
FNMA AL7389 4% 01/03/2029	USD	125,771	132,695	0.04
FNMA AL7522 4.5% 01/06/2044	USD	464,350	500,112	0.15
FNMA AL8045 3.5% 01/12/2042	USD	639,903	658,330	0.19
FNMA AL8310 3.5% 01/03/2044	USD	104,119	107,033	0.03
FNMA AL8627 2.5% 01/06/2028	USD	629,196	629,704	0.19
FNMA AL9061 3% 01/06/2046	USD	63,520	63,179	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(%)
FNMA AL9062 3% 01/09/2046	USD	64,492	64,145	0.02
FNMA AL9074 6% 01/05/2041	USD	459,508	523,244	0.15
FNMA AL9267 3% 01/10/2046	USD	2,193,208	2,175,088	0.64
FNMA AL9547 3% 01/11/2046	USD	590,000	585,998	0.17
FNMA AO4163 3.5% 01/06/2042	USD	36,642	37,695	0.01
FNMA AO6755 3.5% 01/06/2042	USD	50,361	51,810	0.02
FNMA AO7977 3% 01/06/2027	USD	307,157	315,391	0.09
FNMA AP7539 3% 01/09/2027	USD	105,466	108,294	0.03
FNMA AP9785 2.5% 01/10/2027	USD	179,463	179,585	0.05
FNMA AQ0532 2.5% 01/11/2042	USD	50,962	48,465	0.01
FNMA AQ0535 3% 01/11/2042	USD	47,265	47,109	0.01
FNMA AQ7316 2.5% 01/01/2043	USD	333,669	317,763	0.09
FNMA AQ8719 2.5% 01/12/2027	USD	167,093	167,205	0.05
FNMA AQ8803 3.5% 01/01/2043	USD	66,261	68,168	0.02
FNMA AR2626 2.5% 01/02/2043	USD	273,642	260,602	0.08
FNMA AR3373 2.5% 01/02/2028	USD	216,736	216,882	0.06
FNMA AR7145 3.5% 01/07/2043	USD	57,664	59,286	0.02
FNMA AR9048 3% 01/03/2043	USD	16,937	16,782	-
FNMA AR9139 3% 01/03/2043	USD	17,741	17,578	0.01
FNMA AR9188 2.5% 01/03/2043	USD	65,033	61,933	0.02
FNMA AR9225 3% 01/03/2043	USD	57,252	56,726	0.02
FNMA AS0024 3.5% 01/07/2043	USD	108,886	111,942	0.03
FNMA AS0519 3.5% 01/09/2043	USD	55,018	56,571	0.02
FNMA AS0526 3.5% 01/09/2043	USD	37,494	38,534	0.01
FNMA AS0663 4.5% 01/09/2043	USD	351,162	377,032	0.11
FNMA AS0750 3% 01/10/2028	USD	1,131,563	1,163,342	0.34
FNMA AS1133 4.5% 01/11/2043	USD	166,005	178,235	0.05
FNMA AS1585 4.5% 01/01/2044	USD	446,969	479,898	0.14
FNMA AS2275 4.5% 01/04/2044	USD	132,818	142,684	0.04
FNMA AS3855 3.5% 01/11/2044	USD	28,011	28,750	0.01
FNMA AS4794 3.5% 01/04/2045	USD	1,024,218	1,050,316	0.31
FNMA AS4835 3% 01/04/2045	USD	24,173	24,030	0.01
FNMA AS4864 2.5% 01/05/2030	USD	748,533	749,456	0.22
FNMA AS5298 2.5% 01/07/2030	USD	281,238	281,370	0.08
FNMA AS5713 3.5% 01/09/2045	USD	529,734	545,931	0.16
FNMA AS6313 4% 01/12/2045	USD	364,905	384,317	0.11
FNMA AS6324 3.5% 01/12/2045	USD	2,960,407	3,028,797	0.90
FNMA AS6328 3.5% 01/12/2045	USD	507,331	519,045	0.15
FNMA AS6349 4% 01/12/2045	USD	369,562	389,921	0.12
FNMA AS6351 4% 01/12/2045	USD	49,165	51,637	0.02
FNMA AS6563 3.5% 01/01/2046	USD	23,189	23,775	0.01
FNMA AS6840 4% 01/03/2046	USD	565,784	597,074	0.18
FNMA AS7269 2.5% 01/06/2031	USD	61,464	61,468	0.02
FNMA AS8067 3% 01/10/2046	USD	2,296,723	2,277,747	0.67
FNMA AS8194 2.5% 01/10/2031	USD	221,806	221,889	0.07
FNMA AS8318 3% 01/11/2046	USD	3,305,003	3,277,496	0.97
FNMA AS8470 3% 01/12/2046	USD	870,000	863,082	0.26
FNMA AS8471 3% 01/12/2046	USD	571,000	566,282	0.17
FNMA AS8483 3% 01/12/2046	USD	3,413,070	3,384,664	1.00
FNMA AS8485 3% 01/12/2046	USD	870,000	864,160	0.26
FNMA AS9031 3% 01/06/2033	USD	21,631	21,540	0.01
FNMA AS9032 3% 01/08/2043	USD	88,240	87,567	0.03
FNMA AS9043 3% 01/04/2033	USD	8,834	8,796	-
FNMA AS9044 3% 01/08/2043	USD	151,779	150,386	0.04
FNMA AS9160 3.5% 01/01/2044	USD	527,179	539,626	0.16
FNMA AS9236 3% 01/02/2044	USD	18,790	18,647	0.01
FNMA AS9241 3% 01/09/2044	USD	29,345	29,075	0.01
FNMA AT0238 2.5% 01/03/2043	USD	59,420	56,589	0.02
FNMA AT1934 3.5% 01/04/2043	USD	29,617	30,451	0.01
FNMA AT2016 3% 01/04/2043	USD	237,263	236,482	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(%)
FNMA AT2060 2.5% 01/04/2028	USD	176,936	177,056	0.05
FNMA AT2612 3.5% 01/09/2043	USD	46,711	48,021	0.01
FNMA AT2717 2.5% 01/05/2043	USD	176,936	168,505	0.05
FNMA AT2723 3% 01/05/2043	USD	408,563	407,217	0.12
FNMA AT8139 3.5% 01/08/2043	USD	52,915	54,401	0.02
FNMA AT8975 3.5% 01/07/2043	USD	35,754	36,761	0.01
FNMA AT9290 3.5% 01/07/2043	USD	36,933	37,972	0.01
FNMA AUD081 3.5% 01/09/2043	USD	57,479	58,806	0.02
FNMA AUD640 3.5% 01/07/2043	USD	33,132	34,064	0.01
FNMA AU1658 2.5% 01/07/2028	USD	181,738	181,861	0.05
FNMA AU4293 4% 01/09/2043	USD	2,195,915	2,304,884	0.68
FNMA AU5848 3.5% 01/09/2043	USD	309,645	318,255	0.09
FNMA AU6198 3.5% 01/08/2043	USD	37,943	39,008	0.01
FNMA AU7438 3.5% 01/08/2043	USD	32,163	32,899	0.01
FNMA AU7743 3.5% 01/09/2043	USD	40,510	41,643	0.01
FNMA AU7753 3.5% 01/09/2043	USD	37,965	39,025	0.01
FNMA AU7868 3.5% 01/09/2043	USD	61,022	62,580	0.02
FNMA AX2501 4% 01/10/2044	USD	113,799	119,456	0.04
FNMA AX2509 3% 01/10/2029	USD	531,080	544,629	0.16
FNMA AZ0814 3.5% 01/07/2045	USD	233,564	239,238	0.07
FNMA AZ0880 2.5% 01/07/2030	USD	89,831	89,860	0.03
FNMA AZ2118 3% 01/10/2030	USD	70,143	71,927	0.02
FNMA AZ2667 3.5% 01/10/2045	USD	90,235	92,425	0.03
FNMA AZ7353 3.5% 01/11/2045	USD	1,276,076	1,305,517	0.39
FNMA BC0822 3.5% 01/04/2046	USD	686,576	702,434	0.21
FNMA BC0880 3.5% 01/05/2046	USD	672,130	687,777	0.20
FNMA BC5074 3.5% 01/07/2044	USD	1,017,578	1,046,276	0.31
FNMA BC8395 2.5% 01/05/2046	USD	71,115	67,510	0.02
FNMA BC9556 3% 01/11/2046	USD	182,622	181,170	0.05
FNMA BD5518 2.5% 01/09/2046	USD	473,884	449,365	0.13
FNMA BD8464 3% 01/11/2046	USD	271,449	269,290	0.08
FNMA BD8498 3% 01/12/2046	USD	150,801	149,602	0.04
FNMA BD8951 3% 01/11/2046	USD	1,200,000	1,190,012	0.35
FNMA BE0518 3% 01/11/2046	USD	100,000	99,168	0.03
FNMA BE1214 3% 01/11/2046	USD	122,927	121,949	0.04
FNMA MA0561 4% 01/11/2040	USD	248,988	262,247	0.08
FNMA MA0583 4% 01/12/2040	USD	161,450	170,068	0.05
FNMA MA0907 4% 01/11/2041	USD	35,828	37,679	0.01
FNMA MA0971 4% 01/02/2042	USD	52,382	55,227	0.02
FNMA MA1088 3.5% 01/06/2042	USD	61,949	63,714	0.02
FNMA MA2471 3.5% 01/12/2045	USD	203,235	207,924	0.06
FNMA MA2495 3.5% 01/01/2046	USD	807,922	826,577	0.24
FNMA MA2512 4% 01/01/2046	USD	1,690	1,775	-
FNMA MA2730 2.5% 01/08/2046	USD	1,000,000	948,256	0.28
FNMA MA2863 3% 01/01/2047	USD	1,560,000	1,546,738	0.46
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2014-C04 '1M1' 2.534% 25/11/2024	USD	19,472	19,515	0.01
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2014-C04 '2M1' 2.684% 25/11/2024	USD	760	761	-
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2015-C01 '1M1' 2.092% 25/02/2025	USD	1,760	1,760	-
FNMA Connecticut Avenue Securities, FRN, Series 2016-C02 '1M1' 2.742% 25/09/2028	USD	184,688	186,653	0.06
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-103 'LF' 1.04% 25/01/2047	USD	95,000	94,841	0.03
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-63 'AF' 1.256% 25/09/2046	USD	512,484	512,028	0.15
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-64 'FA' 1.256% 25/09/2046	USD	538,087	535,578	0.16

