

## 【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30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30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】**

## 第一部【証券情報】

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(4)発行(売出)価格

(以下略)

大和住銀投信投資顧問株式会社

<インターネットホームページ> <http://www.daiwasbi.co.jp/>

<お電話によるお問い合わせ先> 受付窓口：(電話番号) 0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで(土、日、祝日除く。)

(以下略)

(8)申込取扱場所

(以下略)

大和住銀投信投資顧問株式会社

<インターネットホームページ> <http://www.daiwasbi.co.jp/>

<お電話によるお問い合わせ先> 受付窓口：(電話番号) 0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで(土、日、祝日除く。)

(以下略)

<訂正後>

(4)発行(売出)価格

(以下略)

大和住銀投信投資顧問株式会社

<インターネットホームページ> <https://www.daiwasbi.co.jp/>

<お電話によるお問い合わせ先> 受付窓口：(電話番号) 0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで(土、日、祝日除く。)

(以下略)

(8)申込取扱場所

(以下略)

大和住銀投信投資顧問株式会社

<インターネットホームページ> <https://www.daiwasbi.co.jp/>

<お電話によるお問い合わせ先> 受付窓口：(電話番号) 0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで(土、日、祝日除く。)

(以下略)

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

#### (1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの基本的性格

(以下略)

<商品分類表>

(以下略)

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

<属性区分表>

(以下略)

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

(以下略)

#### (3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（2018年4月末現在）

(以下略)

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社大和証券グループ 本社	東京都千代田区丸の内1-9-1 グラントウキョウ ノースタワー	1,692,500	44.0
株式会社三井住友フィナン シャルグループ	東京都千代田区丸の内1-1-2	1,692,500	44.0
<u>ティー・アール・ピー・ エイチ・コーポレーション</u>	<u>アメリカ合衆国21202,メリーランド州 ボルチモア イースト プラットスト リート100</u>	385,000	10.0

[次へ](#)

<訂正後>

(1)ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの基本的性格

(以下略)

<商品分類表>

(以下略)

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

<属性区分表>

(以下略)

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

(以下略)

(3)ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（2018年10月末現在）

(以下略)

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社大和証券グループ 本社	東京都千代田区丸の内1-9-1 グラントウキョウ ノースタワー	1,885,000	48.96
株式会社三井住友フィナン シャルグループ	東京都千代田区丸の内1-1-2	1,885,000	48.96
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内1-4-1	80,000	2.08

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、2018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、2018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、2018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、2018年10月末現在で約100名です。

（以下略）

[次へ](#)

## 3 投資リスク

## &lt; リスクの管理体制 &gt;

下線部は訂正部分を示します。

## &lt; 訂正前 &gt;

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。

(以下略)

## &lt; 訂正後 &gt;

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 (5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 (7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 (18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。

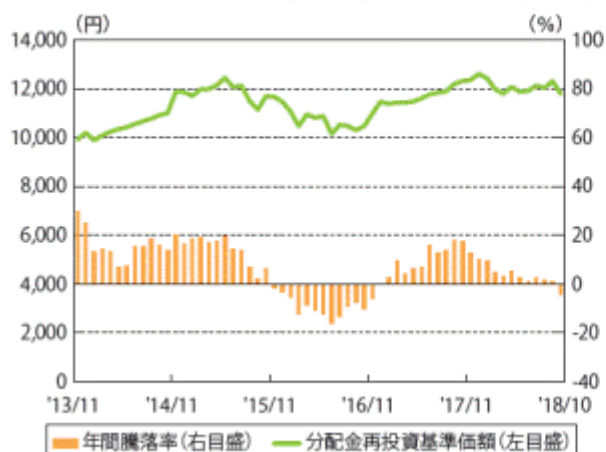
(以下略)

## &lt;参考情報&gt;

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

(2013年11月~2018年10月)

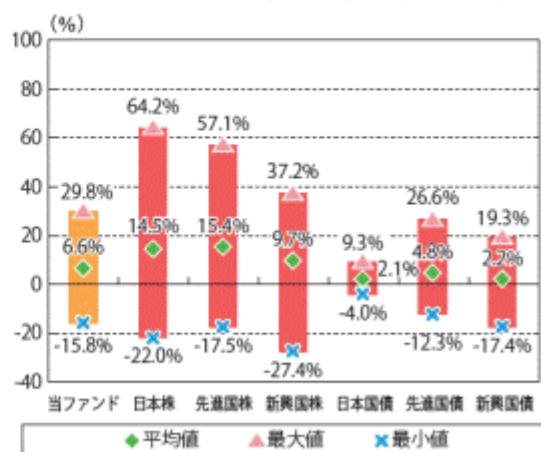


※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※年間騰落率および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したもものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2013年11月~2018年10月)



※上記グラフは、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものであり、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したもものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数について&gt;

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	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	FTSE Fixed Income 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。

[前へ](#) [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2018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2018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30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	1,269,210,726	15.02%
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	1,239,189,891	14.66%
親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド）	日本	859,497,744	10.17%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	847,078,766	10.02%
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	834,952,832	9.88%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	826,569,032	9.78%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	405,506,729	4.80%
投資証券	ルクセンブルグ	2,034,808,927	24.08%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		134,948,258	1.60%
純資産総額		8,451,762,905	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。

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成30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 -	1,128,588,588	1.1618 1,311,307,080	1.1246 1,269,210,726	- -	15.02%
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 -	642,400,151	2.0907 1,343,130,235	1.9290 1,239,189,891	- -	14.66%
3	新興国債券マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	376,361,932	2.3063 868,041,159	2.2837 859,497,744	- -	10.17%
4	T.Rowe Price Funds SICAV- U.S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	727,043	1,182 859,663,330	1,176 855,564,149	- -	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 -	634,896,392	1.3835 878,442,647	1.3342 847,078,766	- -	10.02%
6	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 -	615,338,516	1.3692 842,583,029	1.3569 834,952,832	- -	9.88%
7	T.Rowe Price Funds SICAV- Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	780,579	1,088 849,560,411	1,065 831,923,280	- -	9.84%
8	日本好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	470,149,043	1.9132 899,536,163	1.7581 826,569,032	- -	9.78%
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 -	763,522,368	0.5337 407,568,240	0.5311 405,506,729	- -	4.80%
10	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	379,998	1,018 386,917,008	914 347,321,497	- -	4.11%

（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	74.33%
投資証券	24.08%
合計	98.40%

（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30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30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
第20特定期間末 （平成29年3月27日）	10,697	10,813	0.8585	0.8675
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10月末日	10,275	-	0.9292	-
平成29年11月末日	10,090	-	0.9295	-
平成29年12月末日	10,127	-	0.9482	-
平成30年1月末日	9,803	-	0.9318	-
平成30年2月末日	9,303	-	0.8978	-
第22特定期間末 （平成30年3月27日）	8,991	9,086	0.8749	0.8839
平成30年3月末日	9,060	-	0.8815	-
平成30年4月末日	9,202	-	0.9022	-
平成30年5月末日	8,922	-	0.8845	-
平成30年6月末日	8,872	-	0.8866	-
平成30年7月末日	8,932	-	0.8999	-
平成30年8月末日	8,769	-	0.8931	-
第23特定期間末 （平成30年9月27日）	8,846	8,935	0.9061	0.9151
平成30年9月末日	8,895	-	0.9105	-
平成30年10月末日	8,451	-	0.8722	-

（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
第22特定期間(平成29年9月28日～平成30年3月27日)	0.0090
第23特定期間(平成30年3月28日～平成30年9月27日)	0.0090

## 収益率の推移

期間	収益率
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%
第22特定期間(平成29年9月28日～平成30年3月27日)	3.7%
第23特定期間(平成30年3月28日～平成30年9月27日)	4.6%

(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
第22特定期間(平成29年9月28日～平成30年3月27日)	40,192,669	1,049,526,337
第23特定期間(平成30年3月28日～平成30年9月27日)	31,101,061	544,156,608

(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30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	14,286,208,060	93.96%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		918,841,561	6.04%
純資産総額		15,205,049,621	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30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	787,680,000	5.18%

（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30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	1,095,500	724.30 793,470,650	684.80 750,198,400	- -	4.93%
2	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	135,100	4,986.00 673,608,600	4,750.00 641,725,000	- -	4.22%
3	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	93,300	6,786.00 633,133,800	6,615.00 617,179,500	- -	4.06%
4	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	97,700	5,555.00 542,723,500	5,346.00 522,304,200	- -	3.44%
5	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	139,000	2,918.00 405,602,000	2,906.50 404,003,500	- -	2.66%
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	120,200	3,627.00 435,965,400	3,180.00 382,236,000	- -	2.51%
7	JXTGホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	459,800	847.50 389,680,500	769.20 353,678,160	- -	2.33%
8	西日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	41,800	7,739.00 323,490,200	7,577.00 316,718,600	- -	2.08%
9	三井物産 日本	株式 卸売業	166,700	2,076.00 346,069,200	1,885.50 314,312,850	- -	2.07%
10	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	95,000	3,223.00 306,185,000	3,241.00 307,895,000	- -	2.02%
11	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	55,600	5,681.00 315,863,600	5,408.00 300,684,800	- -	1.98%
12	日本郵政 日本	株式 サービス業	211,200	1,356.03 286,394,824	1,340.00 283,008,000	- -	1.86%
13	小松製作所 日本	株式 機械	83,900	3,371.24 282,847,093	2,944.50 247,043,550	- -	1.62%
14	オリックス 日本	株式 その他金融業	128,600	1,836.00 236,109,600	1,841.00 236,752,600	- -	1.56%
15	三井住友トラスト・ホールディングス 日本	株式 銀行業	47,800	4,659.00 222,700,200	4,494.00 214,813,200	- -	1.41%
16	丸井グループ 日本	株式 小売業	85,400	2,455.00 209,657,000	2,430.00 207,522,000	- -	1.36%
17	三和ホールディングス 日本	株式 金属製品	146,900	1,309.00 192,292,100	1,325.00 194,642,500	- -	1.28%
18	住友商事 日本	株式 卸売業	110,200	1,904.50 209,875,900	1,713.50 188,827,700	- -	1.24%
19	ジェイ エフ イー ホールディングス 日本	株式 鉄鋼	87,900	2,555.49 224,627,809	2,131.00 187,314,900	- -	1.23%
20	協和エクシオ 日本	株式 建設業	59,200	3,305.00 195,656,000	3,040.00 179,968,000	- -	1.18%
21	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	40,900	4,286.46 175,316,385	4,363.00 178,446,700	- -	1.17%

22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	80,400	2,241.50 180,216,600	2,095.00 168,438,000	- -	1.11% -
23	第一生命ホールディングス 日本	株式 保険業	77,700	2,406.00 186,946,200	2,136.00 165,967,200	- -	1.09% -
24	アズビル 日本	株式 電気機器	76,800	2,307.00 177,177,600	2,102.00 161,433,600	- -	1.06% -
25	出光興産 日本	株式 石油・石炭製品	31,300	6,160.00 192,808,000	5,150.00 161,195,000	- -	1.06% -
26	新明和工業 日本	株式 輸送用機器	116,000	1,505.00 174,580,000	1,388.00 161,008,000	- -	1.06% -
27	センコーグループホールディングス 日本	株式 陸運業	180,000	894.00 160,920,000	875.00 157,500,000	- -	1.04% -
28	トレンドマイクロ 日本	株式 情報・通信業	23,500	6,800.00 159,800,000	6,520.00 153,220,000	- -	1.01% -
29	新興プランテック 日本	株式 建設業	144,000	1,087.00 156,528,000	1,051.00 151,344,000	- -	1.00% -
30	コーエーテクモホールディングス 日本	株式 情報・通信業	83,400	1,942.00 161,962,800	1,789.00 149,202,600	- -	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	93.96%
合計	93.96%

(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)	
卸売業	9.49%
情報・通信業	8.86%
輸送用機器	8.78%
銀行業	8.21%
サービス業	5.99%
保険業	5.44%
建設業	5.24%
化学	4.18%
小売業	3.88%
医薬品	3.41%
石油・石炭製品	3.39%
その他金融業	3.15%
陸運業	3.12%
機械	2.68%
食料品	2.66%
その他製品	2.30%
電気機器	2.28%
ガラス・土石製品	2.24%
電気・ガス業	2.00%
不動産業	1.31%
金属製品	1.28%
鉄鋼	1.23%
ゴム製品	1.17%
非鉄金属	0.86%
空運業	0.59%
倉庫・運輸関連業	0.21%
小計	93.96%
合計	93.96%

(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30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30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 3012月	先物 買建	48	845,520,000	787,680,000	5.18%
--------	----	----------------	----------	----	-------------	-------------	-------

（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30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	448,476,463	35.33%
	日本	167,471,200	13.19%
	オーストラリア	153,800,271	12.12%
	イギリス	152,646,266	12.03%
	フランス	60,678,060	4.78%
	アイルランド	49,569,143	3.91%
	スペイン	49,326,979	3.89%
	シンガポール	47,389,077	3.73%
	ベルギー	38,100,557	3.00%
	香港	29,151,472	2.30%
	カナダ	18,920,909	1.49%
	オランダ	16,068,551	1.27%
	ドイツ	15,948,266	1.26%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		21,676,473	1.71%
純資産総額		1,269,223,687	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30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 -	62,947	840 52,935,384	887 55,852,079	- -	4.40%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	2,562	17,365 44,489,189	21,264 54,479,815	- -	4.29%
3	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI スペイン	投資証券 -	43,374	1,153 50,033,876	1,137 49,326,979	- -	3.89%
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券 -	204	227,100 46,328,400	227,600 46,430,400	- -	3.66%
5	TRITAX BIG BOX REIT PLC イギリス	投資証券 -	211,221	201 42,552,582	206 43,586,001	- -	3.43%
6	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券 -	60	642,000 38,520,000	699,000 41,940,000	- -	3.30%
7	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券 -	5,458	7,193 39,261,841	7,432 40,564,517	- -	3.20%
8	INGENIA COMMUNITIES GROUP オーストラリア	投資証券 -	167,863	224 37,714,115	232 39,061,048	- -	3.08%
9	WAREHOUSES DE PAUW SCA ベルギー	投資証券 -	2,630	15,039 39,554,516	14,486 38,100,557	- -	3.00%
10	GECINA SA フランス	投資証券 -	2,203	17,954 39,553,794	16,657 36,696,188	- -	2.89%
11	福岡リート投資法人 日本	投資証券 -	200	164,300 32,860,000	170,500 34,100,000	- -	2.69%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券 -	99,748	306 30,574,437	320 32,015,118	- -	2.52%
13	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	76,537	371 28,434,352	416 31,873,496	- -	2.51%
14	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST シンガポール	投資証券 -	209,200	160 33,605,053	152 31,813,797	- -	2.51%
15	CROWN CASTLE INTL CORP アメリカ	投資証券 -	2,500	12,609 31,523,089	12,404 31,010,588	- -	2.44%
16	DOUGLAS EMMETT INC アメリカ	投資証券 -	7,200	4,212 30,330,828	4,103 29,544,550	- -	2.33%
17	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	3,948	6,680 26,372,935	7,450 29,413,558	- -	2.32%
18	LINK REIT 香港	投資証券 -	28,000	973 27,251,168	1,041 29,151,472	- -	2.30%
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券 -	1,999	13,716 27,420,120	14,038 28,063,115	- -	2.21%

20	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	155,625	174 27,097,549	178 27,721,917	-	2.18%
21	GREEN REIT PLC アイルランド	投資証券 -	133,353	204 27,282,553	188 25,175,992	-	1.98%
22	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A アメリカ	投資証券 -	8,253	2,872 23,704,874	3,029 25,004,155	-	1.97%
23	HIBERNIA REIT PLC アイルランド	投資証券 -	136,153	198 27,080,103	179 24,393,150	-	1.92%
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券 -	184	111,800 20,571,200	124,500 22,908,000	-	1.80%
25	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券 -	128	164,400 21,043,200	172,600 22,092,800	-	1.74%
26	AMERICAN HOMES 4 RENT-D アメリカ	投資証券 -	7,289	2,831 20,638,803	2,704 19,714,185	-	1.55%
27	MACERICH CO/THE アメリカ	投資証券 -	3,346	6,550 21,919,506	5,875 19,660,857	-	1.55%
28	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券 -	7,882	2,113 16,658,067	2,436 19,202,306	-	1.51%
29	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券 -	7,016	2,515 17,648,780	2,504 17,569,317	-	1.38%
30	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券 -	2,208	6,412 14,159,420	7,349 16,227,566	-	1.28%

（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	98.29%
合計	98.29%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

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30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30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30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	18,634,329,186	32.83%
	日本	5,366,677,300	9.45%
	スイス	4,887,479,617	8.61%
	ケイマン諸島	4,503,674,849	7.93%
	イギリス	3,894,411,861	6.86%
	フランス	3,220,387,387	5.67%
	香港	2,114,582,048	3.73%
	ドイツ	1,953,359,616	3.44%
	オーストラリア	1,869,450,485	3.29%
	フィンランド	1,690,084,910	2.98%
	台湾	1,389,245,279	2.45%
	シンガポール	1,043,468,112	1.84%
	ノルウェー	960,259,820	1.69%
	パナマ	642,254,828	1.13%
	バミューダ	640,628,867	1.13%
	イタリア	615,500,775	1.08%
	韓国	559,455,665	0.99%
	スペイン	487,703,934	0.86%
	オランダ	365,809,737	0.64%
カナダ	363,351,720	0.64%	
投資証券	オーストラリア	365,613,993	0.64%
	イギリス	302,529,511	0.53%
	フランス	234,868,931	0.41%
	シンガポール	202,356,000	0.36%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		459,009,682	0.81%
純資産総額		56,766,494,113	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30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	NEXTERA ENERGY INC アメリカ	株式 公益事業	76,250	19,289 1,470,809,933	19,656 1,498,790,816	- -	2.64%
2	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	90,300	14,242 1,286,068,176	15,941 1,439,503,453	- -	2.54%
3	CONOCOPHILLIPS アメリカ	株式 エネルギー	180,070	7,888 1,420,492,819	7,873 1,417,841,504	- -	2.50%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC 台湾	株式 半導体・半導体 製造装置	1,702,131	794 1,351,866,482	816 1,389,245,279	- -	2.45%
5	AMERICAN WATER WORKS CO INC アメリカ	株式 公益事業	122,900	10,021 1,231,610,985	10,213 1,255,274,397	- -	2.21%
6	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD ケイマン諸島	株式 耐久消費財・ア パレル	2,700,000	575 1,553,671,800	444 1,200,830,400	- -	2.12%
7	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL ケイマン諸島	株式 消費者サービス	24,860,000	67 1,675,494,733	47 1,170,269,584	- -	2.06%
8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	96,380	11,785 1,135,918,835	12,084 1,164,737,071	- -	2.05%
9	BHP BILLITON LIMITED オーストラリア	株式 素材	435,240	2,659 1,157,719,249	2,585 1,125,240,247	- -	1.98%
10	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	95,000	11,457 1,088,451,252	11,748 1,116,103,681	- -	1.97%
11	TOTAL SA フランス	株式 エネルギー	170,000	6,846 1,163,922,561	6,516 1,107,811,494	- -	1.95%
12	GIVAUDAN-REG スイス	株式 素材	4,100	261,526 1,072,260,126	268,397 1,100,428,889	- -	1.94%
13	MCDONALD'S CORP アメリカ	株式 消費者サービス	53,100	18,055 958,768,778	20,215 1,073,457,779	- -	1.89%
14	SANDS CHINA LTD ケイマン諸島	株式 消費者サービス	2,320,000	568 1,318,256,480	437 1,015,074,240	- -	1.79%
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 小売	50,720	22,026 1,117,199,539	19,960 1,012,418,998	- -	1.78%
16	TEXAS INSTRUMENTS INC アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	95,200	13,037 1,241,211,528	10,532 1,002,650,912	- -	1.77%
17	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	350,000	2,842.00 994,700,000	2,844.50 995,575,000	- -	1.75%
18	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 食品・飲料・タバ コ	197,000	5,617 1,106,575,890	4,961 977,449,384	- -	1.72%
19	TELENOR ASA ノルウェー	株式 電気通信サービ ス	458,200	2,352 1,078,056,625	2,095 960,259,820	- -	1.69%
20	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	111,900	7,484 837,486,344	8,549 956,644,178	- -	1.69%
21	アズビル 日本	株式 電気機器	440,000	2,370.00 1,042,800,000	2,102.00 924,880,000	- -	1.63%
22	RAYTHEON COMPANY アメリカ	株式 資本財	46,000	21,923 1,008,491,957	19,609 902,052,474	- -	1.59%
23	ACCOR SA フランス	株式 消費者サービス	171,000	5,514 943,028,098	5,150 880,657,353	- -	1.55%
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	32,500	25,217 819,580,352	27,053 879,246,095	- -	1.55%
25	NOVARTIS AG-REG	株式	89,490	8,613	9,796	-	1.54%

	スイス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		770,861,705	876,693,921	-	
26	SAMPO OYJ-A SHS フィンランド	株式 保険	167,470	5,406 905,494,045	5,150 862,477,701	-	1.52%
27	NORTHERN TRUST CORP アメリカ	株式 各種金融	81,500	11,629 947,807,249	10,465 852,915,756	-	1.50%
28	ディスコ 日本	株式 機械	47,000	19,180.00 901,460,000	17,970.00 844,590,000	-	1.49%
29	KONE OYJ-B フィンランド	株式 資本財	151,660	5,561 843,384,141	5,456 827,607,209	-	1.46%
30	L'OREAL フランス	株式 家庭用品・パーソナル用品	33,600	26,430 888,078,038	23,939 804,362,227	-	1.42%

（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	97.24%
投資証券	1.95%
合計	99.19%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種別	投資比率
（国内）	
機械	2.78%
情報・通信業	1.75%
電気機器	1.63%
建設業	1.40%
その他製品	0.95%
その他金融業	0.93%
小計	9.45%
（海外）	
消費者サービス	8.42%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.31%
銀行	6.12%
電気通信サービス	6.12%
公益事業	5.98%
半導体・半導体製造装置	5.90%
エネルギー	5.69%
資本財	5.18%
保険	4.59%
食品・飲料・タバコ	4.44%
不動産	4.40%
素材	3.92%
各種金融	3.81%
小売	2.76%
家庭用品・パーソナル用品	2.64%
耐久消費財・アパレル	2.12%
ソフトウェア・サービス	1.97%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.80%
ヘルスケア機器・サービス	1.39%
食品・生活必需品小売り	1.21%
運輸	1.08%
商業・専門サービス	0.94%
小計	87.79%
合計	97.24%

（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30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30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30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	トルコ	666,596,175	6.44%
	アルゼンチン	598,857,298	5.78%
	セルビア	490,017,124	4.73%
	コロンビア	477,521,828	4.61%
	スリランカ	372,284,445	3.59%
	南アフリカ	350,338,251	3.38%
	ブラジル	326,673,873	3.15%
	ウクライナ	304,117,937	2.94%
	ガーナ	303,982,647	2.94%
	パハマ	301,101,710	2.91%
	インドネシア	260,975,277	2.52%
	ドミニカ共和国	234,224,930	2.26%
	エジプト	231,958,745	2.24%
	オマーン	225,522,292	2.18%
	ベトナム	212,225,568	2.05%
	ジャマイカ	176,024,727	1.70%
	コートジボアール	151,634,348	1.46%
	エルサルバドル	142,704,961	1.38%
	ナイジェリア	140,561,889	1.36%
	レバノン	129,810,004	1.25%
	カタール	111,815,935	1.08%
	セネガル	59,102,012	0.57%
	サウジアラビア	53,409,338	0.52%
	クロアチア	51,732,631	0.50%
	モンゴル	43,033,816	0.42%
	パキスタン	31,536,001	0.30%
	コスタリカ	28,329,837	0.27%
	パナマ	27,273,234	0.26%
エクアドル	23,704,185	0.23%	
ケニア	21,441,930	0.21%	
特殊債券	メキシコ	326,044,850	3.15%
	南アフリカ	229,211,170	2.21%
	カザフスタン	111,477,287	1.08%
	トルコ	65,116,571	0.63%
	モンゴル	44,288,284	0.43%
社債券	ブラジル	35,107,088	0.34%
	メキシコ	600,874,407	5.80%
	オランダ	266,632,274	2.57%
	インド	226,279,662	2.19%
	インドネシア	204,505,568	1.97%
	イスラエル	131,488,290	1.27%
	カザフスタン	130,427,271	1.26%
	ケイマン諸島	119,460,474	1.15%
	香港	113,220,359	1.09%
	イギリス領バージン諸島	111,436,287	1.08%
	南アフリカ	110,393,281	1.07%
	ブラジル	107,261,863	1.04%
	トルコ	103,954,728	1.00%
	アメリカ	53,779,245	0.52%
	ペルー	46,597,429	0.45%
	モーリシャス	45,414,994	0.44%
	アラブ首長国連邦	44,668,837	0.43%
	チリ	44,086,964	0.43%
	アイルランド	41,469,922	0.40%
	アルゼンチン	29,155,672	0.28%
ルクセンブルグ	23,501,450	0.23%	
マレーシア	21,312,134	0.21%	
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		420,140,547	4.06%
純資産総額		10,355,819,856	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30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 セルビア	国債証券 -	4,000,000	12,446.78 497,871,479	12,250.42 490,017,124	7.2500 2021/09/28	4.73%
2	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	3,525,000	11,346.68 399,970,611	9,859.28 347,539,725	7.5000 2026/04/22	3.36%
3	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	2,800,000	11,283.52 315,938,770	11,187.25 313,243,182	4.0000 2024/02/26	3.02%
4	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	2,550,000	11,539.61 294,260,183	11,025.86 281,159,455	6.2500 2022/09/26	2.71%
5	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	2,306,352	11,448.75 264,048,599	9,683.73 223,340,936	8.2800 2033/12/31	2.16%
6	REPUBLIC OF GHANA ガーナ	国債証券 -	1,950,000	11,940.19 232,833,791	11,420.79 222,705,573	8.1250 2026/01/18	2.15%
7	SOCIALIST REP OF VIETNAM ベトナム	国債証券 -	1,850,000	11,463.37 212,072,497	11,471.65 212,225,568	4.8000 2024/11/19	2.05%
8	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	2,154,000	10,640.32 229,192,652	9,744.89 209,904,939	6.5000 2041/06/02	2.03%
9	ESKOM HOLDINGS SOC LTD 南アフリカ	特殊債券 -	1,950,000	11,241.42 219,207,877	10,636.69 207,415,642	7.1250 2025/02/11	2.00%
10	COMMONWEALTH OF BAHAMAS バハマ	国債証券 -	1,600,000	11,788.95 188,623,204	11,580.83 185,293,360	6.0000 2028/11/21	1.79%
11	PETROBRAS GLOBAL FINANCE オランダ	社債券 -	1,430,000	12,858.45 183,875,911	12,679.45 181,316,235	8.7500 2026/05/23	1.75%
12	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券 -	1,598,000	11,213.30 179,188,634	10,904.89 174,260,291	4.6650 2024/01/17	1.68%
13	ARAB REPUBLIC OF EGYPT エジプト	国債証券 -	1,600,000	10,940.77 175,052,390	10,459.22 167,347,539	6.5880 2028/02/21	1.62%
14	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN インドネシア	国債証券 -	1,400,000	11,362.80 159,079,333	11,147.72 156,068,202	4.3500 2024/09/10	1.51%
15	REPUBLIC OF SRI LANKA スリランカ	国債証券 -	1,461,000	11,350.43 165,829,912	10,531.25 153,861,629	5.8750 2022/07/25	1.49%
16	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	1,400,000	10,350.02 144,900,313	10,655.04 149,170,668	4.6250 2028/01/13	1.44%
17	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	1,400,000	11,006.60 154,092,495	10,496.93 146,957,115	7.7500 2025/09/01	1.42%
18	REPUBLIC OF NIGERIA ナイジェリア	国債証券 -	1,350,000	11,159.05 150,647,239	10,411.99 140,561,889	6.5000 2027/11/28	1.36%
19	REPUBLIC OF SRI LANKA スリランカ	国債証券 -	1,200,000	11,594.53 139,134,473	10,832.41 129,988,955	6.2500 2021/07/27	1.26%
20	IVORY COAST コートジボアール	国債証券 -	1,248,750	10,639.21 132,857,159	10,300.65 128,629,453	5.7500 2032/12/31	1.24%
21	PERTAMINA PERSERO PT インドネシア	社債券 -	1,225,000	11,120.20 136,222,530	10,300.88 126,185,825	5.6250 2043/05/20	1.22%
22	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	社債券 -	1,050,000	11,932.02 125,286,229	11,353.18 119,208,415	6.8750 2026/08/04	1.15%
23	COMMONWEALTH OF BAHAMAS バハマ	国債証券 -	1,000,000	11,596.63 115,966,347	11,580.83 115,808,350	6.0000 2028/11/21	1.12%
24	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 香港	社債券 -	1,000,000	11,365.13 113,651,313	11,322.03 113,220,359	4.6250 2023/03/14	1.09%
25	EXPORT-IMPORT BK INDIA インド	社債券 -	1,000,000	11,276.39 112,763,921	11,210.92 112,109,278	4.0000 2023/01/14	1.08%
26	SOQ SUKUK A Q.S.C カタール	国債証券 -	1,000,000	11,017.70 110,177,062	11,181.59 111,815,935	3.2410 2023/01/18	1.08%
27	DEVELOPMENT BANK OF KAZA カザフスタン	特殊債券 -	1,000,000	11,277.86 112,778,645	11,147.72 111,477,287	4.1250 2022/12/10	1.08%
28	BANCO NACIONAL COM EXT メキシコ	特殊債券 -	1,000,000	11,051.34 110,513,445	10,946.69 109,466,922	3.8000 2026/08/11	1.06%
29	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN インドネシア	国債証券 -	950,000	11,279.74 107,157,607	11,042.85 104,907,075	4.5500 2026/03/29	1.01%
30	GOVERNMENT OF JAMAICA ジャマイカ	国債証券 -	745,000	13,138.16 97,879,292	13,217.44 98,469,942	8.0000 2039/03/15	0.95%

(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	63.24%
社債券	24.87%
特殊債券	7.83%

合計	95.94%
----	--------

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

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30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30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30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	128,471,621	15.17%
	ドイツ	107,459,380	12.69%
	フランス	96,747,495	11.42%
	イギリス	70,884,660	8.37%
	スペイン	53,137,849	6.27%
	キプロス	41,394,167	4.89%
	ベルギー	34,894,326	4.12%
	スロヴェニア	21,995,314	2.60%
	セルビア	20,722,740	2.45%
	インドネシア	20,156,787	2.38%
	ルーマニア	15,566,260	1.84%
	メキシコ	14,398,030	1.70%
	イスラエル	14,206,926	1.68%
	アルバニア	13,937,865	1.65%
	アルゼンチン	10,741,499	1.27%
	アイルランド	9,234,405	1.09%
	ロシア	6,970,929	0.82%
オーストリア	3,773,807	0.45%	
デンマーク	3,548,571	0.42%	
特殊債券	国際機関	5,193,856	0.61%
社債券	オーストリア	41,603,228	4.91%
	ルクセンブルグ	13,331,676	1.57%
	スペイン	12,893,729	1.52%
	メキシコ	12,446,151	1.47%
	フランス	12,069,478	1.42%
	スウェーデン	11,333,339	1.34%
	ドイツ	7,355,774	0.87%
	イギリス	7,122,920	0.84%
	アイルランド	6,746,813	0.80%
	デンマーク	6,559,350	0.77%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		22,157,722	2.62%
純資産総額		847,056,667	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30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 -	371,000	15,589.09 57,835,524	14,257.65 52,895,905	5.5000 2022/09/01	6.24%
2	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	341,000	12,607.94 42,993,081	12,697.48 43,298,436	0.2500 2028/08/15	5.11%
3	BUNDESobligation ドイツ	国債証券 -	325,000	12,880.50 41,861,630	12,975.28 42,169,669	0.0000 2023/10/13	4.98%
4	HETA ASSET RESOLUTION AG オーストリア	社債券 -	300,000	13,888.54 41,665,645	13,867.74 41,603,228	2.3750 2022/12/13	4.91%
5	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	235,000	17,889.91 42,041,297	17,266.77 40,576,912	5.9000 2026/07/30	4.79%

6	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	214,000	17,881.53 38,266,492	17,690.59 37,857,863	3.2500 2045/05/25	4.47%
7	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	288,000	12,526.57 36,076,540	12,617.73 36,339,073	0.2500 2026/11/25	4.29%
8	UK GILT イギリス	国債証券 -	161,000	22,444.78 36,136,104	22,008.20 35,433,217	4.2500 2046/12/07	4.18%
9	UK GILT イギリス	国債証券 -	149,000	21,934.67 32,682,668	21,690.62 32,319,027	4.7500 2038/12/07	3.82%
10	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	172,000	15,363.95 26,425,998	13,867.99 23,852,959	4.5000 2024/03/01	2.82%
11	REPUBLIC OF CYPRUS キプロス	国債証券 -	161,000	14,360.46 23,120,353	14,273.45 22,980,259	3.7500 2023/07/26	2.71%
12	SERBIA TREASURY BONDS セルビア	国債証券 -	18,000,000	118.25 21,285,435	115.12 20,722,740	10.0000 2019/08/21	2.45%
13	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	149,000	13,784.64 20,539,126	13,528.04 20,156,787	2.8750 2021/07/08	2.38%
14	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	153,000	12,857.18 19,671,495	12,831.69 19,632,498	1.2500 2036/05/25	2.32%
15	REPUBLIC OF CYPRUS キプロス	国債証券 -	130,000	14,435.27 18,765,857	14,164.54 18,413,908	3.8750 2022/05/06	2.17%
16	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	123,000	12,784.40 15,724,817	12,902.07 15,869,555	0.2500 2027/02/15	1.87%
17	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	111,000	17,234.65 19,130,465	14,281.28 15,852,229	4.7500 2044/09/01	1.87%
18	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	77,000	20,158.50 15,522,045	19,468.31 14,990,605	4.2500 2041/03/28	1.77%
19	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券 -	100,000	14,609.42 14,609,426	14,398.03 14,398,030	3.6250 2029/04/09	1.70%
20	STATE OF ISRAEL イスラエル	国債証券 -	100,000	14,321.99 14,321,999	14,206.92 14,206,926	2.8750 2024/01/29	1.68%
21	REPUBLIKA SLOVENIJA スロヴェニア	国債証券 -	83,000	17,134.23 14,221,412	16,902.67 14,029,218	5.1250 2026/03/30	1.66%
22	REPUBLIC OF ALBANIA アルバニア	国債証券 -	100,000	14,362.96 14,362,969	13,937.86 13,937,865	5.7500 2020/11/12	1.65%
23	HORIZON PARENT HOLDEINGS ルクセンブルグ	社債券 -	100,000	13,611.01 13,611,011	13,331.67 13,331,676	8.2500 2022/02/15	1.57%
24	CAIXABANK SA スペイン	社債券 -	100,000	13,395.50 13,395,505	12,893.72 12,893,729	2.7500 2028/07/14	1.52%
25	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	社債券 -	110,000	11,986.88 13,185,574	11,314.68 12,446,151	2.7500 2027/04/21	1.47%
26	LOXAM SAS フランス	社債券 -	90,000	13,532.66 12,179,402	13,410.53 12,069,478	7.0000 2022/07/23	1.42%
27	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	80,000	17,552.65 14,042,125	14,621.75 11,697,404	5.0000 2040/09/01	1.38%
28	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	70,000	16,945.43 11,861,807	16,678.81 11,675,173	4.5000 2026/03/28	1.38%
29	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	88,000	13,260.39 11,669,149	12,964.36 11,408,642	1.5000 2027/04/30	1.35%
30	NORDEA HYPOTEK AB スウェーデン	社債券 -	900,000	1,259.36 11,334,277	1,259.25 11,333,339	1.0000 2022/04/08	1.34%