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-70 'F' 1.206% 25/10/2046	USD	257,076	255,804	0.08
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-79 'NF' 1.206% 25/11/2046	USD	509,373	508,600	0.15
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-84 'FT' 1.256% 25/11/2046	USD	288,069	286,508	0.08
Ford Credit Auto Lease Trust, Series 2015-B 'A4' 1.54% 15/02/2019	USD	440,000	440,872	0.13
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2012-D 'D' 1.97% 15/05/2019	USD	270,000	270,200	0.08
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2013-B 'D' 1.82% 15/11/2019	USD	380,000	381,034	0.11
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2013-C 'D' 2.5% 15/01/2020	USD	245,000	246,332	0.07
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2014-1 'A', 144A 2.26% 15/11/2025	USD	260,000	262,236	0.08
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2014-C 'A4' 1.56% 15/02/2020	USD	40,000	40,053	0.01
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2016-2 'A', 144A 2.03% 15/12/2027	USD	1,150,000	1,130,750	0.33
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2016-A 'A4' 1.6% 15/06/2021	USD	235,000	234,340	0.07
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2016-C 'A4' 1.4% 15/02/2022	USD	525,000	516,213	0.15
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2012-5 'A' 1.49% 15/09/2019	USD	435,000	435,781	0.13
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K48 'B', 144A 3.761% 25/08/2048	USD	80,000	76,818	0.02
George Washington University (The) 3.545% 15/09/2046	USD	200,000	170,312	0.05
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2015-3 'A4' 1.81% 20/11/2019	USD	360,000	360,277	0.11
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2016-2 'B' 2.08% 20/03/2020	USD	205,000	203,689	0.06
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2016-2 'C' 2.58% 20/03/2020	USD	125,000	125,037	0.04
GMF Floorplan Owner Revolving Trust, Series 2016-1 'A1', 144A 1.96% 17/05/2021	USD	310,000	308,516	0.09
GMF Floorplan Owner Revolving Trust, Series 2016-1 'B', 144A 2.41% 17/05/2021	USD	100,000	99,581	0.03
GNMA, IO, Series 2010-103 'IN' 4.5% 20/02/2039	USD	13,780	891	-
GNMA, IO, Series 2010-92 'PI' 4.5% 20/11/2037	USD	55,746	1,544	-
GNMA, IO, Series 2011-41 'AI' 4.5% 20/12/2039	USD	174,347	16,512	-
GNMA, IO, Series 2011-88 'EI' 4.5% 20/11/2039	USD	27,255	2,383	-
GNMA, IO, Series 2012-94 'BI' 4% 20/05/2037	USD	157,148	24,675	0.01
GNMA, IO, Series 2013-24 'OI' 4% 20/02/2043	USD	65,525	13,247	-
GNMA, IO, Series 2013-82 'IG' 3.5% 20/05/2043	USD	192,261	39,960	0.01
GNMA 3306 5.5% 20/11/2032	USD	96,920	108,808	0.03
GNMA 3490 6.5% 20/12/2033	USD	95,910	111,530	0.03
GNMA 3611 6% 20/09/2034	USD	57,383	66,662	0.02
GNMA 4060 6% 20/12/2037	USD	6,989	7,898	-
GNMA 4558 4.5% 20/10/2039	USD	146,242	159,312	0.05
GNMA 4559 5% 20/10/2039	USD	30,576	33,883	0.01
GNMA 4577 4.5% 20/11/2039	USD	14,817	16,109	-