（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	81.25%
社債券	15.52%
特殊債券	0.61%
合計	97.38%

（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30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30年10月末現在）

該当事項はありません。

## アジア・オセアニア債券マザーファンド

## (1) 投資状況

(平成30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	107,758,090	12.91%
	香港	85,115,136	10.19%
	シンガポール	82,046,160	9.83%
	オーストラリア	78,018,956	9.34%
	韓国	31,568,166	3.78%
特殊債券	国際機関	336,227,744	40.27%
	ドイツ	75,898,438	9.09%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		38,329,537	4.59%
純資産総額		834,962,227	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30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	MALAYSIA GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	4,000,000	2,710.30 108,412,101	2,693.95 107,758,090	3.8000 2023/08/17	12.91%
2	INT BK RECON & DEVELOP 国際機関	特殊債券 -	1,200,000	8,088.91 97,066,969	8,121.01 97,452,121	2.8000 2022/01/12	11.67%
3	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	1,000,000	8,237.32 82,373,200	8,204.61 82,046,160	2.2500 2021/06/01	9.83%
4	AUSTRALIAN GOVERNMENT オーストラリア	国債証券 -	1,000,000	7,696.54 76,965,405	7,801.89 78,018,956	2.2500 2028/05/21	9.34%
5	INT BK RECON & DEVELOP 国際機関	特殊債券 -	1,000,000	7,568.25 75,682,516	7,642.67 76,426,742	3.3750 2022/01/25	9.15%
6	INT BK RECON & DEVELOP 国際機関	特殊債券 -	1,000,000	7,599.26 75,992,672	7,619.96 76,199,690	3.5000 2021/01/22	9.13%
7	LANDWIRTSCH. RENTENBANK ドイツ	特殊債券 -	1,000,000	7,632.36 76,323,604	7,589.84 75,898,438	4.0000 2020/01/30	9.09%
8	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	4,000,000	1,406.74 56,269,792	1,400.91 56,036,441	1.1900 2021/12/06	6.71%
9	EUROFIMA 国際機関	特殊債券 -	500,000	8,998.59 44,992,975	8,932.63 44,663,188	6.0000 2022/03/30	5.35%
10	ASIAN DEVELOPMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	515,000	8,007.22 41,237,233	8,055.53 41,486,001	2.6500 2023/01/11	4.97%
11	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	300,000,000	10.53 31,619,806	10.52 31,568,166	4.2500 2021/06/10	3.78%
12	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	2,000,000	1,476.96 29,539,330	1,453.93 29,078,694	2.4400 2020/12/07	3.48%

(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	49.36%
国債証券	46.05%
合計	95.41%

(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30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30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30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	404,369,686	99.72%

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,117,708	0.28%
純資産総額	405,487,394	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30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 -	3,700,000	11,348.76 419,904,314	10,928.91 404,369,686	2.0000 2019/10/18	99.72%

（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	99.72%
合計	99.72%

（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30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

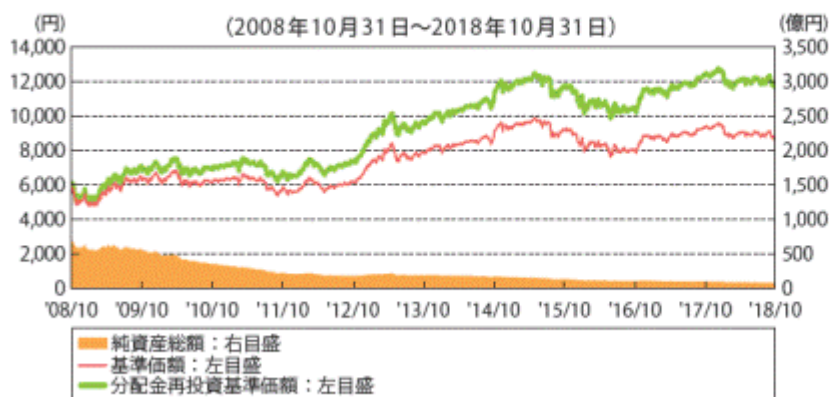
（平成30年10月末現在）

該当事項はありません。

## （参考情報）

2018年10月31日現在

### 基準価額・純資産の推移



\*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

### 分配の推移

2018年9月	30円
2018年7月	30円
2018年5月	30円
2018年3月	30円
2018年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	2,210円

\*分配金は1万口当たり、税引前

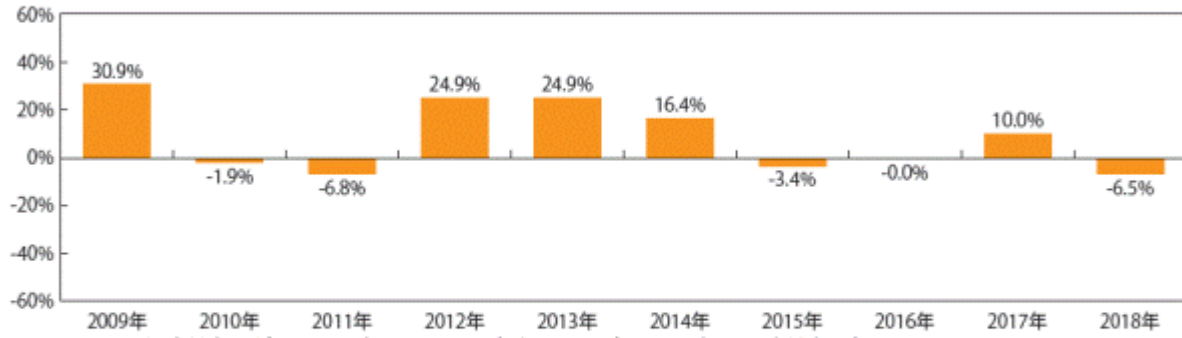
### 主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
世界REITマザーファンド	15.0%
グローバル好配当株マザーファンド	14.7%
新興国債券マザーファンド	10.2%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	10.1%
欧州債券マザーファンド	10.0%
アジア・オセアニア債券マザーファンド	9.9%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	9.8%
日本好配当株マザーファンド	9.8%
コモディティ・マザーファンド	4.8%
T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	4.1%

\*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、2018年は10月末までの収益率です。  
\*ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものと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2【管理及び運営】

### 3 資産管理等の概要

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

#### (1)資産の評価

(以下略)

基準価額は、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されます。原則として委託会社の各営業日に計算され、翌日の日本経済新聞に掲載されます。また、お申込みの各販売会社または下記の照会先まで問い合わせることにより知ることができます。

大和住銀投信投資顧問株式会社

<インターネットホームページ><http://www.daiwasbi.co.jp/>

<お電話によるお問い合わせ先> 受付窓口：（電話番号）0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで（土、日、祝日除く。）

(以下略)

#### (5)その他

(以下略)

運用にかかる報告等開示方法

(以下略)

ハ．委託会社は、交付運用報告書を販売会社を通じて受益者へ交付します。また、委託会社は、運用報告書（全体版）を委託会社のインターネットホームページに掲載します。

<インターネットホームページ><http://www.daiwasbi.co.jp/>

ニ．前ハ．にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(以下略)

<訂正後>

#### (1)資産の評価

(以下略)

基準価額は、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されます。原則として委託会社の各営業日に計算され、翌日の日本経済新聞に掲載されます。また、お申込みの各販売会社または下記の照会先まで問い合わせることにより知ることができます。

大和住銀投信投資顧問株式会社

<インターネットホームページ><https://www.daiwasbi.co.jp/>

<お電話によるお問い合わせ先> 受付窓口：（電話番号）0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで（土、日、祝日除く。）

(以下略)

#### (5)その他

(以下略)

運用にかかる報告等開示方法

(以下略)

ハ．委託会社は、交付運用報告書を販売会社を通じて受益者へ交付します。また、委託会社は、運用報告書（全体版）を委託会社のインターネットホームページに掲載します。

<インターネットホームページ><https://www.daiwasbi.co.jp/>

ニ．前ハ．にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(以下略)

## 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30年3月28日から平成30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30年3月27日現在 金額（円）	当期 平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,746,472	1,867,215
金銭信託	10,329,351	-
コール・ローン	131,912,946	134,876,430
投資証券	2,176,727,763	2,082,737,933
親投資信託受益証券	6,665,133,040	6,614,874,103
派生商品評価勘定	-	70,562
未収入金	60,346,798	69,935,634
流動資産合計	9,046,196,370	8,904,361,877
資産合計	9,046,196,370	8,904,361,877
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	335,367	-
未払収益分配金	30,828,916	29,289,749
未払解約金	988,116	5,151,525
未払受託者報酬	627,814	644,535
未払委託者報酬	21,973,779	22,559,376
その他未払費用	421,968	390,738
流動負債合計	55,175,960	58,035,923
負債合計	55,175,960	58,035,923
純資産の部		
元本等		
元本	10,276,305,437	9,763,249,890
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,285,285,027	916,923,936
（分配準備積立金）	547,384,286	575,440,739
元本等合計	8,991,020,410	8,846,325,954
純資産合計	8,991,020,410	8,846,325,954
負債純資産合計	9,046,196,370	8,904,361,877

## (2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成29年9月28日 至 平成30年3月27日 金額（円）	当期 自 平成30年3月28日 至 平成30年9月27日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	41,872,449	48,671,862
受取利息	541	564

有価証券売買等損益	145,261,292	279,045,192
為替差損益	149,674,515	148,138,887
営業収益合計	253,062,817	475,856,505
営業費用		
支払利息	50,335	60,190
受託者報酬	2,123,991	1,954,085
委託者報酬	74,341,329	68,394,794
その他費用	525,012	405,266
営業費用合計	77,040,667	70,814,335
営業利益又は営業損失( )	330,103,484	405,042,170
経常利益又は経常損失( )	330,103,484	405,042,170
当期純利益又は当期純損失( )	330,103,484	405,042,170
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( )	2,135,605	3,918,025
期首剰余金又は期首欠損金( )	932,313,679	1,285,285,027
剰余金増加額又は欠損金減少額	77,109,206	59,977,784
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	77,109,206	59,977,784
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,831,654	3,384,305
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,831,654	3,384,305
分配金	95,009,811	89,356,533
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,285,285,027	916,923,936

[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30年 3月28日	至 平成30年 9月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。  また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。	
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、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30年 3月27日現在		平成30年 9月27日現在	
1. 元本状況				
期首元本額		11,285,639,105円		10,276,305,437円
期中追加設定元本額		40,192,669円		31,101,061円
期中一部解約元本額		1,049,526,337円		544,156,608円
2. 受益権の総数		10,276,305,437口		9,763,249,890口
3. 元本の欠損		1,285,285,027円		916,923,936円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期		当期																																	
自 平成29年 9月28日 至 平成30年 3月27日		自 平成30年 3月28日 至 平成30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	6,490,749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	5,992,437円																																
2. 分配金の計算過程 第63期計算期間末（平成29年11月27日）に、投資信託約款に基づき計算した666,122,857円（1万口当たり613.02円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い32,598,656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66期計算期間末（平成30年 5月28日）に、投資信託約款に基づき計算した650,683,054円（1万口当たり644.28円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い30,298,051円（1万口当たり30円）を分配しております。																																	
<table border="1"> <tr> <td>配当等収益 (費用控除後)</td> <td>39,656,787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>56,122,669円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>570,343,401円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>666,122,857円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり分配可能額)</td> <td>(613.02円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>32,598,656円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり収益分配金)</td> <td>(30円)</td> </tr> </table>	配当等収益 (費用控除後)	39,656,787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	56,122,669円	分配準備積立金	570,343,401円	分配可能額	666,122,857円	(1万口当たり分配可能額)	(613.02円)	収益分配金	32,598,656円	(1万口当たり収益分配金)	(30円)		<table border="1"> <tr> <td>配当等収益 (費用控除後)</td> <td>59,051,977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>54,265,864円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>537,365,213円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>650,683,054円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり分配可能額)</td> <td>(644.28円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>30,298,051円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり収益分配金)</td> <td>(30円)</td> </tr> </table>	配当等収益 (費用控除後)	59,051,977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	54,265,864円	分配準備積立金	537,365,213円	分配可能額	650,683,054円	(1万口当たり分配可能額)	(644.28円)	収益分配金	30,298,051円	(1万口当たり収益分配金)	(30円)	
配当等収益 (費用控除後)	39,656,787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	56,122,669円																																		
分配準備積立金	570,343,401円																																		
分配可能額	666,122,857円																																		
(1万口当たり分配可能額)	(613.02円)																																		
収益分配金	32,598,656円																																		
(1万口当たり収益分配金)	(30円)																																		
配当等収益 (費用控除後)	59,051,977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	54,265,864円																																		
分配準備積立金	537,365,213円																																		
分配可能額	650,683,054円																																		
(1万口当たり分配可能額)	(644.28円)																																		
収益分配金	30,298,051円																																		
(1万口当たり収益分配金)	(30円)																																		

第64期計算期間末（平成30年1月29日）に、投資信託約款に基づき計算した655,654,020円（1万口当たり622.81円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い31,582,239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）	41,870,353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	55,230,174円
分配準備積立金	558,553,493円
分配可能額	655,654,020円
（1万口当たり分配可能額）	(622.81円)
収益分配金	31,582,239円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第65期計算期間末（平成30年3月27日）に、投資信託約款に基づき計算した632,806,231円（1万口当たり615.79円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い30,828,916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）	23,614,792円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	54,593,029円
分配準備積立金	554,598,410円
分配可能額	632,806,231円
（1万口当たり分配可能額）	(615.79円)
収益分配金	30,828,916円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第67期計算期間末（平成30年7月27日）に、投資信託約款に基づき計算した651,814,370円（1万口当たり656.88円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い29,768,733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）	42,261,853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	53,890,432円
分配準備積立金	555,662,085円
分配可能額	651,814,370円
（1万口当たり分配可能額）	(656.88円)
収益分配金	29,768,733円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第68期計算期間末（平成30年9月27日）に、投資信託約款に基づき計算した658,295,365円（1万口当たり674.26円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い29,289,749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）	46,253,430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	53,564,877円
分配準備積立金	558,477,058円
分配可能額	658,295,365円
（1万口当たり分配可能額）	(674.26円)
収益分配金	29,289,749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30年3月28日 至 平成30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、リスク管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成30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

前期（平成30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	493,836,809
投資証券	65,799,849
合計	559,636,658

当期（平成30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	84,748,936
投資証券	36,763,244
合計	47,985,692

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（通貨関連）

区分	種類	前期 平成30年3月27日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	60,000,000	-	60,335,367	335,367
	合計	-	-	60,335,367	335,367

区分	種類	当期 平成30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	70,000,000	-	69,929,438	70,562
	合計	-	-	69,929,438	70,562

（注）時価の算定方法

- A. 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。
- 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- 特定期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。
- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
  - ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- B. 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成30年3月28日 至 平成30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30年3月27日現在	当期 平成30年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.8749円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,749円）」	1口当たり純資産額 0.9061円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,061円）」



## (4) 附属明細表

## 有価証券明細表

## &lt; 株式以外の有価証券 &gt;

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	470,149,043	899,536,163	
	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	1,128,588,588	1,311,307,080	
	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	642,400,151	1,343,130,235	
	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	376,361,932	868,041,159	
	親投資信託 受益証券	欧州債券マザーファンド	634,896,392	878,442,647	
	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	615,338,516	842,583,029	
	親投資信託 受益証券	コモディティ・マザーファンド	883,914,932	471,833,790	
小計（日本）7銘柄			4,751,649,554	6,614,874,103	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Emerging Markets Equity Fund	379,998.230	3,416,184.080	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	776,645.480	7,463,563.060	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	725,049.950	7,569,521.470	
	小計（アメリカ・ドル）3銘柄			1,881,693.660	18,449,268.610 (2,082,737,933)
合計				8,697,612,036 (2,082,737,933)	

- (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	23.54%	23.95%

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](#)

## &lt;参考&gt;

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30年3月27日現在 金額（円）	平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	67,650,797	-
コール・ローン	863,947,390	951,156,664
株式	15,884,327,520	15,628,628,670
派生商品評価勘定	-	61,772,817
未収入金	50,731,555	173,031,271
未収配当金	23,363,000	174,758,610
前払金	28,560,000	-
差入委託証拠金	28,305,000	22,320,000
流動資産合計	16,946,885,262	17,011,668,032
資産合計	16,946,885,262	17,011,668,032
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,781,547	-
前受金	-	71,040,000
未払金	41,390,085	175,443,572
未払解約金	4,229,803	19,939,763
その他未払費用	933	-
流動負債合計	52,402,368	266,423,335
負債合計	52,402,368	266,423,335
純資産の部		
元本等		
元本	9,325,866,192	8,752,250,278
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,568,616,702	7,992,994,419
元本等合計	16,894,482,894	16,745,244,697
純資産合計	16,894,482,894	16,745,244,697
負債純資産合計	16,946,885,262	17,011,668,032

[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30年 3月28日 至 平成30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30年 3月27日現在	平成30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	11,100,465,667円	9,325,866,192円
期中追加設定元本額	77,907,682円	75,773,063円
期中一部解約元本額	1,852,507,157円	649,388,977円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	8,835,129,564円	8,282,101,235円
グローバル資産分散オープン	490,736,628円	470,149,043円
合計	9,325,866,192円	8,752,250,278円
2. 受益権の総数	9,325,866,192口	8,752,250,278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30年 3月28日 至 平成30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、リスク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30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30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	34,108,997
合計	34,108,997

「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10月11日から平成30年3月27日まで)を指しております。

(平成30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	749,678,715
合計	749,678,715

「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30年4月10日から平成30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30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	871,486,547	-	864,705,000	6,781,547
	合計	-	-	864,705,000	6,781,547

区分	種類	平成30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	803,667,183	-	865,440,000	61,772,817
	合計	-	-	865,440,000	61,772,817

(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30年3月28日 至 平成30年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成30年3月27日現在	平成30年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.8116円 「1口 = 1円(10,000口 = 18,116円)」	1口当たり純資産額 1.9133円 「1口 = 1円(10,000口 = 19,133円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

## &lt;株式&gt;

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
円	東急建設	47,000	1,081.00	50,807,000	
	西松建設	20,800	2,859.00	59,467,200	
	浅沼組	13,000	3,735.00	48,555,000	
	住友林業	39,000	1,951.00	76,089,000	
	ライト工業	64,000	1,595.00	102,080,000	
	中電工	6,500	2,603.00	16,919,500	
	関電工	13,300	1,160.00	15,428,000	
	協和エクシオ	59,200	3,245.00	192,104,000	
	三機工業	17,300	1,213.00	20,984,900	
	高砂熱学工業	29,600	2,045.00	60,532,000	
	日比谷総合設備	21,200	1,995.00	42,294,000	
	新興プランテック	144,000	1,095.00	157,680,000	
	日本たばこ産業	139,000	2,928.50	407,061,500	
	旭化成	73,000	1,726.50	126,034,500	
	デンカ	28,600	3,905.00	111,683,000	
	三井化学	11,000	2,812.00	30,932,000	
	三菱ケミカルホールディングス	35,000	1,048.00	36,680,000	
	KHネオケム	23,500	4,355.00	102,342,500	
	アイカ工業	20,000	4,570.00	91,400,000	
	宇部興産	15,100	2,998.00	45,269,800	
	森六ホールディングス	16,000	3,130.00	50,080,000	
	太陽ホールディングス	16,900	4,375.00	73,937,500	
	日本バルカー工業	16,000	3,195.00	51,120,000	
	武田薬品工業	17,800	4,899.00	87,202,200	
	エーザイ	14,500	10,820.00	156,890,000	
	大塚ホールディングス	55,600	5,622.00	312,583,200	
	出光興産	31,300	6,010.00	188,113,000	
	JXTGホールディングス	459,800	851.90	391,703,620	
	ブリヂストン	13,300	4,287.00	57,017,100	
	日本電気硝子	24,300	3,475.00	84,442,500	
	太平洋セメント	15,000	3,565.00	53,475,000	
	日本特殊陶業	60,300	3,245.00	195,673,500	
	フジインコーポレーテッド	15,000	2,951.00	44,265,000	
	ニチアス	44,000	2,943.00	129,492,000	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	80,900	2,590.00	209,531,000	
	日本軽金属ホールディングス	381,100	252.00	96,037,200	
	アサヒホールディングス	16,900	2,051.00	34,661,900	
	三和ホールディングス	146,900	1,380.00	202,722,000	
	小松製作所	69,400	3,397.00	235,751,800	
	トーヨーカネツ	8,100	2,888.00	23,392,800	
	平和	4,000	2,532.00	10,128,000	
	アマノ	12,700	2,366.00	30,048,200	
	マックス	25,300	1,680.00	42,504,000	
	セガサミーホールディングス	66,300	1,688.00	111,914,400	
	日本精工	39,000	1,287.00	50,193,000	
	スター精密	35,400	1,987.00	70,339,800	
	日本信号	113,800	1,150.00	130,870,000	
	新電元工業	8,800	5,240.00	46,112,000	
	アズビル	76,800	2,427.00	186,393,600	
	エスベック	34,100	2,146.00	73,178,600	
	ニチコン	55,500	1,143.00	63,436,500	
	東京エレクトロン	2,400	15,455.00	37,092,000	
	東海理化電機製作所	11,800	2,394.00	28,249,200	
日産自動車	79,300	1,053.50	83,542,550		
トヨタ自動車	93,300	7,008.00	653,846,400		
新明和工業	116,000	1,523.00	176,668,000		
アイシン精機	13,900	5,510.00	76,589,000		
本田技研工業	95,000	3,407.00	323,665,000		
ヤマハ発動機	21,000	3,130.00	65,730,000		
愛三工業	29,400	969.00	28,488,600		
パンダイナムコホールディングス	22,200	4,350.00	96,570,000		
大日本印刷	49,600	2,635.00	130,696,000		
オカムラ	58,800	1,500.00	88,200,000		
東北電力	64,000	1,494.00	95,616,000		
沖縄電力	63,800	2,360.00	150,568,000		
電源開発	25,300	3,095.00	78,303,500		
西日本旅客鉄道	41,800	7,870.00	328,966,000		

センコーグループホールディングス	180,000	934.00	168,120,000
日本航空	22,200	4,141.00	91,930,200
住友倉庫	24,000	1,509.00	36,216,000
コーエーテクモホールディングス	83,400	1,938.00	161,629,200
S R Aホールディングス	7,100	3,365.00	23,891,500
トレンドマイクロ	23,500	7,150.00	168,025,000
伊藤忠テクノソリューションズ	28,300	2,458.00	69,561,400
ネットワンシステムズ	42,700	2,636.00	112,557,200
日本電信電話	135,100	5,178.00	699,547,800
K D D I	30,700	3,090.00	94,863,000
N T T ドコモ	38,000	3,022.00	114,836,000
N S D	52,500	2,511.00	131,827,500
ダイワボウホールディングス	12,800	7,200.00	92,160,000
マクニカ・富士エレホールディングス	24,000	2,001.00	48,024,000
第一興商	1,600	5,480.00	8,768,000
萩原電気ホールディングス	20,700	3,365.00	69,655,500
伊藤忠商事	110,400	2,059.50	227,368,800
兼松	37,100	1,701.00	63,107,100
三井物産	134,700	1,995.00	268,726,500
住友商事	110,200	1,876.50	206,790,300
三菱商事	120,200	3,459.00	415,771,800
ユアサ商事	13,300	4,095.00	54,463,500
伊藤忠エネクス	45,000	1,154.00	51,930,000
日鉄住金物産	11,000	5,650.00	62,150,000
パルグループホールディングス	21,500	2,728.00	58,652,000
エディオン	96,000	1,264.00	121,344,000
島忠	29,800	3,645.00	108,621,000
パルコ	62,600	1,276.00	79,877,600
丸井グループ	85,400	2,782.00	237,582,800
あおぞら銀行	15,200	4,020.00	61,104,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,095,500	705.20	772,546,600
りそなホールディングス	183,000	636.80	116,534,400
三井住友トラスト・ホールディングス	47,800	4,649.00	222,222,200
ふくおかフィナンシャルグループ	41,200	3,120.00	128,544,000
S O M P Oホールディングス	20,500	4,836.00	99,138,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	34,000	2,493.00	84,762,000
第一生命ホールディングス	58,000	2,354.50	136,561,000
東京海上ホールディングス	97,700	5,663.00	553,275,100
プレミアグループ	22,300	4,450.00	99,235,000
興銀リース	17,000	3,020.00	51,340,000
オリックス	128,600	1,829.50	235,273,700
三菱UFJリース	167,000	657.00	109,719,000
日本駐車場開発	86,000	176.00	15,136,000
飯田グループホールディングス	11,000	1,977.00	21,747,000
パーク24	33,000	3,405.00	112,365,000
スターツコーポレーション	30,700	2,457.00	75,429,900
ジェイエイシーリクルートメント	64,000	2,588.00	165,632,000
アルプス技研	33,000	2,524.00	83,292,000
りらいあコミュニケーションズ	81,000	1,379.00	111,699,000
ユー・エス・エス	6,200	2,092.00	12,970,400
日本郵政	139,200	1,344.00	187,084,800
ベルシステム24ホールディングス	60,500	1,803.00	109,081,500
ソラスト	55,600	1,483.00	82,454,800
丹青社	105,000	1,204.00	126,420,000
メイテック	14,000	5,480.00	76,720,000
合計 122銘柄	7,833,300	-	15,628,628,670

## 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30年3月27日現在 金額（円）	平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	13,032,394	6,299,862
金銭信託	1,020,825	-
コール・ローン	13,036,646	5,846,456
投資証券	1,314,092,363	1,294,834,094
未収入金	-	39,085
未収配当金	3,530,613	4,338,901
流動資産合計	1,344,712,841	1,311,358,398
資産合計	1,344,712,841	1,311,358,398
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	10	-
流動負債合計	10	-
負債合計	10	-
純資産の部		
元本等		
元本	1,269,751,358	1,128,588,588
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	74,961,473	182,769,810
元本等合計	1,344,712,831	1,311,358,398
純資産合計	1,344,712,831	1,311,358,398
負債純資産合計	1,344,712,841	1,311,358,398

[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30年3月28日 至 平成30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30年3月27日現在	平成30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	1,374,522,046円	1,269,751,358円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	104,770,688円	141,162,770円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,269,751,358円	1,128,588,588円
合計	1,269,751,358円	1,128,588,588円
2. 受益権の総数	1,269,751,358口	1,128,588,588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30年3月28日 至 平成30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、リスク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30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30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	16,409,441
合計	16,409,441

「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30年3月27日まで)を指しております。

(平成30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	43,260,801
合計	43,260,801

「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30年3月28日から平成30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30年3月27日現在)

該当事項はありません。

(平成30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30年3月28日至平成30年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成30年3月27日現在	平成30年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.0590円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,590円)」	1口当たり純資産額 1.1619円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,619円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

&lt;株式以外の有価証券&gt;

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	45,879,600	
	投資証券	イオンリート投資法人	184	22,503,200	
	投資証券	オリックス不動産投資法人	128	22,707,200	
	投資証券	福岡リート投資法人	200	35,060,000	
	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	60	43,260,000	
		小計(日本)5銘柄		776	169,410,000
アメリカ・ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,999.000	244,737.570	
	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-D	7,289.000	182,516.560	
	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	3,489.000	91,795.590	
	投資証券	CROWN CASTLE INTL CORP	2,500.000	271,325.000	
	投資証券	CUBESMART	3,969.000	114,227.820	
	投資証券	DOUGLAS EMMETT INC	7,200.000	267,408.000	
	投資証券	EQUINIX INC	291.000	123,130.830	
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	3,948.000	256,580.520	
	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,322.000	114,260.460	
	投資証券	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	8,253.000	214,165.350	
	投資証券	HERSHA HOSPITALITY TRUST-D	6,230.000	146,778.800	
	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	6,454.000	135,663.080	
	投資証券	INVITATION HOMES INC	7,016.000	159,403.520	
	投資証券	MACERICH CO/THE	3,346.000	182,959.280	

	投資証券	PROLOGIS INC	5,458.000	360,173.420	
	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	2,208.000	139,943.040	
	投資証券	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,470.000	125,655.600	
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2,562.000	449,144.220	
	投資証券	SUNSTONE HOTEL INVESTORS-F	5,242.000	133,828.260	
	投資証券	TAUBMAN CENTERS INC	1,982.000	115,649.700	
	投資証券	VEREIT INC	15,300.000	110,925.000	
	投資証券	VICI PROPERTIES INC	7,882.000	166,231.380	
	小計(アメリカ・ドル) 22銘柄		105,410.000	4,106,503.000 (463,583,120)	
カナダ ・ドル	投資証券	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	10,200.000	150,246.000	
	投資証券	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,500.000	76,600.000	
	小計(カナダ・ドル) 2銘柄		12,700.000	226,846.000 (19,656,206)	
オースト ラリア・ ドル	投資証券	DEXUS	18,875.000	201,585.000	
	投資証券	GPT GROUP	76,537.000	400,288.510	
	投資証券	INGENIA COMMUNITIES GROUP	167,863.000	500,231.740	
	投資証券	MIRVAC GROUP	155,625.000	379,725.000	
	投資証券	SCENTRE GROUP	99,748.000	398,992.000	
	投資証券	STOCKLAND	25,276.000	105,906.440	
	小計(オーストラリア・ドル) 6銘柄		543,924.000	1,986,728.690 (162,852,151)	
香港 ・ドル	投資証券	LINK REIT	28,000.000	2,146,200.000	
	小計(香港・ドル) 1銘柄		28,000.000	2,146,200.000 (31,034,052)	
シンガ ポール・ ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	75,000.000	195,000.000	
	投資証券	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	209,200.000	412,124.000	
	小計(シンガポール・ドル) 2銘柄		284,200.000	607,124.000 (50,221,297)	
イギリス ・ポンド	投資証券	ASSURA PLC	178,395.000	96,333.300	
	投資証券	BIG YELLOW GROUP PLC	9,427.000	87,199.750	
	投資証券	HAMMERSON PLC	24,157.000	111,387.920	
	投資証券	SAFESTORE HOLDINGS PLC	15,897.000	85,923.280	
	投資証券	SEGRO PLC	62,947.000	402,609.010	
	投資証券	TRITAX BIG BOX REIT PLC	211,221.000	310,072.420	
	小計(イギリス・ポンド) 6銘柄		502,044.000	1,093,525.680 (162,651,010)	
ユーロ	投資証券	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	9,801.000	125,158.770	
	投資証券	GECINA SA	2,203.000	322,298.900	
	投資証券	GREEN REIT PLC	133,353.000	206,697.150	
	投資証券	HIBERNIA REIT PLC	136,153.000	197,421.850	
	投資証券	ICADE	465.000	36,967.500	
	投資証券	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	43,374.000	392,751.570	
	投資証券	KLEPIERRE	2,209.000	67,727.940	
	投資証券	NSI NV	3,653.000	128,220.300	
	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	537.000	95,049.000	
	投資証券	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,739.000	202,767.400	
	小計(ユーロ) 10銘柄		333,487.000	1,775,060.380 (235,426,258)	
合計				1,294,834,094 (1,125,424,094)	

- (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 22銘柄	35.35%	35.80%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	1.50%	1.52%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	12.42%	12.58%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	2.37%	2.40%
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄	3.83%	3.88%
イギリス・ポンド	投資証券 6銘柄	12.40%	12.56%
ユーロ	投資証券 10銘柄	17.95%	18.18%

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30年3月27日現在 金額（円）	平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	658,747,211	691,470,302
金銭信託	58,088,378	-
コール・ローン	741,828,690	337,751,295
株式	59,598,173,790	60,134,614,075
投資証券	1,110,889,182	1,196,742,658
未収配当金	143,393,942	196,878,514
流動資産合計	62,311,121,193	62,557,456,844
資産合計	62,311,121,193	62,557,456,844
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	33,966
未払金	-	115,467,374
未払解約金	20,826,312	57,993,951
その他未払費用	464	-
流動負債合計	20,826,776	173,495,291
負債合計	20,826,776	173,495,291
純資産の部		
元本等		
元本	32,137,702,780	29,837,394,908
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	30,152,591,637	32,546,566,645
元本等合計	62,290,294,417	62,383,961,553
純資産合計	62,290,294,417	62,383,961,553
負債純資産合計	62,311,121,193	62,557,456,844

[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30年 3月28日 至 平成30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。 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30年 3月27日現在	平成30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	36,047,061,352円	32,137,702,780円
期中追加設定元本額	200,539,820円	157,454,489円
期中一部解約元本額	4,109,898,392円	2,457,762,361円
元本の内訳		
グローバル好配当株オープン	31,461,117,933円	29,194,994,757円
グローバル資産分散オープン	676,584,847円	642,400,151円
合計	32,137,702,780円	29,837,394,908円
2. 受益権の総数	32,137,702,780口	29,837,394,908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30年 3月28日 至 平成30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、リスク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30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30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	2,969,540,864
投 資 証 券	49,713,927
合 計	3,019,254,791

「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30年1月10日から平成30年3月27日まで）を指しております。

(平成30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	1,076,433,087
投 資 証 券	7,976,796
合 計	1,068,456,291

「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30年7月10日から平成30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30年3月27日現在)

該当事項はありません。

(通貨関連)

区分	種類	平成30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	31,578,420	-	31,552,162	26,258
	売建 オーストラリア・ドル	31,578,420	-	31,586,128	7,708
	合 計	-	-	63,138,290	33,966