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
GNMA 4715 5% 20/06/2040	USD	22,098	24,474	0.01
GNMA 4772 5% 20/06/2040	USD	15,536	17,099	0.01
GNMA 4801 4.5% 20/09/2040	USD	60,692	65,672	0.02
GNMA 4834 4.5% 20/10/2040	USD	50,117	54,677	0.02
GNMA 4854 4.5% 20/11/2040	USD	52,168	56,827	0.02
GNMA 4946 4.5% 20/02/2041	USD	194,893	211,329	0.06
GNMA 4978 4.5% 20/03/2041	USD	53,985	58,591	0.02
GNMA 4979 5% 20/03/2041	USD	123,314	136,395	0.04
GNMA 5054 4% 20/05/2041	USD	88,102	93,978	0.03
GNMA 710927 5% 15/10/2039	USD	17,828	19,673	0.01
GNMA 723339 5% 15/09/2039	USD	31,193	34,677	0.01
GNMA 782888 5% 15/02/2040	USD	46,570	52,310	0.02
GNMA 782889 5% 15/02/2040	USD	46,570	52,332	0.02
GNMA 783403 3.5% 15/09/2041	USD	93,488	97,092	0.03
GNMA 783726 3.5% 20/03/2043	USD	130,762	135,743	0.04
GNMA 783972 5% 15/12/2039	USD	187,016	208,797	0.06
GNMA 784012 5.5% 15/10/2038	USD	12,404	14,027	-
GNMA 784067 4.5% 15/09/2045	USD	381,104	413,280	0.12
GNMA 784069 5% 15/06/2040	USD	80,333	88,478	0.03
GNMA 784145 3.5% 20/02/2046	USD	348,563	363,007	0.11
GNMA AA3342 3% 15/10/2042	USD	13,913	14,028	-
GNMA AA6403 3% 15/05/2043	USD	18,079	18,284	0.01
GNMA AD1732 2.5% 15/02/2043	USD	61,851	59,851	0.02
GNMA AJ9334 3.5% 20/10/2044	USD	35,820	37,246	0.01
GNMA AL4508 3.5% 20/02/2045	USD	73,716	76,640	0.02
GNMA AM4385 3.5% 20/05/2045	USD	28,179	29,296	0.01
GNMA AM4931 3.5% 20/04/2045	USD	25,752	26,774	0.01
GNMA AM8053 3.5% 20/05/2045	USD	57,789	60,096	0.02
GNMA AR0556 3.5% 20/01/2046	USD	23,159	24,080	0.01
GNMA AR7632 3.5% 20/02/2046	USD	376,233	391,280	0.12
GNMA AC8186 3.5% 20/05/2046	USD	24,744	25,712	0.01
GNMA AS9176 3.5% 20/05/2046	USD	24,276	25,245	0.01
GNMA AS9216 3% 20/05/2046	USD	39,460	39,962	0.01
GNMA AS9217 3% 20/05/2046	USD	24,665	24,946	0.01
GNMA AS9258 3% 20/07/2046	USD	34,627	35,067	0.01
GNMA AS9259 3% 20/07/2046	USD	69,446	70,236	0.02
GNMA AS9260 3% 20/07/2046	USD	68,027	68,796	0.02
GNMA AT3441 3% 20/07/2046	USD	97,202	98,313	0.03
GNMA AT3442 3% 20/06/2046	USD	73,405	74,202	0.02
GNMA AT4041 3.5% 20/05/2046	USD	4,945	5,142	-
GNMA AT4164 3% 20/07/2046	USD	135,826	137,370	0.04
GNMA AT4176 3% 20/07/2046	USD	26,765	27,069	0.01
GNMA AU0255 3% 20/08/2046	USD	29,675	29,993	0.01
GNMA AU0271 3% 20/08/2046	USD	51,411	51,995	0.02
GNMA AU2016 3% 20/08/2046	USD	58,557	59,185	0.02
GNMA AV8326 3% 20/09/2046	USD	29,845	30,176	0.01
GNMA AV8327 3% 20/09/2046	USD	32,823	33,196	0.01
GNMA MA0221 4% 20/07/2042	USD	168,546	179,774	0.05
GNMA MA0318 3.5% 20/08/2042	USD	168,239	175,270	0.05
GNMA MA0392 3.5% 20/09/2042	USD	55,554	57,876	0.02
GNMA MA0393 4% 20/09/2042	USD	11,329	12,061	-
GNMA MA0535 4% 20/11/2042	USD	102,790	109,563	0.03
GNMA MA0623 2.5% 20/12/2042	USD	666,089	645,772	0.19
GNMA MA0625 3.5% 20/12/2042	USD	71,841	74,843	0.02
GNMA MA0697 2.5% 20/01/2043	USD	410,685	398,243	0.12
GNMA MA0699 3.5% 20/01/2043	USD	1,046,524	1,090,261	0.32
GNMA MA0783 3.5% 20/02/2043	USD	57,483	59,885	0.02
GNMA MA1012 3.5% 20/05/2043	USD	352,561	367,278	0.11
GNMA MA1088 2.5% 20/06/2043	USD	152,745	148,117	0.04
GNMA MA1155 2.5% 20/07/2043	USD	97,434	94,482	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(%)
GNMA MA1285 3.5% 20/09/2043	USD	549,536	572,453	0.17
GNMA MA1678 4% 20/02/2044	USD	408,819	434,436	0.13
GNMA MA2222 3% 20/09/2044	USD	230,718	233,289	0.07
GNMA MA2896 5.5% 20/06/2045	USD	250,197	276,444	0.08
GNMA MA3106 4% 20/09/2045	USD	99,812	105,900	0.03
GNMA MA3174 4% 20/10/2045	USD	414,723	440,415	0.13
GNMA MA3245 4% 20/11/2045	USD	502,239	532,873	0.16
GNMA MA3311 4% 20/12/2045	USD	1,121,984	1,190,419	0.35
GNMA MA3377 4% 20/01/2046	USD	428,760	454,912	0.13
GNMA MA3664 4% 20/05/2046	USD	702,438	745,283	0.22
GNMA MA3736 3.5% 20/06/2046	USD	1,451,064	1,508,361	0.45
GNMA MA3937 3.5% 20/09/2046	USD	628,554	652,643	0.19
GNMA MA4004 3.5% 20/10/2046	USD	144,792	150,335	0.04
GNMA MA4068 3% 20/11/2046	USD	2,908,207	2,938,095	0.87
GNMA MA4126 3% 20/12/2046	USD	124,000	125,274	0.04
Grain Spectrum Funding LLC, 144A 4% 10/10/2018	USD	195,000	193,328	0.06
GS Mortgage Securities Trust, Series 2012-GCJ9 'A3' 2.773% 10/11/2045	USD	135,000	136,008	0.04
GS Mortgage Securities Trust, Series 2015-GC2B 'A5' 3.396% 10/02/2048	USD	500,000	508,043	0.15
GS Mortgage Securities Trust, Series 2015-GC34 'A4' 3.506% 10/10/2048	USD	240,000	244,730	0.07
GS Mortgage-Backed Securities Trust, FRN, Series 2014-EB1A '2A1', 144A 2.481% 25/07/2044	USD	60,667	60,365	0.02
GGAA Trust, FRN, Series 2005-B 'A3' 1.186% 25/06/2035	USD	51,797	49,256	0.01
Hilton Grand Vacations Trust, Series 2014-AA 'A', 144A 1.77% 25/11/2026	USD	67,490	66,243	0.02
HOA Funding LLC, Series 2014-1A 'A2', 144A 4.846% 20/08/2044	USD	157,575	139,894	0.04
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2015-B 'A4', 144A 1.66% 15/07/2019	USD	310,000	310,922	0.09
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2016-A 'A4', 144A 1.8% 16/12/2019	USD	240,000	240,654	0.07
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2016-B 'A3', 144A 1.52% 15/10/2019	USD	160,000	159,843	0.05
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2016-C 'A3', 144A 1.49% 18/02/2020	USD	375,000	373,975	0.11
Hyundai Auto Receivables Trust, Series 2016-A 'A4' 1.73% 16/05/2022	USD	305,000	304,957	0.09
INVISTA Finance LLC, 144A 4.25% 15/10/2019	USD	60,000	59,829	0.02
J.P. Morgan Chase & Co., FRN 2.111% 24/10/2023	USD	1,780,000	1,812,262	0.54
J.P. Morgan Chase & Co. 3.875% 10/09/2024	USD	620,000	625,695	0.19
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2006-LDP7 'AM' 6.115% 17/04/2045	USD	28,792	28,751	0.01
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-CB19 'A4' 5.903% 12/02/2049	USD	82,830	83,340	0.02
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2007-LD12 'A4' 5.862% 15/02/2051	USD	174,638	177,015	0.05
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2016-JP3 'B' 3.397% 15/06/2049	USD	170,000	165,864	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 (%)
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2007-CB18 'A4' 5.44% 12/06/2047	USD	19,599	19,587	0.01
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8 'A3' 2.829% 15/10/2045	USD	185,000	187,418	0.06
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-LC11 'A5' 2.96% 15/04/2046	USD	145,000	146,589	0.04
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2016-ATRM 'A', 144A 2.962% 05/10/2028	USD	590,000	593,358	0.18
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2016-JP3 'A5' 2.87% 15/08/2049	USD	350,000	339,212	0.10
JobsOhio Beverage System 'B' 4.532% 01/01/2035	USD	155,000	165,676	0.05
John Deere Owner Trust, Series 2015-A 'A4' 1.65% 15/12/2021	USD	115,000	115,303	0.03
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2014-C22 'A4' 3.801% 15/09/2047	USD	430,000	448,323	0.13
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2015-C30 'A2' 3.087% 15/07/2048	USD	55,000	56,545	0.02
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2015-C30 'A5' 3.822% 15/07/2048	USD	555,000	578,012	0.17
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2015-CB1 'A3' 3.801% 15/06/2048	USD	190,000	197,590	0.06
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2016-C2 'A1' 1.423% 15/06/2049	USD	283,816	281,046	0.08
Kaiser Foundation Hospitals, Inc. 3.5% 01/04/2022	USD	250,000	257,765	0.08
Kubota Credit Owner Trust, Series 2015-1A 'A3', 144A 1.54% 15/03/2019	USD	585,000	585,839	0.17
Kubota Credit Owner Trust, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.5% 15/07/2020	USD	120,000	118,840	0.04
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.85% 01/08/2044	USD	485,000	477,968	0.14
Los Angeles Community College District 6.75% 01/08/2049	USD	150,000	215,130	0.06
Maryland State Transportation Authority 5.754% 01/07/2041	USD	85,000	103,180	0.03
Maryland State Transportation Authority 5.888% 01/07/2043	USD	165,000	204,288	0.06
Mercedes Benz Auto Lease Trust, Series 2015-A 'A4' 1.21% 15/10/2020	USD	150,000	150,014	0.04
Mercedes-Benz Auto Lease Trust, Series 2016-B 'A3' 1.35% 15/06/2019	USD	225,000	224,419	0.07
Merrill Lynch Mortgage Trust, Series 2008-C1 'A4' 5.69% 12/02/2051	USD	68,202	69,564	0.02
Metropolitan Transportation Authority 7.336% 15/11/2039	USD	80,000	116,025	0.03
Mill City Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2016-1 'A1', 144A 2.5% 25/04/2057	USD	154,181	153,755	0.05
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2014-AA 'A4', 144A 1.59% 08/02/2022	USD	110,000	109,606	0.03
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2015-AA 'A4', 144A 1.93% 16/07/2021	USD	100,000	100,136	0.03
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2016-AA 'A4', 144A 1.76% 17/01/2023	USD	335,000	329,947	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 (%)
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015-C24 'A5' 4.036% 15/05/2048	USD	60,000	61,826	0.02
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015-C24 'B' 4.498% 15/05/2048	USD	110,000	114,328	0.03
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015-C24 'C' 4.498% 15/05/2048	USD	80,000	72,888	0.02
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C27 'A4' 3.753% 15/12/2047	USD	1,790,000	1,854,886	0.55
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C27 'A5' 4.068% 15/12/2047	USD	115,000	118,047	0.03
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2016-C30 'A5' 2.86% 15/09/2049	USD	525,000	502,475	0.15
Morgan Stanley Capital I Trust, FRN, Series 2015-M51 'A4' 3.779% 15/05/2048	USD	150,000	155,639	0.05
Morgan Stanley Capital I Trust, FRN, Series 2015-M51 'A5' 4.164% 15/05/2048	USD	20,000	20,727	0.01
MortgageIT Trust, FRN, Series 2005-2 '1M1' 1.416% 25/05/2035	USD	264,130	251,332	0.07
MWV Owner Trust, Series 2013-1A 'A', 144A 2.15% 22/04/2030	USD	550,921	545,821	0.16
MWV Owner Trust, Series 2014-1A 'A', 144A 2.25% 22/09/2031	USD	54,812	54,148	0.02
Nationstar HECM Loan Trust, Series 2016-1A 'A', 144A 2.981% 25/02/2026	USD	55,228	55,213	0.02
New York City Transitional Finance Authority 5.508% 01/08/2037	USD	175,000	210,618	0.06
New York City Water & Sewer System 5.952% 15/06/2042	USD	320,000	411,312	0.12
New York State Dormitory Authority 3.879% 01/07/2046	USD	550,000	510,878	0.15
Nissan Auto Receivables Owner Trust, Series 2016-A 'A4' 1.59% 15/07/2022	USD	110,000	109,342	0.03
Nissan Auto Receivables Owner Trust, Series 2016-C 'A3' 1.18% 15/01/2021	USD	250,000	247,514	0.07
Nissan Master Owner Trust, Series 2015-A 'A2' 1.44% 15/01/2020	USD	185,000	185,040	0.05
North Carolina Eastern Municipal Power Agency 1.561% 01/07/2017	USD	60,000	60,032	0.02
North Carolina Eastern Municipal Power Agency 2.003% 01/07/2018	USD	5,000	5,033	-
O'Reilly Automotive, Inc. 4.875% 14/01/2021	USD	175,000	187,878	0.06
Palcaedes Center Trust, Series 2016-PLSD 'A', 144A 2.713% 13/04/2033	USD	445,000	443,134	0.13
Port Authority of New York and New Jersey 4.458% 01/10/2062	USD	330,000	332,224	0.10
Priceline Group, Inc. (The) 3.65% 15/03/2025	USD	365,000	363,348	0.11
Priceline Group, Inc. (The) 3.6% 01/06/2026	USD	345,000	341,505	0.10
Principal Financial Group, Inc., FRN 4.7% 15/05/2055	USD	620,000	610,564	0.18
QVC, Inc. 3.125% 01/04/2019	USD	335,000	338,516	0.10
QVC, Inc. 5.125% 02/07/2022	USD	55,000	57,260	0.02
QVC, Inc. 4.375% 15/03/2023	USD	225,000	222,775	0.07
QVC, Inc. 4.85% 01/04/2024	USD	320,000	321,333	0.10
QVC, Inc. 4.45% 15/02/2025	USD	525,000	504,028	0.15