(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30年3月28日 至 平成30年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成30年 3月27日現在	平成30年 9月27日現在
1口当たり純資産額 1.9382円 「1口 = 1円（10,000口 = 19,382円）」	1口当たり純資産額 2.0908円 「1口 = 1円（10,000口 = 20,908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	3,293.00	766,281,100	
	ディスコ	47,000	18,940.00	890,180,000	
	小松製作所	250,000	3,397.00	849,250,000	
	日本精工	500,000	1,287.00	643,500,000	
	アズビル	440,000	2,427.00	1,067,880,000	
	NTTドコモ	350,000	3,022.00	1,057,700,000	
	オリックス	288,000	1,829.50	526,896,000	
	小計(日本) 7銘柄	2,107,700	-	5,801,687,100	
アメリカ ・ドル	ALTRIA GROUP INC	81,380	60.810	4,948,717.800	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	122,900	85.910	10,558,339.000	
	ANALOG DEVICES INC	68,830	92.320	6,354,385.600	
	APPLE INC	14,080	220.420	3,103,513.600	
	AT&T INC	219,000	33.350	7,303,650.000	
	CARNIVAL CORP	152,740	66.980	10,230,525.200	
	CHEVRON CORP	56,100	121.950	6,841,395.000	
	CISCO SYSTEMS INC	135,000	48.410	6,535,350.000	
	COCA-COLA CO/THE	69,400	45.850	3,181,990.000	
	CONOCOPHILLIPS	180,070	77.280	13,915,809.600	
	HOME DEPOT INC	50,720	207.520	10,525,414.400	
	INTEL CORP	57,800	45.700	2,641,460.000	
	JOHNSON & JOHNSON	90,300	138.160	12,475,848.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	96,380	115.020	11,085,627.600	
	MCDONALD'S CORP	53,100	165.760	8,801,856.000	
	MICROSOFT CORP	125,000	113.980	14,247,500.000	
	NEXTERA ENERGY INC	76,250	164.450	12,539,312.500	
	NORTHERN TRUST CORP	81,500	103.110	8,403,465.000	
	RAYTHEON COMPANY	46,000	205.240	9,441,040.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	95,200	106.220	10,112,144.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	27,000	262.910	7,098,570.000		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	77,000	72.960	5,617,920.000		
小計(アメリカ・ドル) 22銘柄	1,975,750	-	185,963,833.300 (20,993,457,142)		
カナダ ・ドル	MANULIFE FINANCIAL CORP	200,000	23.660	4,732,000.000	
	小計(カナダ・ドル) 1銘柄	200,000	-	4,732,000.000 (410,027,800)	
オースト ラリア・ ドル	BHP BILLITON LIMITED	435,240	34.500	15,015,780.000	
	WESTPAC BANKING CORP	345,559	27.810	9,609,995.790	
	小計(オーストラリア・ドル) 2銘柄	780,799	-	24,625,775.790 (2,018,574,842)	
香港 ・ドル	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2,700,000	36.050	97,335,000.000	
	BOC AVIATION LTD	600,000	60.400	36,240,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,678,000	37.300	62,589,400.000	
	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	4,900,000	3.100	15,190,000.000	
	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	21,000,000	3.990	83,790,000.000	
	CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,500,000	3.650	31,025,000.000	
	CHINA MOBILE LTD	633,000	75.700	47,918,100.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,146,000	25.150	53,971,900.000	
	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	6,356,000	8.800	55,932,800.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	700,000	21.300	14,910,000.000	
	SANDS CHINA LTD	2,320,000	35.700	82,824,000.000	
小計(香港・ドル) 11銘柄	51,533,000	-	581,726,200.000 (8,411,760,852)		
シンガ ポール・ ドル	CAPITALAND LTD	2,205,000	3.390	7,474,950.000	
	小計(シンガポール・ドル) 1銘柄	2,205,000	-	7,474,950.000 (618,327,864)	
台湾 ・ドル	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,702,131	263.500	448,511,518.500	
	小計(台湾・ドル) 1銘柄	1,702,131	-	448,511,518.500 (1,650,522,388)	
イギリス	ASTRAZENECA PLC	111,900	58.430	6,538,317.000	

・ポンド	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	197,000	35.520	6,997,440.000	
	BUNZL PLC	221,830	24.130	5,352,757.900	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	76,300	68.240	5,206,712.000	
	小計(イギリス・ポンド)4銘柄	607,030	-	24,095,226.900 (3,583,924,049)	
スイス・フラン	GIVAUDAN-REG	4,100	2,384.000	9,774,400.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	140,500	50.980	7,162,690.000	
	NOVARTIS AG-REG	89,490	83.640	7,484,943.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,500	236.750	7,694,375.000	
	SWISS RE AG	71,600	90.880	6,507,008.000	
	UBS GROUP AG-REG	388,570	15.935	6,191,862.950	
	小計(スイス・フラン)6銘柄	726,760	-	44,815,279.550 (5,239,354,332)	
ノルウェー・クローネ	TELENOR ASA	458,200	162.150	74,297,130.000	
	小計(ノルウェー・クローネ)1銘柄	458,200	-	74,297,130.000 (1,034,959,021)	
韓国・ウォン	KT&G CORP	55,670	105,500.000	5,873,185,000.000	
	小計(韓国・ウォン)1銘柄	55,670	-	5,873,185,000.000 (595,540,959)	
ユーロ	ACCOR SA	171,000	43.820	7,493,220.000	
	ALLIANZ SE-REG	28,000	195.860	5,484,080.000	
	ATLANTIA SPA	270,000	18.380	4,962,600.000	
	CAIXABANK S.A	1,070,000	3.996	4,275,720.000	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	367,800	13.970	5,138,166.000	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	63,150	40.840	2,579,046.000	
	ING GROEP NV	276,000	11.562	3,191,112.000	
	KONE OYJ-B	151,660	45.250	6,862,615.000	
	L'OREAL	33,600	205.500	6,904,800.000	
	ORANGE	243,000	13.760	3,343,680.000	
	RELX PLC	243,752	17.595	4,288,816.440	
	SAMPO OYJ-A SHS	167,470	44.400	7,435,668.000	
	TOTAL SA	170,000	55.430	9,423,100.000	
	VONOVIA SE	55,750	41.790	2,329,792.500	
小計(ユーロ)14銘柄	3,311,182	-	73,712,415.940 (9,776,477,726)		
合計		65,663,222	-	60,134,614,075 (54,332,926,975)	

## &lt;株式以外の有価証券&gt;

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
オーストラリア・ドル	投資証券	GOODMAN GROUP	433,540.000	4,504,480.600	
	小計(オーストラリア・ドル)1銘柄		433,540.000	4,504,480.600 (369,232,274)	
シンガポール・ドル	投資証券	ACCORDIA GOLF TRUST	5,000,000.000	2,775,000.000	
	小計(シンガポール・ドル)1銘柄		5,000,000.000	2,775,000.000 (229,548,000)	
イギリス・ポンド	投資証券	SEGRO PLC	340,960.000	2,180,780.160	
	小計(イギリス・ポンド)1銘柄		340,960.000	2,180,780.160 (324,369,241)	
ユーロ	投資証券	GECINA SA	14,100.000	2,062,830.000	
	小計(ユーロ)1銘柄		14,100.000	2,062,830.000 (273,593,143)	
合計				1,196,742,658 (1,196,742,658)	

- (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 22銘柄	33.65%	34.23%
カナダ・ドル	外国株式 1銘柄	0.66%	0.67%
オーストラリア・ドル	外国株式 2銘柄	3.24%	3.29%
香港・ドル	外国株式 11銘柄	13.48%	13.72%
シンガポール・ドル	外国株式 1銘柄	0.99%	1.01%
台湾・ドル	外国株式 1銘柄	2.65%	2.69%
イギリス・ポンド	外国株式 4銘柄	5.74%	5.84%
スイス・フラン	外国株式 6銘柄	8.40%	8.54%
ノルウェー・クローネ	外国株式 1銘柄	1.66%	1.69%

韓国・ウォン	外国株式	1 銘柄	0.95%	0.97%
ユーロ	外国株式	14銘柄	15.67%	15.94%
オーストラリア・ドル	投資証券	1 銘柄	0.58%	0.60%
シンガポール・ドル	投資証券	1 銘柄	0.37%	0.37%
イギリス・ポンド	投資証券	1 銘柄	0.52%	0.53%
ユーロ	投資証券	1 銘柄	0.44%	0.45%

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30年3月27日現在 金額（円）	平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	243,148,731	251,906,355
金銭信託	10,895,281	-
コール・ローン	139,140,259	150,080,639
国債証券	5,399,767,304	6,699,445,142
特殊債券	813,440,862	787,911,442
社債券	2,251,182,997	2,576,257,942
派生商品評価勘定	144,870	1,060,168
未収入金	-	22,415,438
未収利息	109,392,156	141,090,828
前払費用	7,539,773	14,830,081
流動資産合計	8,974,652,233	10,644,998,035
資産合計	8,974,652,233	10,644,998,035
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	333,824	1,106,011
未払金	33,353,241	-
その他未払費用	142	-
流動負債合計	33,687,207	1,106,011
負債合計	33,687,207	1,106,011
純資産の部		
元本等		
元本	4,098,068,529	4,614,936,108
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,842,896,497	6,028,955,916
元本等合計	8,940,965,026	10,643,892,024
純資産合計	8,940,965,026	10,643,892,024
負債純資産合計	8,974,652,233	10,644,998,035

[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30年3月28日 至 平成30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30年3月27日現在	平成30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	4,120,097,935円	4,098,068,529円
期中追加設定元本額	181,470,957円	759,374,767円
期中一部解約元本額	203,500,363円	242,507,188円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	407,121,699円	376,361,932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）	1,392,192,886円	1,295,488,265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）	2,298,753,944円	2,943,085,911円
合計	4,098,068,529円	4,614,936,108円
2. 受益権の総数	4,098,068,529口	4,614,936,108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30年3月28日 至 平成30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、リスク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30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30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	173,545,450
特殊債券	17,378,663
社債券	72,612,189
合計	263,536,302

「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11月8日から平成30年3月27日まで)を指しております。

(平成30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	152,150,962
特殊債券	12,129,785
社債券	20,853,903
合計	185,134,650

「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30年5月8日から平成30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30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	7,638,600	-	7,304,776	333,824
	売建 メキシコ・ペソ	7,638,600	-	7,493,730	144,870
合計		-	-	14,798,506	188,954

区分	種類	平成30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	85,195,993	-	86,010,384	814,391
	売建 アメリカ・ドル	5,000,000	-	4,998,649	1,351
	メキシコ・ペソ	7,954,680	-	7,783,470	171,210
	ユーロ	77,241,313	-	78,274,108	1,032,795
合計		-	-	177,066,611	45,843

(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30年3月28日 至 平成30年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成30年3月27日現在	平成30年9月27日現在
1口当たり純資産額 2.1818円 「1口 = 1円(10,000口 = 21,818円)」	1口当たり純資産額 2.3064円 「1口 = 1円(10,000口 = 23,064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 5.875 01/11/28	50,000.000	39,850.000	
	国債証券	ARGENT 7.125 06/28/17	100,000.000	78,875.000	
	国債証券	ARGENT 7.5 04/22/26	3,125,000.000	2,807,843.750	
	国債証券	ARGENT 8.28 12/31/33	2,166,148.710	1,973,383.050	
	国債証券	ARGENT FL 12/31/38	150,000.000	89,514.000	
	国債証券	BAHAMA 6 11/21/28	1,000,000.000	1,025,000.000	
	国債証券	BAHAMA 6 11/21/28	1,600,000.000	1,640,000.000	
	国債証券	BRAZIL 4.25 01/07/25	625,000.000	591,406.250	
	国債証券	BRAZIL 4.625 01/13/28	1,400,000.000	1,282,050.000	
	国債証券	BRAZIL 4.875 01/22/21	150,000.000	152,296.500	
	国債証券	BRAZIL 5 01/27/45	859,000.000	710,925.580	
	国債証券	BRAZIL 5.625 01/07/41	100,000.000	91,476.000	
	国債証券	COLOM 4 02/26/24	2,800,000.000	2,797,900.000	
	国債証券	COLOM 4.375 07/12/21	600,000.000	611,850.000	
	国債証券	COLOM 5 06/15/45	200,000.000	198,500.000	
	国債証券	COLOM 6.125 01/18/41	600,000.000	676,500.000	
	国債証券	DOMREP 5.5 01/27/25	855,000.000	853,290.000	
	国債証券	DOMREP 5.95 01/25/27	700,000.000	706,125.000	
	国債証券	DOMREP 6.85 01/27/45	210,000.000	209,527.500	
	国債証券	DOMREP 7.45 04/30/44	300,000.000	317,250.000	
	国債証券	ECUA 10.75 03/28/22	200,000.000	214,290.000	
	国債証券	EGYPT 6.588 02/21/28	1,900,000.000	1,821,511.000	
	国債証券	EGYPT 8.5 01/31/47	600,000.000	603,450.000	
	国債証券	ELSALV 5.875 01/30/25	560,000.000	522,849.600	
	国債証券	ELSALV 8.625 02/28/29	195,000.000	206,456.250	
	国債証券	ELSALV 8.625 02/28/29	550,000.000	582,312.500	
	国債証券	GHANA 10.75 10/14/30	400,000.000	496,000.000	
	国債証券	GHANA 8.125 01/18/26	1,950,000.000	2,027,395.500	
	国債証券	GHANA 8.627 06/16/49	250,000.000	248,842.500	
	国債証券	INDOIS 4.35 09/10/24	1,400,000.000	1,407,000.000	
	国債証券	INDOIS 4.55 03/29/26	950,000.000	946,437.500	
	国債証券	IVYCST FL 12/31/32	1,248,750.000	1,177,271.550	
国債証券	JAMAN 6.75 04/28/28	200,000.000	217,750.000		
国債証券	JAMAN 7.875 07/28/45	400,000.000	465,400.000		
国債証券	JAMAN 8 03/15/39	745,000.000	864,490.550		
国債証券	KENINT 7.25 02/28/28	200,000.000	194,242.000		
国債証券	KSA 3.25 10/26/26	300,000.000	281,721.000		
国債証券	KSA 5 04/17/49	200,000.000	202,900.000		
国債証券	LEBAN 6.6 11/27/26	400,000.000	311,836.000		
国債証券	LEBAN 6.85 03/23/27	1,000,000.000	780,000.000		
国債証券	LEBAN 8.25 04/12/21	900,000.000	845,298.000		
国債証券	MONGOL 5.125 12/05/22	400,000.000	384,496.000		
国債証券	NGERIA 6.5 11/28/27	1,350,000.000	1,299,307.500		
国債証券	OMAN 4.75 06/15/26	750,000.000	714,075.000		
国債証券	OMAN 5.375 03/08/27	300,000.000	292,395.000		
国債証券	OMAN 6.5 03/08/47	200,000.000	191,696.000		
国債証券	OMAN 6.75 01/17/48	200,000.000	196,482.000		

国債証券	OMANIB 4.75 06/15/26	700,000.000	666,470.000
国債証券	PANAMA 6.7 01/26/36	200,000.000	250,000.000
国債証券	PKSTAN 6.875 12/05/27	300,000.000	283,368.000
国債証券	QATAR 3.241 01/18/23	1,000,000.000	988,480.000
国債証券	SENEGL 6.25 05/23/33	600,000.000	559,290.000
国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	4,000,000.000	4,356,160.000
国債証券	SOAF 4.665 01/17/24	1,598,000.000	1,557,746.380
国債証券	SOAF 5.375 07/24/44	400,000.000	354,692.000
国債証券	SOAF 5.65 09/27/47	500,000.000	450,670.000
国債証券	SOAF 5.875 09/16/25	700,000.000	710,206.000
国債証券	SOAF 6.25 03/08/41	100,000.000	98,523.000
国債証券	SRILAN 5.875 07/25/22	1,461,000.000	1,435,417.890
国債証券	SRILAN 6.125 06/03/25	700,000.000	668,731.000
国債証券	SRILAN 6.2 05/11/27	200,000.000	187,990.000
国債証券	SRILAN 6.25 07/27/21	1,200,000.000	1,205,964.000
国債証券	TURKEY 11.875 01/15/30	50,000.000	65,292.500
国債証券	TURKEY 4.25 04/14/26	1,000,000.000	837,670.000
国債証券	TURKEY 4.875 10/09/26	300,000.000	256,659.000
国債証券	TURKEY 5.125 03/25/22	200,000.000	189,656.000
国債証券	TURKEY 5.75 05/11/47	200,000.000	154,690.000
国債証券	TURKEY 6 03/25/27	400,000.000	363,088.000
国債証券	TURKEY 6.25 09/26/22	2,550,000.000	2,487,907.500
国債証券	TURKEY 6.875 03/17/36	200,000.000	181,144.000
国債証券	TURKEY 7.375 02/05/25	550,000.000	552,750.000
国債証券	TURKSK 4.489 11/25/24	925,000.000	813,639.250
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/20	250,000.000	251,930.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/21	750,000.000	754,020.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/22	400,000.000	398,416.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/01/25	1,400,000.000	1,329,020.000
国債証券	VIETNM 4.8 11/19/24	1,850,000.000	1,887,832.500
特殊債券	BNCE FL 08/11/26	1,000,000.000	977,510.000
特殊債券	BNDES 5.5 07/12/20	300,000.000	311,055.000
特殊債券	DBKAZ 4.125 12/10/22	1,000,000.000	986,860.000
特殊債券	ESKOM 5.75 01/26/21	200,000.000	193,794.000
特殊債券	ESKOM 7.125 02/11/25	1,950,000.000	1,864,629.000
特殊債券	EXCRTU 5.375 10/24/23	200,000.000	177,242.000
特殊債券	EXCRTU 5.875 04/24/19	400,000.000	396,352.000
特殊債券	PEMEX 6.5 06/02/41	2,154,000.000	2,008,605.000
社債券	AKBNK 5.125 03/31/25	200,000.000	173,202.000
社債券	ALLLBZ 7.375 02/09/24	200,000.000	202,860.000
社債券	AXTEL 6.375 11/14/24	200,000.000	197,374.000
社債券	AZULBZ 5.875 10/26/24	300,000.000	258,003.000
社債券	BANBRA FL PERPETUAL	250,000.000	241,875.000
社債券	BBVASM FL 11/12/29	200,000.000	192,500.000
社債券	BEEFBZ 6.5 09/20/26	200,000.000	188,000.000
社債券	CEMEX 7.75 04/16/26	200,000.000	219,950.000
社債券	CHGRID 4.125 05/07/24	300,000.000	302,889.000
社債券	CHGRID 4.375 05/22/43	300,000.000	301,680.000
社債券	COMENG 6.375 04/24/35	350,000.000	345,100.000
社債券	DIALIN 6.125 10/31/26	200,000.000	201,760.000
社債券	EBIUH FL PERPETUAL	200,000.000	200,142.000
社債券	EMIRAT 4.5 03/22/28	405,013.500	395,843.990
社債券	ENAPCL 4.5 09/14/47	450,000.000	405,450.000
社債券	ESKOM 6.35 08/10/28	805,000.000	798,568.050
社債券	EXIMBK 3.375 08/05/26	900,000.000	820,863.000
社債券	EXIMBK 4 01/14/23	1,000,000.000	991,180.000
社債券	FSRSJ FL 04/23/28	200,000.000	200,134.000
社債券	GARAN FL 05/24/27	200,000.000	165,440.000
社債券	GERGHK 4.625 05/21/23	300,000.000	268,500.000
社債券	GLOPAR 5.125 03/31/27	200,000.000	184,752.000
社債券	GTLKOA 5.125 05/31/24	400,000.000	362,328.000
社債券	HAOHUA 4.625 03/14/23	1,000,000.000	1,008,140.000
社債券	HAOHUA FL PERPETUAL	200,000.000	190,396.000
社債券	HKHKD 3.875 04/08/23	200,000.000	195,526.000
社債券	HLSTWR 9.125 03/08/22	200,000.000	203,000.000
社債券	ICLIT 6.375 05/31/38	200,000.000	200,490.000
社債券	IRCPAR 8.75 03/23/23	55,000.000	55,069.300

社債券	IRCPAR 8.75 03/23/23	200,000.000	200,252.000	
社債券	ISRELE 4.25 08/14/28	800,000.000	757,760.000	
社債券	ISRELE 5 11/12/24	200,000.000	203,300.000	
社債券	ITAU FL PERPETUAL	200,000.000	182,980.000	
社債券	KIONET 7.5 05/02/25	200,000.000	197,000.000	
社債券	KZOKZ 4.75 04/19/27	600,000.000	599,484.000	
社債券	KZOKZ 6.375 10/24/48	550,000.000	573,386.000	
社債券	MEXCAT 3.875 04/30/28	400,000.000	360,004.000	
社債券	MEXCAT 5.5 07/31/47	750,000.000	663,750.000	
社債券	MRFGBZ 8 06/08/23	200,000.000	201,000.000	
社債券	MTNSJ 6.5 10/13/26	200,000.000	195,970.000	
社債券	NOGLN 8 07/25/22	200,000.000	190,456.000	
社債券	NTPCIN 4.5 03/19/28	200,000.000	191,600.000	
社債券	OTELOM 6.625 04/24/28	200,000.000	199,548.000	
社債券	PEMEX 6.75 09/21/47	960,000.000	916,800.000	
社債券	PEMEX 6.875 08/04/26	1,050,000.000	1,103,140.500	
社債券	PERLNG 5.375 03/22/30	210,000.000	210,546.000	
社債券	PERTIJ 5.625 05/20/43	1,225,000.000	1,201,749.500	
社債券	PETBRA 5.999 01/27/28	259,000.000	236,700.100	
社債券	PETBRA 6.85 06/05/15	400,000.000	345,200.000	
社債券	PETBRA 8.75 05/23/26	1,430,000.000	1,557,985.000	
社債券	PGASIJ 5.125 05/16/24	200,000.000	201,052.000	
社債券	PLBIII 4.875 10/01/24	300,000.000	298,950.000	
社債券	PMALMK 4.8 10/30/22	200,000.000	189,298.000	
社債券	RETAIL 5.375 05/02/23	200,000.000	203,230.000	
社債券	SANTAN FL PERPETUAL	200,000.000	216,500.000	
社債券	SASOL 6.5 09/27/28	200,000.000	202,824.000	
社債券	TCZIRA 4.75 04/29/21	450,000.000	401,850.000	
社債券	TCZIRA 5.125 09/29/23	200,000.000	170,892.000	
社債券	TNEMAK 4.75 01/23/25	275,000.000	269,846.500	
社債券	UNIFIN 7 01/15/25	200,000.000	190,002.000	
社債券	VOTORA 7.25 04/05/41	300,000.000	296,253.000	
社債券	WTTINV 5.5 11/21/22	200,000.000	200,854.000	
社債券	YLLGSP 6.75 04/23/23	220,000.000	219,780.000	
	小計(アメリカ・ドル) 148銘柄	90,620,912.210	88,383,896.040 (9,977,658,024)	
メキシコ ・ペソ	特殊債券	PEMEX 7.19 09/12/24	1,400,000.000	1,197,140.000
	小計(メキシコ・ペソ) 1銘柄		1,400,000.000	1,197,140.000 (7,158,897)
ユーロ	国債証券	CROATI 2.7 06/15/28	400,000.000	407,736.000
	国債証券	IVYCST 6.625 03/22/48	200,000.000	186,380.000
	小計(ユーロ) 2銘柄		600,000.000	594,116.000 (78,797,605)
合計			10,063,614,526 (10,063,614,526)	

- (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	77銘柄	99.15%
	特殊債券	8銘柄	
	社債券	63銘柄	
メキシコ・ペソ	特殊債券	1銘柄	0.07%
ユーロ	国債証券	2銘柄	0.78%

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30年3月27日現在 金額（円）	平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	30,741,861	74,322,982
金銭信託	31,800	-
コール・ローン	406,112	426,965
国債証券	678,892,455	653,223,552
特殊債券	5,396,682	5,368,759
社債券	156,127,212	136,560,224
派生商品評価勘定	3,561,268	1,909,294
未収利息	10,855,627	8,282,793
前払費用	500,324	91,828
流動資産合計	886,513,341	880,186,397
資産合計	886,513,341	880,186,397
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,654,259	1,774,818
流動負債合計	2,654,259	1,774,818
負債合計	2,654,259	1,774,818
純資産の部		
元本等		
元本	634,896,392	634,896,392
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	248,962,690	243,515,187
元本等合計	883,859,082	878,411,579
純資産合計	883,859,082	878,411,579
負債純資産合計	886,513,341	880,186,397

[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30年3月28日 至 平成30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た価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年3月27日現在	平成30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	743,375,258円	634,896,392円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	108,478,866円	-
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	634,896,392円	634,896,392円
合計	634,896,392円	634,896,392円
2. 受益権の総数	634,896,392口	634,896,392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30年3月28日 至 平成30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、リスク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30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30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	13,392,073
特殊債券	72,803
社債券	613,798
合計	14,078,674

「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30年3月27日まで）を指しております。

(平成30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	21,892,207
特殊債券	1,385
社債券	1,845,683
合計	23,736,505

「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30年3月28日から平成30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30年3月27日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	イギリス・ポンド	59,475,565	-	58,488,380	987,185
	スイス・フラン	3,372,241	-	3,241,620	130,621
	デンマーク・クローネ	372,385	-	361,741	10,644
	ノルウェー・クローネ	5,940,781	-	5,789,840	150,941
	スウェーデン・クローナ	1,327,869	-	1,326,212	1,657
	チェコ・コルナ	14,179,264	-	14,227,520	48,256
	ポーランド・ズロチ	3,041,961	-	2,919,180	122,781
	ユーロ	47,200,891	-	46,244,325	956,566
	売建				
	イギリス・ポンド	11,536,980	-	11,704,680	167,700
	デンマーク・クローネ	757,660	-	758,520	860
	ノルウェー・クローネ	580,730	-	576,240	4,490
	スウェーデン・クローナ	9,084,815	-	8,664,247	420,568
	セルビア・ディナール	14,713,615	-	14,299,618	413,997
	チェコ・コルナ	1,091,800	-	1,089,680	2,120
	ロシア・ルーブル	9,435,291	-	8,726,503	708,788
	ユーロ	87,710,066	-	85,872,321	1,837,745
	合計	-	-	264,290,627	907,009

区分	種類	平成30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	48,631,809	-	48,942,901	311,092
	スイス・フラン	2,353,202	-	2,456,370	103,168
	ノルウェー・クローネ	4,043,610	-	4,156,100	112,490
	スウェーデン・クローナ	4,730,603	-	4,791,893	61,290
	チェコ・コルナ	14,179,264	-	14,282,880	103,616
	ロシア・ルーブル	1,002,040	-	1,008,521	6,481
	ポーランド・ズロチ	11,047,750	-	11,316,262	268,512
	ユーロ	33,599,578	-	34,043,754	444,176
	売建				
	イギリス・ポンド	2,535,840	-	2,675,520	139,680
	スイス・フラン	2,404,920	-	2,456,370	51,450
	スウェーデン・クローナ	2,604,717	-	2,633,475	28,758
	セルビア・ディナール	14,754,745	-	15,055,039	300,294
	チェコ・コルナ	1,091,800	-	1,093,920	2,120
	ルーマニア・レイ	1,624,110	-	1,670,546	46,436
	ロシア・ルーブル	8,583,446	-	8,106,588	476,858
	ユーロ	85,988,278	-	87,172,747	1,184,469
	合計	-	-	241,862,886	134,476

(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30年3月28日 至 平成30年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成30年3月27日現在	平成30年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.3921円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,921円)」	1口当たり純資産額 1.3836円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,836円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

&lt;株式以外の有価証券&gt;

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	161,000.000	240,529.170	
	国債証券	UKT 4.75 12/07/30	16,000.000	21,418.560	
	国債証券	UKT 4.75 12/07/38	149,000.000	220,017.870	
	小計(イギリス・ポンド) 3銘柄		326,000.000	481,965.600 (71,687,563)	
デンマーク ・ク ローネ	国債証券	DGB 4.5 11/15/39	120,000.000	203,306.400	
	社債券	RDKRE 2 04/01/24	350,000.000	379,949.500	
	小計(デンマーク・クローネ) 2銘柄		470,000.000	583,255.900 (10,370,290)	
スウェー デン・ク ローナ	特殊債券	EIB 1.75 11/12/26	400,000.000	418,780.000	
	社債券	NDASS 1 04/08/22	900,000.000	917,757.000	
	小計(スウェーデン・クローナ) 2銘柄		1,300,000.000	1,336,537.000 (17,134,404)	
セルビア ・ディ ナール	国債証券	SERBGB 10 08/21/19	18,000,000.000	19,209,780.000	
	小計(セルビア・ディナール) 1銘柄		18,000,000.000	19,209,780.000 (21,509,191)	
ルーマニ ア・レイ	国債証券	ROMGB 5.85 04/26/23	350,000.000	372,743.000	
	小計(ルーマニア・レイ) 1銘柄		350,000.000	372,743.000 (10,611,993)	
ロシア・ ルーブル	国債証券	RFLB 8.15 02/03/27	4,100,000.000	4,029,234.000	
	小計(ロシア・ルーブル) 1銘柄		4,100,000.000	4,029,234.000 (6,889,990)	
ユーロ	国債証券	ALBANI 5.75 11/12/20	100,000.000	109,125.000	
	国債証券	ARGENT 3.375 01/15/23	100,000.000	85,636.000	

国債証券	BGB 0.8 06/22/25	38,000.000	38,962.540	
国債証券	BGB 4.25 03/28/41	77,000.000	116,246.900	
国債証券	BGB 4.5 03/28/26	70,000.000	90,601.700	
国債証券	BGB 5 03/28/35	16,000.000	24,744.160	
国債証券	BTPS 0.9 08/01/22	85,000.000	82,597.050	
国債証券	BTPS 2 12/01/25	81,000.000	79,013.880	
国債証券	BTPS 4.5 03/01/24	172,000.000	192,865.320	
国債証券	BTPS 4.75 09/01/28	29,000.000	34,066.880	
国債証券	BTPS 4.75 09/01/44	111,000.000	136,122.630	
国債証券	BTPS 5 03/01/22	74,000.000	82,544.780	
国債証券	BTPS 5 09/01/40	80,000.000	99,503.200	
国債証券	BTPS 5.5 09/01/22	371,000.000	424,231.080	
国債証券	CYPRUS 3.75 07/26/23	161,000.000	181,825.350	
国債証券	CYPRUS 3.875 05/06/22	130,000.000	144,939.600	
国債証券	DBR 0.25 02/15/27	93,000.000	92,195.550	
国債証券	DBR 1.25 08/15/48	45,000.000	46,216.800	
国債証券	FRTR 0.25 11/25/26	288,000.000	280,742.400	
国債証券	FRTR 1.25 05/25/36	143,000.000	141,148.150	
国債証券	FRTR 3.25 05/25/45	214,000.000	290,644.100	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	14,000.000	22,573.320	
国債証券	INDON 2.875 07/08/21	149,000.000	157,540.680	
国債証券	IRISH 2 02/18/45	21,000.000	21,849.870	
国債証券	IRISH 5.4 03/13/25	38,000.000	49,746.940	
国債証券	ISRAEL 2.875 01/29/24	100,000.000	111,267.000	
国債証券	MEX 3.625 04/09/29	100,000.000	113,851.000	
国債証券	PGB 3.875 02/15/30	70,000.000	82,075.000	
国債証券	PGB 4.95 10/25/23	32,000.000	38,707.520	
国債証券	RAGB 3.8 01/26/62	17,000.000	28,674.920	
国債証券	SLOREP 1.25 03/22/27	56,000.000	57,339.520	
国債証券	SLOREP 1.5 03/25/35	5,000.000	4,902.250	
国債証券	SLOREP 5.125 03/30/26	83,000.000	109,666.240	
国債証券	SPGB 1.5 04/30/27	88,000.000	89,275.120	
国債証券	SPGB 3.45 07/30/66	7,000.000	8,015.980	
国債証券	SPGB 5.15 10/31/44	50,000.000	75,735.000	
国債証券	SPGB 5.9 07/30/26	235,000.000	318,065.450	
社債券	CABKSM FL 07/14/28	100,000.000	101,719.000	
社債券	CMZB 4 03/23/26	50,000.000	53,977.000	
社債券	HETAR 2.375 12/13/22	300,000.000	322,965.000	
社債券	LOXAM 7 07/23/22	90,000.000	93,905.100	
社債券	NWIDE 6.75 07/22/20	50,000.000	55,765.000	
社債券	PEMEX 2.75 04/21/27	110,000.000	99,698.500	
社債券	PSMGR 2.625 04/15/21	4,000.000	4,183.160	
社債券	VERALL 8.25 02/15/22	100,000.000	104,858.000	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	52,917.000	
小計(ユーロ)46銘柄		4,397,000.000	4,953,246.640 (656,949,104)	
合計			795,152,535 (795,152,535)	

- (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	8.16%	9.02%
デンマーク・クローネ	国債証券 1銘柄	1.18%	1.30%
	社債券 1銘柄		
スウェーデン・クローナ	特殊債券 1銘柄	1.95%	2.15%
	社債券 1銘柄		
セルビア・ディナール	国債証券 1銘柄	2.45%	2.71%
ルーマニア・レイ	国債証券 1銘柄	1.21%	1.33%
ロシア・ルーブル	国債証券 1銘柄	0.78%	0.87%
ユーロ	国債証券 37銘柄	74.79%	82.62%
	社債券 9銘柄		

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

## アジア・オセアニア債券マザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分	平成30年3月27日現在 金額（円）	平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	8,144,510	98,242,630
金銭信託	1,853,449	-
コール・ローン	23,669,827	11,404,383
国債証券	251,376,070	387,680,396
特殊債券	607,955,583	418,647,077
派生商品評価勘定	-	35,131
未収利息	5,863,330	4,604,682
前払費用	-	675,364
流動資産合計	898,862,769	921,289,663
資産合計	898,862,769	921,289,663
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	80,896
未払金	-	78,624,804
その他未払費用	22	-
流動負債合計	22	78,705,700
負債合計	22	78,705,700
純資産の部		
元本等		
元本	667,325,149	615,338,516
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	231,537,598	227,245,447
元本等合計	898,862,747	842,583,963
純資産合計	898,862,747	842,583,963
負債純資産合計	898,862,769	921,289,663

[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30年3月28日 至 平成30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30年3月27日現在	平成30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	739,216,954円	667,325,149円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	71,891,805円	51,986,633円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	667,325,149円	615,338,516円
合計	667,325,149円	615,338,516円
2. 受益権の総数	667,325,149口	615,338,516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30年3月28日 至 平成30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、リスク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30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30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	2,047,421
特殊債券	1,282,853
合計	3,330,274

「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30年3月27日まで）を指しております。

（平成30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	1,649,460
特殊債券	234,219
合計	1,415,241

「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30年3月28日から平成30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30年3月27日現在）

該当事項はありません。

（通貨関連）

区分	種類	平成30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 オーストラリア・ドル	79,347,690	-	79,266,794	80,896
	売建 アメリカ・ドル	79,347,690	-	79,312,559	35,131
	合計	-	-	158,579,353	45,765

（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30年3月28日 至 平成30年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成30年3月27日現在	平成30年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.3470円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,470円）」	1口当たり純資産額 1.3693円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,693円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