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Sabine Pass Liquefaction LLC, 144A 5% 15/03/2027	USD	795,000	804,938	0.24
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15/04/2023	USD	125,000	133,203	0.04
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/05/2024	USD	200,000	214,200	0.06
San Diego County Water Authority Financing Corp. 'B' 6.138% 01/05/2049	USD	70,000	90,913	0.03
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2014-3 'D' 2.65% 17/08/2020	USD	70,000	70,827	0.02
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2015-5 'D' 3.65% 15/12/2021	USD	80,000	82,010	0.02
SBA Tower Trust, 144A 2.933% 15/12/2042	USD	150,000	150,196	0.04
SBA Tower Trust, 144A 2.898% 15/10/2044	USD	175,000	176,354	0.05
SBA Tower Trust, 144A 3.156% 15/10/2045	USD	300,000	302,055	0.09
SBA Tower Trust, 144A 3.869% 15/10/2049	USD	150,000	150,986	0.04
Schlumberger Holdings Corp., 144A 3% 21/12/2020	USD	185,000	188,315	0.06
Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2014-3A 'A', 144A 2.3% 20/10/2031	USD	32,114	32,067	0.01
Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2015-1A 'A', 144A 2.4% 22/03/2032	USD	643,264	640,368	0.19
Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2015-2A 'A', 144A 2.43% 20/06/2032	USD	141,024	140,903	0.04
Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2015-3A 'A', 144A 2.58% 20/09/2032	USD	456,566	454,629	0.13
Sirius XM Radio, Inc., 144A 5.25% 15/08/2022	USD	380,000	398,050	0.12
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-4 'A4' 2.365% 25/07/2022	USD	94,726	95,353	0.03
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-5 'A4' 2.414% 25/07/2023	USD	174,627	175,751	0.05
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-9 'A' 2.215% 25/04/2023	USD	119,176	119,443	0.04
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-A 'A2A', 144A 2.49% 15/06/2027	USD	130,000	128,523	0.04
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-B 'A2A', 144A 2.98% 15/07/2027	USD	150,000	151,653	0.04
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-C 'A2A', 144A 2.75% 15/07/2027	USD	185,000	185,197	0.05
SMB Private Education Loan Trust, Series 2016-A 'A2A', 144A 2.7% 15/05/2031	USD	105,000	104,213	0.03
SMB Private Education Loan Trust, Series 2016-B 'A2A', 144A 2.43% 17/02/2032	USD	955,000	933,938	0.28
SMB Private Education Loan Trust, Series 2016-C 'A2A', 144A 2.34% 15/09/2034	USD	235,000	230,932	0.07
South Carolina State Public Service Authority 'D' 2.388% 01/12/2023	USD	240,000	232,714	0.07
South Carolina State Public Service Authority 'D' 4.77% 01/12/2045	USD	162,000	166,162	0.05
Springleaf Funding Trust, Series 2016AA 'A', 144A 2.9% 15/11/2029	USD	230,000	229,525	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 (%)
State Board of Administration Finance Corp. 2.163% 01/07/2019	USD	110,000	111,133	0.03
State Board of Administration Finance Corp. 2.995% 01/07/2020	USD	365,000	375,388	0.11
State of California 5% 01/08/2028	USD	600,000	715,740	0.21
State of Georgia 5% 01/12/2026	USD	240,000	296,160	0.09
SunTrust Auto Receivables Trust, Series 2015-1A 'A4', 144A 1.78% 15/01/2021	USD	495,000	494,267	0.15
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-2 'A' 2.22% 15/01/2022	USD	300,000	302,294	0.09
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-6 'A' 1.36% 17/09/2020	USD	250,000	250,155	0.07
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-7 'A' 1.76% 15/09/2022	USD	315,000	312,777	0.09
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2013-1 'B' 1.69% 15/03/2021	USD	205,000	204,769	0.06
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2014-1 'C' 1.91% 15/11/2020	USD	135,000	135,172	0.04
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2015-1 'B' 2.64% 15/03/2023	USD	300,000	299,813	0.09
Time Warner Cable LLC 6.55% 01/05/2037	USD	415,000	469,551	0.14
Time Warner Cable LLC 6.75% 15/05/2039	USD	490,000	571,634	0.17
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-3 'A1B', 144A 3% 25/03/2054	USD	144,085	145,622	0.04
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-4 'A1B', 144A 2.75% 25/04/2055	USD	156,117	156,883	0.05
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-5 'A1B', 144A 2.75% 25/05/2055	USD	97,026	97,455	0.03
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-1 'A1B', 144A 2.75% 25/02/2055	USD	149,638	150,288	0.04
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-1 'A3B', 144A 3% 25/02/2055	USD	181,477	182,119	0.05
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-2 'A1A', 144A 2.75% 25/08/2055	USD	270,203	270,180	0.08
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-5 'A1', 144A 2.5% 25/10/2056	USD	980,000	977,391	0.29
Toyota Auto Receivables, Series 2016-C 'A3' 1.14% 17/08/2020	USD	220,000	218,571	0.06
Trinity Acquisition plc 3.5% 15/09/2021	USD	315,000	318,171	0.09
United Airlines Pass Through Trust, Series 2014-2 'B' 4.625% 03/03/2024	USD	397,860	407,309	0.12
University of North Carolina at Chapel Hill 3.847% 01/12/2034	USD	210,000	213,671	0.06
US Airways Pass Through Trust, Series 2012-2 'A' 4.625% 03/12/2026	USD	91,749	97,368	0.03
US Airways Pass Through Trust, Series 2013-1 'A' 3.95% 15/05/2027	USD	104,884	107,647	0.03
US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/01/2026	USD	4,950,000	5,061,548	1.50
Utah Transit Authority 'B' 5.937% 15/06/2039	USD	145,000	180,972	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 (%)
Utility Debt Securitization Authority, Series 2013-T 'T1' 2.042% 15/06/2021	USD	100,000	100,354	0.03
Volvo Financial Equipment LLC, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.67% 18/02/2020	USD	320,000	320,442	0.09
Wabtec Corp., 144A 3.45% 15/11/2026	USD	635,000	608,654	0.18
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FRN, Series 2005- AR8 '3AC2' 1.052% 25/07/2045	USD	295,654	267,281	0.08
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LC20 'C' 4.056% 15/04/2050	USD	105,000	94,297	0.03
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'A5' 3.767% 15/07/2058	USD	180,000	187,274	0.06
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'A3' 4.039% 15/07/2058	USD	35,000	36,619	0.01
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'B' 4.394% 15/07/2058	USD	50,000	50,029	0.01
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-NXS2 'C' 4.394% 15/07/2058	USD	30,000	27,073	0.01
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-G29 'A4' 3.637% 15/06/2048	USD	275,000	283,499	0.08
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-NXS2 'A2' 3.02% 15/07/2058	USD	105,000	107,561	0.03
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GG1 'A4' 3.789% 15/12/2047	USD	165,000	171,443	0.05
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2016-G34 'A4' 3.096% 15/06/2049	USD	800,000	784,360	0.23
Wendys Funding LLC, Series 2015-1A 'A2', 144A 3.371% 15/06/2045	USD	740,625	741,287	0.22
WFRBC Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2014-G22 'A5' 4.069% 15/09/2057	USD	1,000,000	1,042,923	0.31
WFRBC Commercial Mortgage Trust, Series 2013-G18 'A3' 3.651% 15/12/2046	USD	100,000	104,500	0.03
Wheels GPV 2 LLC, Series 2015-1A 'A2', 144A 1.27% 22/04/2024	USD	121,450	121,208	0.04
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2013-A 'A' 1.61% 15/12/2021	USD	1,080,000	1,082,079	0.32
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2015-A 'A3' 1.34% 15/05/2020	USD	179,424	179,575	0.05
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2016-A 'A4' 1.95% 16/05/2022	USD	225,000	224,415	0.07
World Omni Automobile Lease Securitization Trust, Series 2016-A 'A3' 1.45% 15/08/2019	USD	700,000	698,077	0.21
			186,078,472	55.04
債券 計			197,007,783	58.27