## &lt;株式以外の有価証券&gt;

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
オーストラリア・ドル	国債証券	ACGB 2.25 05/21/28	1,000,000.000	959,150.000	
	特殊債券	ASIA 2.65 01/11/23	515,000.000	514,387.150	
	特殊債券	EUROF 6 03/30/22	500,000.000	556,240.000	
	特殊債券	IBRD 2.8 01/12/22	1,200,000.000	1,210,764.000	
	小計(オーストラリア・ドル) 4銘柄			3,215,000.000	3,240,541.150 (265,627,158)
香港・ドル	国債証券	HKGB 1.19 12/06/21	4,000,000.000	3,869,480.000	
	国債証券	HKGB 2.44 12/07/20	2,000,000.000	2,011,320.000	
	小計(香港・ドル) 2銘柄			6,000,000.000	5,880,800.000 (85,036,368)
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.25 06/01/21	1,000,000.000	1,003,800.000	
	小計(シンガポール・ドル) 1銘柄			1,000,000.000	1,003,800.000 (83,034,336)
ニュージーランド・ドル	特殊債券	IBRD 3.375 01/25/22	1,000,000.000	1,028,000.000	
	特殊債券	IBRD 3.5 01/22/21	1,000,000.000	1,027,220.000	
	特殊債券	RENTEN 4 01/30/20	1,000,000.000	1,023,890.000	
	小計(ニュージーランド・ドル) 3銘柄			3,000,000.000	3,079,110.000 (231,641,445)
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 4.25 06/10/21	300,000,000.000	317,301,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1銘柄			300,000,000.000	317,301,000.000 (32,174,321)
マレーシア・リンギット	国債証券	MGS 3.8 08/17/23	4,000,000.000	3,990,240.000	
	小計(マレーシア・リンギット) 1銘柄			4,000,000.000	3,990,240.000 (108,813,845)
合計				806,327,473 (806,327,473)	

- (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	国債証券	1銘柄	31.53%
	特殊債券	3銘柄	
香港・ドル	国債証券	2銘柄	10.09%
シンガポール・ドル	国債証券	1銘柄	9.85%
ニュージーランド・ドル	特殊債券	3銘柄	27.49%
韓国・ウォン	国債証券	1銘柄	3.82%
マレーシア・リンギット	国債証券	1銘柄	12.91%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)



## コモディティ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分	平成30年3月27日現在 金額（円）	平成30年9月27日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	895,077	754,602
社債券	444,369,391	462,213,429
未収利息	3,839,376	8,885,101
流動資産合計	449,103,844	471,853,132
資産合計	449,103,844	471,853,132
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	883,894,438	883,914,932
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	434,790,594	412,061,800
元本等合計	449,103,844	471,853,132
純資産合計	449,103,844	471,853,132
負債純資産合計	449,103,844	471,853,132

[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30年3月28日 至 平成30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30年3月27日現在	平成30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	1,013,118,413円	883,894,438円
期中追加設定元本額	-	20,494円
期中一部解約元本額	129,223,975円	-
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	883,894,438円	883,914,932円
合計	883,894,438円	883,914,932円
2. 受益権の総数	883,894,438口	883,914,932口
3. 元本の欠損	434,790,594円	412,061,800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30年3月28日 至 平成30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、リスク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30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30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	891,391
合計	891,391

「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30年3月27日まで）を指しております。

（平成30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	12,877,588
合計	12,877,588

「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30年3月28日から平成30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30年3月27日現在）

該当事項はありません。

（平成30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30年3月28日 至 平成30年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成30年3月27日現在	平成30年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.5081円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,081円）」	1口当たり純資産額 0.5338円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,338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 10/18/19	4,200,000.000	4,094,370.000	
	小計（アメリカ・ドル）1銘柄		4,200,000.000	4,094,370.000 (462,213,429)	
合計				462,213,429 (462,213,429)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	社債券 1銘柄	97.95%	100.00%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

（参考）

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

同ファンドの2017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、2017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

2017年12月31日現在

	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 ケッツ・エクイティ・ ファンド
	USD	USD	USD
<b>資産</b>			
有価証券（取得原価）	1,572,882,720	437,394,101	1,340,203,037
評価（損）益	39,581,314	1,082,979	620,333,077
有価証券（時価）	1,612,464,034	438,477,080	1,960,536,114
T B A取引（時価）	-	10,436,255	-
現金預金	41,179,460	17,397,628	77,617,843
有価証券売却に係る未収入金	27	-	492,167
未収配当金および未収利息	26,518,852	2,489,210	2,763,539
発行未収金	5,288,870	94,445,668	1,263,781
為替予約取引に係る評価益	9,713,841	1,801,129	-
オプション（時価）	433,046	-	-
先物取引に係る評価益	-	154,933	-
スワップ契約（時価）	475,517	46,957	-
委託証拠金	-	-	-
その他資産	5,413	3,579	3,497
<b>資産 合計</b>	<b>1,696,079,060</b>	<b>565,252,439</b>	<b>2,042,676,941</b>
<b>負債</b>			
有価証券購入に係る未払金	-	11,728,818	-
買戻未払金	1,021,370	92,407,849	1,286,130
為替予約取引に係る評価損	8,581,509	44,360	-
未払運用報酬	1,024,869	127,820	1,580,182
オプション（時価）	501,504	-	-
スワップ契約（時価）	2,561,709	-	-
委託証拠金	-	22,630	-
先物取引に係る評価損	-	119,393	-
当座借越	41,363	42,263	-

その他負債	695,192	160,833	835,262
<b>負債 合計</b>	<b>14,427,516</b>	<b>104,653,966</b>	<b>3,701,574</b>
<b>純資産</b>	<b>1,681,651,544</b>	<b>460,598,473</b>	<b>2,038,975,367</b>

## 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

2017年12月31日に終了した年度

	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 ケッツ・エクイ ティ・ファンド
	USD	USD	USD
<b>収益</b>			
受取利息(源泉税控除後)	103,732,383	10,435,007	64,575
受取配当金(源泉税控除後)	594,835	1,377	27,749,964
スワップに係る利息	444,615	4,970	-
<b>収益 合計</b>	<b>104,771,833</b>	<b>10,441,354</b>	<b>27,814,539</b>
<b>費用</b>			
運用報酬	14,541,311	1,248,075	18,752,272
預金利息	185,687	31,212	457,223
管理会社報酬	357,438	85,540	346,527
専門家報酬	40,803	27,430	15,468
年次税	632,059	52,797	336,360
スワップに係る利息	1,344,526	1,200	-
支払利息	2,743	429	16
その他費用	235,785	55,919	281,360
<b>費用 合計</b>	<b>17,340,352</b>	<b>1,502,602</b>	<b>20,189,226</b>
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	87,431,481	8,938,752	7,625,313
運用会社により免除または 負担された費用	58,336	24,003	35,202
<b>投資(損)益 合計</b>	<b>87,489,817</b>	<b>8,962,755</b>	<b>7,660,515</b>
<b>実現(損)益の内訳:</b>			
スイング・プライシング	658,490	180,795	917,016
有価証券(外国税控除後)	28,813,105	(1,674,210)	87,133,169
TBA取引	-	43,240	-
為替予約取引	4,142,070	2,308,910	(86,578)
先物取引	-	(183,163)	-
オプション	(695,900)	(19,447)	-
スワップ	2,019,741	(44,122)	-
外貨取引	397,963	34,830	(203,771)

実現(損)益 合計	35,335,469	646,833	87,759,836
評価(損)益の変動:			
有価証券(外国税控除後)	14,444,225	6,123,770	530,360,937
TBA取引	-	(10,096)	-
為替予約取引	27,984,172	5,580,545	-
先物取引	-	26,476	-
オプション	(294,103)	(2,031)	-
スワップ	(2,889,160)	46,957	-
外貨建のその他の資産および負債	(6,891)	(1)	224,760
評価(損)益の変動 合計	39,238,243	11,765,620	530,585,697
運用による純資産の純増(減)額	162,063,529	21,375,208	626,006,048
分配金:			
分配による純資産の減少額	(9,389,397)	(1,382,877)	(73,116)
資本取引:			
投資証券発行受領額	798,130,364	318,152,518	502,096,624
投資証券買戻支払額	(949,055,368)	(215,642,371)	(479,657,482)
資本取引による純資産の純増(減)額	(150,925,004)	102,510,147	22,439,142
純資産の増(減)額 合計	1,749,128	122,502,478	648,372,074
期首現在純資産	1,679,902,416	338,095,995	1,390,603,293
換算調整	-	-	-
期末現在純資産	1,681,651,544	460,598,473	2,038,975,367

## 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

2017年12月31日に終了した年度

	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 ケッツ・エクイ ティ・ファンド
(特段の注記のない限り金額は米ドル)	USD	USD	USD
クラスJd			
期首現在発行済投資証券	5,099,459	4,672,065	646,494
発行投資証券口数	290,602	140,885	8,209
買戻投資証券口数	(796,753)	(565,621)	(225,465)
期末現在発行済投資証券	4,593,308	4,247,329	429,238

## ティー・ロウ・プライス・ファンズ SICAV

## 一口当たり純資産額

	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 ケッツ・エクイ ティ・ファンド
(特段の注記のない限り金額は米ドル)	USD	USD	USD
以下の時点のクラスJd証券一口当たり純資産額:			
2017年12月31日	9.97	10.88	10.07
2016年12月31日	9.79	10.72	7.08
2015年12月31日	9.05	10.71	6.35

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

2017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(%)
<b>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</b>				
<b>債券</b>				
<b>アルゼンチン</b>				
Codere Finance 2 Luxembourg SA, Reg. S 7.625% 01/11/2021	USD	2,010,000	2,047,828	0.12
YPF SA, 144A 8.5% 23/03/2021	USD	3,010,000	3,405,258	0.20
YPF SA, Reg. S 8.5% 28/07/2025	USD	8,100,000	9,414,590	0.56
			<b>14,867,676</b>	<b>0.88</b>
<b>オーストリア</b>				
Erste Group Bank AG, Reg. S, FRN 6.875% Perpetual	EUR	1,600,000	2,350,896	0.14
			<b>2,350,896</b>	<b>0.14</b>
<b>ブラジル</b>				
Minerva Luxembourg SA, 144A 6.5% 20/09/2026	USD	4,590,000	4,703,006	0.28
Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/01/2022	USD	2,163,000	2,299,096	0.14
Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2025	USD	4,440,000	5,301,027	0.31
Petrobras Global Finance BV 6.875% 20/01/2040	USD	1,855,000	1,879,866	0.11
Petrobras Global Finance BV 6.75% 27/01/2041	USD	2,835,000	2,846,170	0.17
			<b>17,029,165</b>	<b>1.01</b>
<b>カナダ</b>				
Conovus Energy, Inc. 6.75% 15/11/2039	USD	775,000	929,140	0.05
Teck Resources Ltd. 6% 15/08/2040	USD	1,555,000	1,724,728	0.10
Teck Resources Ltd. 6.25% 15/07/2041	USD	2,015,000	2,296,485	0.14
			<b>4,950,353</b>	<b>0.29</b>
<b>チリ</b>				
VTR Finance BV, Reg. S 6.875% 15/01/2024	USD	2,210,000	2,341,528	0.14
			<b>2,341,528</b>	<b>0.14</b>
<b>コロンビア</b>				
Millicom International Cellular SA, Reg. S 5.125% 15/01/2028	USD	590,000	592,086	0.04
			<b>592,086</b>	<b>0.04</b>
<b>フランス</b>				
BNP Paribas SA, Reg. S, FRN 7.375% Perpetual	USD	4,090,000	4,734,870	0.28
Credit Agricole SA, FRN, 144A 7.875% Perpetual	USD	6,855,000	7,771,376	0.46
Horizon Holdings I SAS, Reg. S 7.25% 01/08/2023	EUR	2,100,000	2,686,396	0.16
Horizon Parent Holdings Sarl, Reg. S 8.25% 15/02/2022	EUR	2,445,000	3,132,497	0.19
Lovam SAS, Reg. S 4.25% 15/04/2024	EUR	415,000	532,585	0.03
Lovam SAS, Reg. S 6% 15/04/2025	EUR	650,000	851,537	0.05
Societe Generale SA, FRN, 144A 7.375% Perpetual	USD	3,965,000	4,288,544	0.26
			<b>20,997,805</b>	<b>1.43</b>
<b>ドイツ</b>				
Garfunkelux Holdco 3 SA, Reg. S 8.5% 01/11/2022	GBP	1,675,000	2,378,225	0.14
Kirk Beauty One GmbH, Reg. S 8.75% 15/07/2023	EUR	725,000	932,576	0.06
Safari Holding Verwaltungs GmbH, Reg. S 8.25% 15/02/2021	EUR	1,135,407	1,406,619	0.08
Safari Holding Verwaltungs GmbH, Reg. S 6.375% 30/11/2022	EUR	2,120,000	2,570,886	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(%)
Unitymoda GmbH, Reg. S 3.75% 15/01/2027	EUR	2,860,000	3,506,909	0.21
			<b>10,795,215</b>	<b>0.64</b>
<b>インドネシア</b>				
TBG Global Pte. Ltd., Reg. S 5.25% 10/02/2022	USD	1,625,000	1,663,766	0.10
			<b>1,663,766</b>	<b>0.10</b>
<b>アイルランド</b>				
Europcar Groupe SA, Reg. S 4.125% 15/11/2024	EUR	2,030,000	2,441,404	0.15
			<b>2,441,404</b>	<b>0.15</b>
<b>イタリア</b>				
Intor Media Communication Srl, Reg. S 4.875% 31/12/2022	EUR	2,950,000	3,622,414	0.22
International Game Technology plc, 144A 6.25% 15/02/2022	USD	2,015,000	2,186,431	0.13
			<b>5,810,845</b>	<b>0.35</b>
<b>日本</b>				
SoftBank Group Corp., Reg. S 5.125% 19/09/2027	USD	6,880,000	6,837,715	0.41
Universal Entertainment Corp., Reg. S, 144A 8.5% 24/08/2020	USD	3,125,000	3,246,094	0.19
			<b>10,063,809</b>	<b>0.60</b>
<b>カザフスタン</b>				
Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC, Reg. S 7.25% 28/01/2021	USD	640,000	705,091	0.04
			<b>705,091</b>	<b>0.04</b>
<b>ルクセンブルグ</b>				
Affico Financing SA, 144A 7.5% 15/05/2026	USD	9,535,000	10,153,917	0.60
Affico Finco SA, 144A 8.125% 15/01/2024	USD	4,582,000	4,806,809	0.29
Amigo Luxembourg SA, Reg. S 7.625% 15/01/2024	GBP	2,480,000	3,499,268	0.21
ArcolorMittal 6.125% 01/06/2025	USD	780,000	896,703	0.05
ArcolorMittal 7.5% 15/10/2039	USD	2,510,000	3,219,251	0.19
ArcolorMittal 7.25% 01/03/2041	USD	260,000	327,641	0.02
Kleopatra Holdings 1 SCA, Reg. S 8.5% 30/06/2023	EUR	5,020,000	6,159,035	0.37
Millicom International Cellular SA, 144A 6% 15/03/2025	USD	1,600,000	1,707,112	0.10
			<b>30,774,736</b>	<b>1.63</b>
<b>オランダ</b>				
ING Groep NV, Reg. S, FRN 6.875% Perpetual	USD	4,085,000	4,474,137	0.27
Ziggo Bond Finance BV, 144A 6% 15/01/2027	USD	4,000,000	3,910,000	0.23
			<b>8,384,137</b>	<b>0.50</b>
<b>ノルウェー</b>				
DNB Bank ASA, Reg. S, FRN 6.5% Perpetual	USD	1,750,000	1,884,041	0.11
			<b>1,884,041</b>	<b>0.11</b>
<b>スペイン</b>				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S, FRN 7% Perpetual	EUR	3,200,000	4,043,953	0.24
Codere Finance 2 Luxembourg SA, 144A 7.625% 01/11/2021	USD	2,030,000	2,066,418	0.13
LHC3 plc, Reg. S 4.125% 15/08/2024	EUR	1,520,000	1,869,089	0.11
			<b>7,979,460</b>	<b>0.48</b>
<b>スイス</b>				
Credit Suisse Group AG, FRN, 144A 6.25% Perpetual	USD	3,245,000	3,523,161	0.21
Credit Suisse Group AG, FRN, 144A 7.5% Perpetual	USD	2,555,000	2,924,696	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(%)
Credit Suisse Group AG, Reg. S, FRN 7.125% Perpetual	USD	3,355,000	3,667,418	0.22
SIG Combibloc Holdings SCA, Reg. S 7.75% 15/02/2023	EUR	3,395,000	4,266,165	0.25
UBS Group AG, Reg. S, FRN 7.125% Perpetual	USD	3,920,000	4,273,996	0.26
			<b>18,655,428</b>	<b>1.11</b>
<b>トリニダード・トバゴ</b>				
Consolidated Energy Finance SA, 144A 6.875% 15/06/2025	USD	5,030,000	5,344,375	0.32
			<b>5,344,375</b>	<b>0.32</b>
<b>イギリス</b>				
Aston Martin Capital Holdings Ltd., 144A 6.5% 15/04/2022	USD	3,965,000	4,196,635	0.25
Barclays plc, Reg. S, FRN 7.875% Perpetual	GBP	3,560,000	5,365,859	0.32
Cabot Financial Luxembourg SA, Reg. S 7.5% 01/10/2023	GBP	2,145,000	3,045,621	0.18
Debenhams plc, Reg. S 5.25% 15/07/2021	GBP	700,000	948,346	0.06
Island Bondco plc, Reg. S 4.625% 15/03/2025	GBP	1,380,000	1,766,287	0.11
INEOS Group Holdings SA, Reg. S 5.375% 01/08/2024	EUR	3,575,000	4,589,840	0.27
Standard Chartered plc, FRN, 144A 7.5% Perpetual	USD	9,525,000	10,308,050	0.61
Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC, Reg. S 5.5% 15/09/2024	GBP	1,765,000	2,413,270	0.14
			<b>32,633,908</b>	<b>1.94</b>
<b>アメリカ</b>				
AES Corp. 5.6% 15/03/2024	USD	3,210,000	3,352,781	0.20
AES Corp. 6% 15/05/2025	USD	2,030,000	2,195,932	0.13
AES Corp. 5.125% 01/09/2027	USD	2,700,000	2,856,600	0.17
AGCO Corp. 5.875% 01/12/2021	USD	2,680,000	2,892,578	0.17
Aircastle Ltd. 5.5% 15/02/2022	USD	1,985,000	2,132,079	0.13
AK Steel Corp. 6.375% 15/10/2025	USD	8,450,000	8,418,286	0.50
Alliance Data Systems Corp., Reg. S 5.25% 15/11/2023	EUR	3,840,000	4,835,174	0.29
Aly Financial, Inc. 5.125% 30/09/2024	USD	645,000	701,808	0.04
Aly Financial, Inc. 5.75% 20/11/2025	USD	7,485,000	8,152,849	0.48
AMC Entertainment Holdings, Inc. 5.75% 15/06/2025	USD	8,115,000	8,076,494	0.48
Andeavor Logistics LP 5.25% 15/01/2025	USD	1,965,000	2,066,600	0.12
B&G Foods, Inc. 5.25% 01/04/2025	USD	2,960,000	3,008,870	0.18
Boardwalk Pipelines LP 5.95% 01/06/2026	USD	1,135,000	1,269,617	0.08
Boyd Gaming Corp. 6.375% 01/04/2026	USD	4,410,000	4,772,127	0.28
Carlson Travel, Inc., 144A 6.75% 15/12/2023	USD	750,000	684,375	0.04
Centene Corp. 5.625% 15/02/2021	USD	1,185,000	1,222,031	0.07
Centene Corp. 6.125% 15/02/2024	USD	805,000	858,134	0.05
CenturyLink, Inc. 7.5% 01/04/2024	USD	3,165,000	3,165,285	0.19
CF Industries, Inc. 5.375% 15/03/2044	USD	3,635,000	3,601,340	0.21
Chocapeake Energy Corp. 6.125% 15/02/2021	USD	1,750,000	1,783,285	0.11
CNO Financial Group, Inc. 5.25% 30/05/2025	USD	3,350,000	3,542,776	0.21
Community Health Systems, Inc. 6.25% 31/03/2023	USD	6,485,000	5,860,203	0.36
Continental Resources, Inc. 4.5% 15/04/2023	USD	3,000,000	3,062,310	0.18