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
譲渡性預金				
スイス				
Credit Suisse AG, FRN 1.753% 12/09/2017	USD	810,000	811,118	0.24
			811,118	0.24
譲渡性預金 計				
811,118 0.24				
コマーシャル・ペーパー				
アメリカ				
AXA Financial, Inc. 0% 30/08/2017	USD	680,000	680,000	0.20
Enbridge Energy Partners LP 0% 09/02/2017	USD	885,000	882,979	0.25
Ford Motor Credit Co. 0% 01/09/2017	USD	430,000	424,922	0.13
			1,987,901	0.59
コマーシャル・ペーパー 計				
1,987,901 0.59				
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				
199,806,802 59.10				
有価証券 計				
317,177,781 93.81				

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, 2.50%, 25/01/2029	USD	1,540,000	1,539,759	(3,638)	0.46
United States of America	FNMA, 3.00%, 25/01/2031	USD	1,130,000	1,158,074	(2,820)	0.34
United States of America	FNMA, 3.00%, 25/01/2045	USD	410,000	406,220	4,756	0.12
United States of America	FNMA, 3.50%, 25/01/2046	USD	8,010,000	8,193,980	(2,279)	2.42
United States of America	FNMA, 4.00%, 25/01/2046	USD	320,000	335,950	2,612	0.10
United States of America	FNMA, 4.50%, 25/01/2046	USD	1,285,000	1,380,371	(911)	0.41
T B A取引 (ロングポジション) 計				13,014,354	(2,290)	3.85
T B A取引 計				13,014,354	(2,290)	3.85

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	159,777	USD	167,572	28/02/2017	J.P. Morgan	1,467	-
EUR	3,081,100	USD	3,227,175	31/03/2017	J.P. Morgan	38,255	0.01
USD	1,776,421	EUR	1,663,096	31/01/2017	J.P. Morgan	19,031	-
USD	1,445,189	GBP	1,148,115	31/01/2017	J.P. Morgan	22,203	0.01
為替予約取引にかかる評価益 計						90,956	0.02
EUR	31,228,900	USD	35,178,232	31/01/2017	Citibank	(2,178,720)	(0.64)
EUR	1,770,096	USD	1,967,488	31/01/2017	J.P. Morgan	(97,042)	(0.03)
EUR	187,376	USD	208,165	31/01/2017	Morgan Stanley	(10,166)	-
EUR	32,284,400	USD	35,456,662	28/02/2017	Morgan Stanley	(1,300,806)	(0.38)
EUR	1,542,196	USD	1,666,746	28/02/2017	J.P. Morgan	(35,153)	(0.01)
EUR	33,200,200	USD	35,409,607	31/03/2017	Citibank	(223,174)	(0.07)
EUR	394,126	USD	421,389	31/03/2017	J.P. Morgan	(3,684)	-
GBP	9,039,800	USD	11,237,375	31/01/2017	Barclays	(33,342)	(0.01)
GBP	147,659	USD	188,355	31/01/2017	J.P. Morgan	(5,097)	-
USD	229,118	EUR	219,094	31/01/2017	J.P. Morgan	(2,398)	-
USD	1,668,106	GBP	1,358,110	31/01/2017	J.P. Morgan	(15,150)	(0.01)
為替予約取引にかかる評価損 計						(3,904,732)	(1.15)
為替予約取引にかかる評価(損)益 計						(3,823,776)	(1.13)

オプション取引

契約数	銘柄名	通貨	取引相手先	グローバル・エ クスポートジャー USD	評価 額 USD	純資産 比率 (%)	
65	10 Year US Treasury, Call, 126, 24/02/2017	USD	Goldman Sachs	819,000,000	19,297	0.01	
オプション取引 計						19,297	0.01

先物取引

銘柄名	契約数	通貨	グローバル・ エクスポートジャー USD	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)		
US 10 Year Note, 22/03/2017	(96)	USD	(11,901,000)	56,250	0.01		
US 10 Year Ultra Note, 22/03/2017	(90)	USD	(12,017,813)	63,250	0.02		
先物取引にかかる評価益 計						119,500	0.03
US 2 Year Note, 31/03/2017	146	USD	31,624,969	(40,905)	(0.01)		
US 5 Year Note, 31/03/2017	108	USD	12,690,844	(39,951)	(0.01)		
US Long Bond, 22/03/2017	15	USD	2,247,188	(24,492)	(0.01)		
US Ultra Bond, 22/03/2017	(5)	USD	(795,938)	(5,088)	-		
先物取引にかかる評価損 計						(110,436)	(0.03)
先物取引にかかる評価(損)益 計						9,064	-

現金	21,565,377	6.38
その他資産(負債)	(647,163)	(0.19)
純資産 計	338,095,995	100.00

国別投資比率

	純資産比率 (%)
アメリカ	84.05
イギリス	2.31
オーストラリア	1.43
中国	1.27
メキシコ	0.82
オランダ	0.78
カナダ	0.76
スイス	0.53
イスラエル	0.47
アイルランド	0.39
チリ	0.18
インドネシア	0.18
ベルギー	0.17
スウェーデン	0.10
香港	0.09
スペイン	0.07
バミューダ	0.06
パナマ	0.06
シンガポール	0.06
ルクセンブルグ	0.03
有価証券 計	93.81
現金及びその他資産（負債）	6.19
合計	100.00

ティー・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12月31日現在

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価値の決定において、公認された取引所またはその他の規制市場に上場されている有価証券は、かかる取引所における最新の売買価格または公式な最終価格で評価されている。

未上場の有価証券、上場されているが取引所の最終価格がない有価証券、および最終価格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年未満に償還を迎える短期債については、利息分を修正すれば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、当該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。

() 他通貨建の投資評価額ならびにその他の資産および負債は、当該営業日の実勢為替レート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、当該取引日の実勢為替レートを用いて基準通貨に換算される。

外国為替取引にかかる実現損益は、() 保有外貨の売却に伴う為替差損益、() 証券取引の約定日と決済日間に発生した損益、および() 受取配当金/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、当該証券にかかる外国為替レートの変動による損益を分離して表示しない。

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クラスに関しては、財務諸表上の項目は以下の基準により、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為替レートは次のとおりである。

通貨	2016年12月31日 現在のレート	2016年12月31日に終了した 期間の平均レート
カナダ・ドル	1.3432	NA
スイス・フラン	1.0168	NA
ユーロ	0.9478	0.9034
ノルウェー・クローネ	8.6099	NA
スウェーデン・クローナ	9.0561	NA
日本円	116.74	NA
イギリス・ポンド	0.8075	NA

d) 有価証券取引および収益について

有価証券取引は約定日基準で計上される。実現損益は、売却有価証券の平均取得原価に基づいて算出される。

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、発生基準で計上される。債券の償還差損益は、定額法を用いて損益として認識される。

現預金は、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残高を含んでいる。当該金融機関が預金の払い戻しを履行できない場合には、各ファンドは当該預金の元本の回復の遅滞、および元利金の減価に見舞われる可能性がある。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、公平に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12月31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	1,790,000	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Morgan Stanley	現金	472,595	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	RBS	現金	670,000	-
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	-	1,370,000
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	-	5,520,000
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	-	6,750,000
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	-	1,110,652
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Citibank	現金	-	2,980,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Goldman Sachs	現金	-	53,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	J.P.Morgan	現金	-	300,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	J.P.Morgan	現金	38,000	-
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Merrill Lynch	現金	-	163,000
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Morgan Stanley	現金	-	1,612,129
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	Nomura	現金	-	3,000

2. 投資にかかる取引

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かか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有する。表示された契約額は、これら金融商品に投資している当該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、それぞれ実勢為替予約レートおよび最新の決済価格を用いて日次で評価される。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次で評価される。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次で計上される。実現損益は、デリバティブ契約の終了により計上される。スワップ契約が義務付ける定期的な支払いまたは受取りは、スワップ契約にかかる受取利息または支払利息として日次で計上される。

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格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、または当該契約の取引相手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かか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。

各ファンドは、先物取引の当初証拠金維持、そして将来の追加証拠金に備えて、ブローカーの口座に現金を預けることがある。ブローカーが受け入れた預け金は、貸借対照表の先物証拠金に含まれる。

為替ヘッジ・クラスは、為替ヘッジなしクラスの通貨建ではない当該ヘッジ・クラスの純資産への投資家の為替エクスポージャーの削減を目的とする。2016年12月31日現在、為替予約取引の未実現損益は財務諸表に反映された。為替予約取引の明細は有価証券明細表に開示された。

b) 中国A株

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)に投資する。ファンドは、上海・香港相互接続(株式コネクト)を通じて、あるいは全てのティー・ロウ・プライス商品のために適格外国機関投資家(QFII)として登録済みであるプライス・アソシエイツの完全子会社を通じて、A株市場に投資できる。QFIIを通じて保有するA株に対する投資判断は、各口座固有のものであり、また各口座はA株の所有/取引にて生じる経済的利益を得る。

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、株式コネクトを通じて保有する株式は、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、異なるルートで購入した同一発行体のA株は、同一の評価とは限らない。一般的に、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

いくつかのファンドでは、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、業界の「受渡適格」基準に合致するものでなければならない。

一般的に各ファンドは、原モーゲージ証券を所有する目的でTBA取引を実行する。各ファンドは決済日までTBA決済のための十分な現金、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12月31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	66.00
USアグリゲート・ボンド・ファンド	745.24
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	4.91
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	(87.42)
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	30.81
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	(8.60)

3. 分配金

当社は、実質的に分配可能な純投資収益を表す分配金支払型証券にかかる分配金を公表し支払う意向である。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。分配金は権利落日に計上される。当該ファンドの分配金支払型証券にかかる中間配当については、取締役会が決議した頻度および間隔で、帰属する純投資収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12月31日に終了した期間に支払われた分配金は下記のとおりである。

ファンド名	クラス	通貨	一口当たり 分配金	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	
	Jd	米ドル	0.049539	2016年7月21日	
	Jd	米ドル	0.049818	2016年8月22日	
	Jd	米ドル	0.053649	2016年9月21日	
	Jd	米ドル	0.052812	2016年10月21日	
	Jd	米ドル	0.049426	2016年11月21日	
	Jd	米ドル	0.058541	2016年12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	
Jd		米ドル	0.024112	2016年7月21日	
Jd		米ドル	0.023325	2016年8月22日	
Jd		米ドル	0.024900	2016年9月21日	
Jd		米ドル	0.023028	2016年10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	0.022269	2016年11月21日	
	Jd	米ドル	0.025447	2016年12月21日	
	Jd	米ドル	0.016350	2016年 2月19日	
	Jd	米ドル	0.030053	2016年 5月20日	
	Jd	米ドル	0.048934	2016年8月22日	
	Jd	米ドル	0.022086	2016年11月21日	

4. カストディーフィー

2016年4月30日まで、当社は、カストディーに保管された資産価値に応じて年率0.025%から0.001%に逓減するカストディーフィーを負担した。

2016年5月1日から、当社は、カストディーに保管された資産価値に応じて年率0.017%から0.0005%に逓減するカストディーフィーを負担する。同フィーは日次で算出して積み上げ、月次で支払われる。

5. アドミニ報酬

損益および純資産変動計算書におけるアドミニ報酬は、名義書換代理人報酬およびアドミニフィー等を含む。

当社は、純資産額に応じて年率0.07%から0.01%に逡減するアドミニフィーを負担する。しかし、各ファンドは年間40,000米ドルを下限とするアドミニフィーを負担する。同フィーは日次で算出して積み上げ、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分配金は、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、当社資産にかかる実現益/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12月31日に終了した年度において、当社には関係するルクセンブルグ法に基づき年次税(「Taxe d'Abonnement」)が課せられている。クラスA及びクラスQ投資証券(アドバイザーズクラス)については年率0.05%、クラスI、J、SおよびZ投資証券(インスティテューショナルクラス)については年率0.01%の年次税がそれぞれ課せられた。なお、年次税は、各四半期末における各クラスの純資産額に基づき四半期毎に支払われる。

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。外国法人税はファンドごとに収益の減少として計上される。当該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・ゲイン税を課される。全ての税は、適用される外国税法に従って算出され、キャピタル・ロスは、許容される範囲で、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12月31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12月31日現在、インドの有価証券にかか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かかるキャピタル・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 5,893,857米ドル

キャピタル・ロスは、発生時から8年間繰り越して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、ティー・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。管理会社は運用会社に対して管理会社報酬から支払いを行う。管理会社報酬は月次で支払われ、各ファンドの純資産に応じて以下の料率により日次で算出される。

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・バリュース・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12月31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	0.03	0.03
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	0.04	0.04
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	Jd	0.06	0.06
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	J	0.03	0.03
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	J	0.03	0.03
USラージキャップ・バリュース・エクイティ・ファンド	J	0.03	0.03

* 総経費率は、2016年12月31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) 関係者による保有

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が、ファンドに投資することがある(「関係会社勘定」)。しかし、いかなる関係会社も、各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することは認められない。2016年12月31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の保有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	15%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	12%
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	9%
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	15%

2016年6月6日、プライス・アソシエイツは、DeII社への投資においてUSラージキャップ・バリュエーション・エクイティ・ファンドの逸失利益の賠償を自発的に支払うと申し出をして、当社取締役会は了承した。これは、2013年の議決権行使の不備により、デラウェア州裁判所での買取価格算定の申し立て(「本申し立て」)を遂行するにあたり不適格となった結果生じた。プライス・アソシエイツからの支払いは、2016年6月10日に現金にて受領された。その後、本申し立ての最終確定金額についてDeII社との交渉が行われ、USラージキャップ・バリュエーション・エクイティ・ファンドは、当初の合併対価と交渉での上乗せ分を受領した。交渉での上乗せ分は、成果報酬に基づく弁護士費用を除き、DeII一株当たり0.75米ドルとなり、2016年6月30日に受領され、当初の合併対価は2016年7月7日に受領された。DeII社からの支払金は、財務諸表に正味実現損益として反映されている。プライス・アソシエイツからの支払金は、本申し立ての条件に基づきDeII社からの支払金を差し引くと、1,322,990米ドルとなり、2015年12月31日～2016年12月31日の期間のUSラージキャップ・バリュエーション・エクイティ・ファンドのA、I、J、Q、Q(GBP)各クラスのトータル・リターンを0.19%、0.22%、0.18%、0.26%、0.24% 引き上げた。現在、本件は上訴中であり、裁判所がDeII社株の公正価値を変更する場合、あるいはDeII社株の逸失利益を賠償するためにUSラージキャップ・バリュエーション・エクイティ・ファンドがその他の支払人からの支払いを受領した場合には、プライス・アソシエイツによって支払われた金額は将来増減する可能性がある。

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が負担する費用である。取引費用は、取引に関連した手数料及び税金から構成される。

2016年12月31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	25,980
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	4,895
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	米ドル	1,741,420
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	米ドル	90,684
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	米ドル	384,297
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	米ドル	214,644

確定利付き商品及びデリバティブ(先物を除く)取引に対して別途課された仲介手数料はない。当該取引費用は、取引価格に含まれている。

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成29年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

資産総額	10,322,653,454 円
負債総額	47,029,092 円
純資産総額 (-)	10,275,624,362 円
発行済数量	11,058,413,800 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.9292 円

(参考) 日本好配当株マザーファンド

資産総額	19,645,494,151 円
負債総額	275,889,246 円
純資産総額 (-)	19,369,604,905 円
発行済数量	10,308,788,836 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.8789 円

(参考) 世界REITマザーファンド

資産総額	1,526,293,483 円
負債総額	747 円
純資産総額 (-)	1,526,292,736 円
発行済数量	1,374,522,046 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.1104 円

(参考) グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	70,833,083,149 円
負債総額	62,974,615 円
純資産総額 (-)	70,770,108,534 円
発行済数量	34,975,952,214 口
1 単位当り純資産額 (/)	2.0234 円

(参考) 新興国債券マザーファンド

資産総額	9,620,325,190 円
負債総額	24,995,968 円
純資産総額 (-)	9,595,329,222 円
発行済数量	4,069,324,860 口
1 単位当り純資産額 (/)	2.3580 円

(参考) 欧州債券マザーファンド

資産総額	1,039,830,781 円
負債総額	14,276,723 円
純資産総額 (-)	1,025,554,058 円
発行済数量	743,375,258 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.3796 円

(参考) アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	981,417,528 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	981,417,528 円
発行済数量	710,596,461 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.3811 円

(参考) コモディティ・マザーファンド

資産総額	532,009,152 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	532,009,152 円
発行済数量	988,899,727 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.5380 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29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。

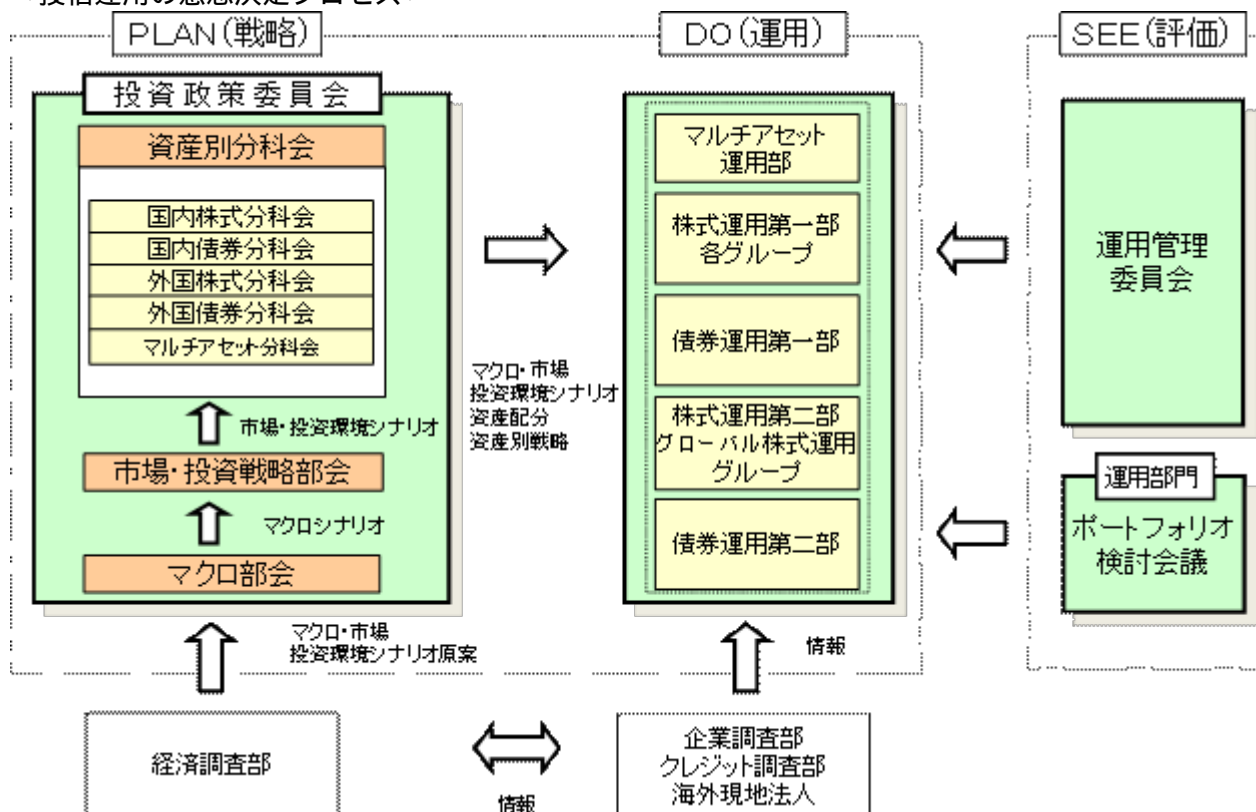
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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29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、407本であり、その純資産総額は、約3,391,801百万円です（なお、親投資信託135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	32	83,522百万円
追加型株式投資信託	294	2,956,683百万円
単位型公社債投資信託	81	351,595百万円
合計	407	3,391,801百万円

[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45期事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表について、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44期 (平成28年3月31日)	第45期 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	22,725,768	21,770,643
前払費用	195,917	206,930
未収入金	-	7,453
未収委託者報酬	3,678,543	3,291,565
未収運用受託報酬	957,351	912,489
未収収益	12,713	50,722
繰延税金資産	644,694	447,651
その他	824	428
流動資産計	28,215,813	26,687,885
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 110,648	110,298
器具備品	1 80,498	66,464
土地	710	710
リース資産	1 10,102	10,562
有形固定資産計	201,959	188,035
無形固定資産		
ソフトウェア	95,535	96,732
電話加入権	12,706	12,706
無形固定資産計	108,242	109,439
投資その他の資産		
投資有価証券	5,480,557	6,783,747
関係会社株式	956,115	956,115
従業員長期貸付金	2,428	1,546
長期差入保証金	511,355	511,637
出資金	82,660	82,660
繰延税金資産	556,611	523,217
その他	1,567	192
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産計	7,570,543	8,838,366
固定資産計	7,880,745	9,135,840
資産合計	36,096,558	35,823,726

(単位：千円)

	第44期 (平成28年3月31日)	第45期 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,565	3,524
未払金	85,383	61,012
未払手数料	1,620,526	1,419,878
未払費用	1,178,517	1,150,008
未払法人税等	1,923,850	459,723
未払消費税等	323,266	26,700
賞与引当金	1,498,000	1,251,100
役員賞与引当金	101,000	82,900
業務委託関連引当金	25,700	-
その他	20,860	46,283
流動負債計	6,780,670	4,501,131
固定負債		
リース債務	7,280	7,841
退職給付引当金	1,546,322	1,482,500
役員退職慰労引当金	100,350	93,560
固定負債計	1,653,953	1,583,902
負債合計	8,434,623	6,085,034

(単位：千円)

	第44期 (平成28年3月31日)	第45期 (平成29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	24,034,752	26,100,773
利益剰余金合計	25,478,483	27,544,504
株主資本合計	27,634,752	29,700,773
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	27,182	37,917
評価・換算差額等合計	27,182	37,917
純資産合計	27,661,934	29,738,691
負債純資産合計	36,096,558	35,823,726

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	4,608,029	4,371,647
委託者報酬	33,183,045	28,124,470
その他営業収益	45,653	64,558
営業収益計	37,836,728	32,560,677
営業費用		
支払手数料	15,893,270	13,056,474
広告宣伝費	168,848	169,346
公告費	1,028	2,915
調査費		
調査費	1,315,033	1,331,709
委託調査費	3,914,869	3,213,013
委託計算費	193,638	137,135
営業雑経費		
通信費	31,664	39,943
印刷費	523,643	501,370
協会費	23,203	24,788
諸会費	2,545	2,492
その他	63,792	109,609
営業費用計	22,131,536	18,588,799
一般管理費		
給料		
役員報酬	191,952	209,010

給料・手当	2,916,345	2,852,929
賞与	108,042	129,064
退職金	7,113	32,873
福利厚生費	683,822	639,080
交際費	19,339	22,638
旅費交通費	165,319	142,966
租税公課	136,339	174,826
不動産賃借料	635,313	620,232
退職給付費用	226,884	217,625
固定資産減価償却費	55,907	57,699
賞与引当金繰入額	1,498,000	1,251,100
役員退職慰労引当金繰入額	37,270	38,169
役員賞与引当金繰入額	101,100	80,300
諸経費	279,901	564,747
一般管理費計	7,062,654	7,033,264
営業利益	8,642,537	6,938,613
営業外収益		
受取配当金	17,230	4,517
受取利息	4,001	675
投資有価証券売却益	62,103	6,051
業務委託関連引当金戻入	-	4,000
為替差益	106	123
その他	13,069	5,690
営業外収益計	96,510	21,058
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,968	21,990
その他	-	113
営業外費用計	5,968	22,103
経常利益	8,733,078	6,937,568
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	4,215	-
特別損失計	243,574	-
税引前当期純利益	8,489,504	6,937,568
法人税、住民税及び事業税	3,016,713	1,881,549
法人税等調整額	56,198	225,697
法人税等合計	2,960,515	2,107,247

当期純利益

5,528,988

4,830,321

(3) 株主資本等変動計算書

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	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	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

第45期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	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	24,034,752
当期変動額						
剰余金の配当						2,764,300
当期純利益						4,830,321
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,066,021
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773

	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	25,478,483	27,634,752	27,182	27,182	27,661,934
当期変動額					
剰余金の配当	2,764,300	2,764,300			2,764,300
当期純利益	4,830,321	4,830,321			4,830,321
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			10,735	10,735	10,735
当期変動額合計	2,066,021	2,066,021	10,735	10,735	2,076,757
当期末残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691

[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。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>15～30年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <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>	建物	15～30年	器具備品	4～15年
建物	15～30年			
器具備品	4～15年			
<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>				

会計方針の変更

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当事業年度より適用し、平成28年4月1日以後に取得する建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。なお、この変更による財務諸表への影響額はありません。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当事業年度より適用しております。

(貸借対照表関係)

第44期 (平成28年3月31日)		第45期 (平成29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	438,341千円	建物	454,117千円
器具備品	272,516千円	器具備品	272,531千円
リース資産	13,775千円	リース資産	10,688千円
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	2,945千円	金額	940千円

(株主資本等変動計算書関係)

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

第45期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1.発行済株式に関する事項

(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28年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,764,300	718	平成28年3月31日	平成28年6月24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29年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,413,950	利益 剰余金	627	平成29年3月31日	平成29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。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与であり、1年以内の債権であります。

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、及び業務委託関連費用であります。

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) 未収入金	-	-	-
(5) 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。

第45期(平成29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	21,770,643	21,770,643	-
(2) 未収委託者報酬	3,291,565	3,291,565	-
(3) 未収運用受託報酬	912,489	912,489	-
(4) 未収入金	7,453	7,453	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	6,732,611	6,732,611	-
資産計	32,714,763	32,714,763	-
(1) 未払手数料	1,419,878	1,419,878	-
(2) 未払費用(*1)	891,704	891,704	-
負債計	2,311,583	2,311,583	-

(*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、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収入金

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

(5) 投資有価証券

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44期(平成28年3月31日)	第45期(平成29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	956,115	956,115

(3) 長期差入保証金	511,355	511,637
-------------	---------	---------

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. (5) 投資有価証券には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

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	-	-	-
未収入金	-	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	-	2,106,635	236,275	-
合計	27,361,663	2,106,635	236,275	-

第45期(平成29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	21,770,643	-	-	-
未収委託者報酬	3,291,565	-	-	-
未収運用受託報酬	912,489	-	-	-
未収入金	7,453	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期のあるもの	-	2,222,381	467,133	-
合計	25,982,151	2,222,381	467,133	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

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。

第45期(平成29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。

第45期（平成29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	3,882,464	3,705,555	176,909
小計	3,882,464	3,705,555	176,909
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	2,850,146	2,972,404	122,257
小計	2,850,146	2,972,404	122,257
合計	6,732,611	6,677,959	54,652

(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

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	1,105,918	6,051	21,990

4. 減損処理を行った有価証券

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。

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

（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44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,459,244	1,546,322
退職給付費用	162,311	149,442
退職給付の支払額	75,233	213,264
退職給付引当金の期末残高	1,546,322	1,482,500

(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44期 (平成28年3月31日)	第45期 (平成29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	1,546,322	1,482,500
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,546,322	1,482,500
退職給付引当金	1,546,322	1,482,500
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,546,322	1,482,500

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第44期 162,311千円 第45期 149,442千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第44期は64,573千円、第45期は68,183千円であります。

(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44期 (平成28年3月31日)	第45期 (平成29年3月31日)
(1) 流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	119,355	12,099
賞与引当金	462,282	386,089
社会保険料	31,640	29,075
未払事業所税	4,486	4,693
その他	26,929	21,191
繰延税金資産合計	644,694	453,148
繰延税金負債		
その他	-	5,496
繰延税金負債合計	-	5,496
繰延税金資産の純額	664,694	447,651

(2) 固定資産

繰延税金資産

退職給付引当金	473,920	454,152
投資有価証券	67,546	67,546

ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	30,899	28,748
その他	63,787	57,051
繰延税金資産小計	647,154	618,499
評価性引当額	78,546	78,546
繰延税金資産合計	568,607	539,952
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	11,996	16,734
繰延税金負債合計	11,996	16,734
繰延税金資産の純額	556,611	523,217

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44期 (平成28年3月31日)	第45期 (平成29年3月31日)
法定実効税率	33.10%	-
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.47%	-
住民税均等割等	0.04%	-
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.95%	-
特定外国子会社等留保課税	0.31%	-
税額控除	0.46%	-
その他	0.46%	-
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.87%	-

(注) 第45期は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下にあたるため注記を省略しております。

(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。

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（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	28,124,470	4,371,647	64,558	32,560,677

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。

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	4,766,199	未払手数料	406,661
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	2,372,960	未払手数料	377,341

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44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	7,184円92銭	7,724円34銭
1株当たり当期純利益金額	1,436円10銭	1,254円63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44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(千円)	5,528,988	4,830,321
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)	5,528,988	4,830,321
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29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29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29年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。

以上

独立監査人の監査報告書

平成29年11月2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3月28日から前年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前年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29年6月9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28年4月1日から平成29年3月31日までの第45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29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。