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Crestwood Midstream Partners LP 6.25% 01/04/2023	USD	4,330,000	4,524,850	0.27
Crown Cork & Seal Co., Inc. 7.375% 15/12/2026	USD	226,000	262,798	0.02
DaVita, Inc. 5.125% 15/07/2024	USD	4,155,000	4,223,931	0.25
DaVita, Inc. 5% 01/05/2025	USD	4,155,000	4,168,878	0.25
DCP Midstream Operating LP 8.125% 16/08/2030	USD	425,000	498,312	0.03
DPL, Inc. 7.25% 15/10/2021	USD	3,910,000	4,346,102	0.26
Energy Transfer Equity LP 5.5% 01/06/2027	USD	2,630,000	2,678,602	0.16
Eneco plc 8% 31/01/2024	USD	4,496,000	4,517,626	0.27
Ferrogas LP 6.5% 01/06/2021	USD	3,105,000	2,940,404	0.17
Ferrogas LP 6.75% 15/06/2023	USD	825,000	753,774	0.04
FreightMcMoran, Inc. 5.4% 14/11/2034	USD	6,115,000	6,229,503	0.37
FreightMcMoran, Inc. 5.45% 15/03/2043	USD	6,010,000	5,951,463	0.35
HCA, Inc. 5% 15/03/2024	USD	6,300,000	6,594,619	0.39
HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	245,000	254,949	0.02
HCA, Inc. 5.25% 15/06/2026	USD	3,035,000	3,232,047	0.19
HCA, Inc. 5.5% 15/06/2047	USD	6,665,000	6,697,625	0.40
Hess Corp. 7.875% 01/10/2029	USD	1,955,000	2,438,028	0.14
Intelat Jackson Holdings SA 7.25% 15/10/2020	USD	5,990,000	5,660,550	0.34
Intelat Jackson Holdings SA 7.5% 01/04/2021	USD	3,540,000	3,239,100	0.19
Kosmos Energy Ltd., 144A 7.875% 01/08/2021	USD	4,460,000	4,582,660	0.27
Kosmos Energy Ltd., 144A 7.875% 01/08/2021	USD	6,360,000	6,534,900	0.39
Laredo Petroleum, Inc. 6.25% 15/03/2023	USD	2,610,000	2,707,314	0.16
Level 3 Financing, Inc. 5.625% 01/02/2023	USD	3,260,000	3,299,691	0.20
Level 3 Financing, Inc. 5.375% 01/05/2025	USD	5,390,000	5,391,671	0.32
Level 3 Parent LLC 5.75% 01/12/2022	USD	1,675,000	1,686,156	0.10
Matador Resources Co. 6.875% 15/04/2023	USD	4,830,000	5,095,650	0.30
MGM Growth Properties Operating Partnership LP, REIT 5.625% 01/05/2024	USD	1,475,000	1,578,973	0.09
MGM Resorts International 6% 15/03/2023	USD	2,075,000	2,251,458	0.13
Molina Healthcare, Inc. 5.375% 15/11/2022	USD	2,055,000	2,152,612	0.13
MPT Operating Partnership LP, REIT 6.375% 01/03/2024	USD	1,900,000	2,022,236	0.12
MPT Operating Partnership LP, REIT 5% 15/10/2027	USD	4,240,000	4,333,174	0.26
New Albertson's, Inc. 7.46% 01/08/2029	USD	1,450,000	1,290,500	0.08
New Albertson's, Inc. 8% 01/06/2031	USD	850,000	775,625	0.06
NGL Energy Partners LP 7.5% 01/11/2023	USD	5,285,000	5,483,187	0.33
NRG Energy, Inc. 7.25% 15/05/2026	USD	10,650,000	11,598,063	0.69
NRG Energy, Inc. 6.625% 15/01/2027	USD	6,475,000	6,860,101	0.41
NuStar Logistics LP 4.8% 01/09/2020	USD	355,000	363,153	0.02
NuStar Logistics LP 5.625% 28/04/2027	USD	2,795,000	2,849,684	0.17
Outfront Media Capital LLC 5.625% 15/02/2024	USD	1,185,000	1,237,821	0.07
Pride International, Inc. 6.875% 15/08/2020	USD	1,641,000	1,716,691	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 (%)
OEP Resources, Inc. 6.875% 01/03/2021	USD	3,935,000	4,252,397	0.25
OEP Resources, Inc. 6.375% 01/10/2022	USD	2,825,000	2,893,266	0.17
Royal Entertainment Group 5.75% 15/03/2022	USD	4,400,000	4,540,800	0.27
Rowan Cos., Inc. 7.375% 15/06/2025	USD	1,695,000	1,734,494	0.10
Sonic Automotive, Inc. 6.125% 15/03/2027	USD	2,540,000	2,532,062	0.15
Southwestern Energy Co. 7.5% 01/04/2026	USD	4,200,000	4,459,056	0.27
Sprint Capital Corp. 6.875% 15/11/2028	USD	2,330,000	2,347,277	0.14
Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	USD	3,988,000	4,547,855	0.27
Sprint Communications, Inc. 7% 15/08/2020	USD	2,010,000	2,132,188	0.13
Sprint Corp. 7.25% 15/09/2021	USD	8,130,000	8,602,719	0.51
Suburban Propane Partners LP 5.5% 01/06/2024	USD	960,000	952,027	0.06
Tenet Healthcare Corp. 8.125% 01/04/2022	USD	4,655,000	4,660,460	0.28
Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	USD	5,695,000	5,510,454	0.33
United Continental Holdings, Inc. 6% 01/12/2020	USD	2,950,000	3,180,867	0.19
United Rentals North America, Inc. 5.5% 15/05/2027	USD	1,985,000	2,099,664	0.12
United Rentals North America, Inc. 4.875% 15/01/2028	USD	6,230,000	6,281,211	0.37
United States Steel Corp. 6.875% 15/08/2025	USD	3,370,000	3,515,213	0.21
Vantiv LLC, Reg. S 3.875% 15/11/2025	GBP	2,930,000	4,012,442	0.24
VEREIT Operating Partnership LP, REIT 4.875% 01/06/2026	USD	2,965,000	3,140,854	0.19
Vista Outdoor, Inc. 5.875% 01/10/2023	USD	4,765,000	4,608,827	0.27
Weatherford International Ltd. 7.75% 15/06/2021	USD	3,120,000	3,183,040	0.19
Wolbit, Inc. 9.5% 15/02/2024	USD	2,055,000	2,350,406	0.14
Western Digital Corp. 10.5% 01/04/2024	USD	11,350,000	13,166,624	0.78
William Lyon Homes, Inc. 7% 15/08/2022	USD	3,395,000	3,505,338	0.21
William Lyon Homes, Inc. 5.875% 31/01/2025	USD	1,440,000	1,474,200	0.09
WPX Energy, Inc. 8.25% 01/08/2023	USD	4,575,000	5,187,684	0.31
Yum Brands, Inc. 6.875% 15/11/2037	USD	1,040,000	1,144,198	0.07
Yum Brands, Inc. 5.35% 01/11/2043	USD	3,635,000	3,555,575	0.21
Zayo Group LLC 6.375% 15/06/2025	USD	4,535,000	4,800,502	0.29
			<b>335,897,895</b>	<b>19.97</b>
<b>債券 計</b>			<b>530,183,617</b>	<b>32.07</b>
<b>株式</b>				
<b>カナダ</b>				
New Gold, Inc.	USD	532,020	1,739,705	0.10
			<b>1,739,705</b>	<b>0.10</b>
<b>コロンビア</b>				
Fronteira Energy Corp. SL	USD	21,600	668,196	0.04
Fronteira Energy Corp. SL	CAD	93,855	2,959,358	0.18
			<b>3,627,554</b>	<b>0.22</b>
<b>オランダ</b>				
Constellium NV 'A'	USD	133,275	1,479,353	0.09
			<b>1,479,353</b>	<b>0.09</b>

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
<b>イギリス</b>				
Liberty Global plc LILAC 'C'	USD	2,841	50,464	-
			50,464	-
<b>アメリカ</b>				
Bocton Dickinson and Co. Preference 6.125%	USD	58,600	3,423,412	0.21
Caesars Entertainment Corp.	USD	245,898	3,067,578	0.18
Crown Castle International Corp., REIT Preference 6.875%	USD	1,700	1,903,660	0.11
Hess Corp. Preference 8%	USD	58,485	3,414,939	0.20
Howard Hughes Corp. (The)	USD	13,735	1,804,642	0.11
Lands' End, Inc.	USD	1,228	24,376	-
Liberty Broadband Corp. 'A'	USD	20,260	1,719,669	0.10
Liberty Broadband Corp. 'C'	USD	25,750	2,187,462	0.13
NextEra Energy, Inc. Preference 6.123%	USD	60,766	3,463,314	0.21
T-Mobile US, Inc.	USD	71,650	4,591,332	0.27
			25,990,384	1.52
<b>株式 計</b>			32,487,460	1.93
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			571,671,077	34.00

### 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

FMG Resources August 2006 Pty. Ltd., 144A 9.75% 01/03/2022	USD	12,620,000	13,896,580	0.83
FMG Resources August 2006 Pty. Ltd., 144A 4.75% 15/05/2022	USD	2,025,000	2,056,296	0.12
FMG Resources August 2006 Pty. Ltd., 144A 5.125% 15/05/2024	USD	2,940,000	2,987,775	0.18
			19,039,051	1.13

#### ベルギー

Barry Callebaut Services NV, Reg. S 5.5% 15/06/2023	USD	8,845,000	9,680,852	0.58
			9,680,852	0.58

#### ブラジル

Avon International Operations, Inc., 144A 7.875% 15/08/2022	USD	5,390,000	5,511,275	0.33
Banco do Brasil SA, Reg. S, FRN 8% Perpetual	USD	5,425,000	5,843,403	0.36
			11,354,678	0.68

#### カナダ

1011778 BC ULC, 144A 4.625% 15/01/2022	USD	2,100,000	2,148,174	0.13
1011778 BC ULC, 144A 5% 15/10/2025	USD	12,050,000	12,223,821	0.73
Cascades, Inc., 144A 5.5% 15/07/2022	USD	1,140,000	1,174,200	0.07
Cascades, Inc., 144A 6.75% 15/07/2023	USD	5,585,000	5,866,484	0.35
Hudbay Minerals, Inc., 144A 7.25% 15/01/2023	USD	1,430,000	1,522,950	0.09
Hudbay Minerals, Inc., 144A 7.625% 15/01/2025	USD	9,070,000	10,000,038	0.59
Masonite International Corp., 144A 5.625% 15/03/2023	USD	1,275,000	1,335,562	0.08
MEG Energy Corp., 144A 7% 31/03/2024	USD	3,765,000	3,212,242	0.19

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
MEG Energy Corp., 144A 6.5% 15/01/2025	USD	2,460,000	2,426,175	0.14
New Gold, Inc., 144A 6.25% 15/11/2022	USD	3,685,000	3,710,475	0.22
New Gold, Inc., 144A 6.375% 15/06/2025	USD	1,900,000	1,996,976	0.12
Norbond, Inc., 144A 6.25% 15/04/2023	USD	1,810,000	1,984,213	0.12
Northwest Acquisitions ULIC, 144A 7.125% 01/11/2022	USD	2,115,000	2,189,025	0.13
Seven Generations Energy Ltd., 144A 6.75% 01/05/2023	USD	3,930,000	4,158,333	0.25
Seven Generations Energy Ltd., 144A 6.875% 30/06/2023	USD	1,295,000	1,384,031	0.08
Seven Generations Energy Ltd., 144A 6.375% 30/09/2025	USD	3,685,000	3,731,062	0.22
Telesat Canada, 144A 8.875% 15/11/2024	USD	2,280,000	2,522,951	0.15
Videotron Ltd., 144A 5.125% 15/04/2027	USD	2,190,000	2,294,025	0.14
			<b>63,880,737</b>	<b>3.80</b>
<b>チリ</b>				
VTR Finance BV, 144A 6.875% 15/01/2024	USD	2,275,000	2,405,812	0.14
			<b>2,405,812</b>	<b>0.14</b>
<b>コロンビア</b>				
Frontera Energy Corp., 144A 10% 02/11/2021	USD	1,820,000	2,074,800	0.12
Frontera Energy Corp., Reg. S 10% 02/11/2021	USD	3,754,000	4,279,560	0.26
			<b>6,354,360</b>	<b>0.38</b>
<b>ドイツ</b>				
Unifmedia GmbH, Reg. S 6.125% 15/01/2025	USD	2,505,000	2,645,618	0.16
Unifmedia Hessen GmbH & Co. KG, Reg. S 5% 15/01/2025	USD	3,195,000	3,294,461	0.19
			<b>5,940,079</b>	<b>0.35</b>
<b>香港</b>				
Nexteer Automotive Group Ltd., Reg. S 6.875% 15/11/2021	USD	2,390,000	2,494,288	0.15
			<b>2,494,288</b>	<b>0.15</b>
<b>アイルランド</b>				
Ardagh Packaging Finance plc, 144A 7.25% 15/05/2024	USD	8,218,000	8,965,222	0.53
Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 6.25% 15/08/2022	USD	405,000	404,494	0.02
Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 4.5% 15/03/2023	USD	6,235,000	5,985,600	0.36
Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 5.5% 15/02/2024	USD	3,690,000	3,685,018	0.22
			<b>19,040,334</b>	<b>1.13</b>
<b>イタリア</b>				
International Game Technology plc, 144A 6.5% 15/02/2025	USD	6,090,000	6,840,592	0.41
Intesa Sanpaolo SpA, FRN, 144A 7.7% Perpetual	USD	7,720,000	8,407,389	0.50
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 8% Perpetual	USD	7,535,000	8,276,218	0.49
			<b>23,524,199</b>	<b>1.40</b>
<b>ジャマイカ</b>				
Digital Group Ltd., Reg. S 8.25% 30/09/2020	USD	6,925,000	6,844,878	0.41
			<b>6,844,878</b>	<b>0.41</b>

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
<b>ルクセンブルグ</b>				
Alice Luxembourg SA, 144A 7.625% 15/02/2025	USD	19,503,000	18,705,035	1.11
ARD Finance SA 7.125% 15/09/2023	USD	4,535,000	4,759,936	0.29
			<b>23,464,971</b>	<b>1.40</b>
<b>オランダ</b>				
Constellium NV, 144A 6.625% 01/03/2025	USD	6,875,000	7,261,719	0.43
Constellium NV, 144A 5.875% 15/02/2026	USD	2,735,000	2,789,700	0.17
Sensata Technologies UK Financing Co. plc, 144A 6.25% 15/02/2026	USD	3,260,000	3,557,667	0.21
UPCB Finance IV Ltd., 144A 5.375% 15/01/2025	USD	4,560,000	4,595,273	0.27
Ziggo Bond Finance BV, Reg. S 5.875% 15/01/2025	USD	800,000	785,000	0.05
Ziggo Secured Finance BV, 144A 5.5% 15/01/2027	USD	380,000	379,441	0.02
			<b>19,368,620</b>	<b>1.15</b>
<b>パナマ</b>				
C&W Senior Financing Designated Activity Co., Reg. S 6.875% 15/09/2027	USD	3,145,000	3,298,885	0.20
			<b>3,298,885</b>	<b>0.20</b>
<b>スイス</b>				
Transocean, Inc., 144A 7.5% 15/01/2026	USD	2,335,000	2,379,634	0.14
			<b>2,379,634</b>	<b>0.14</b>
<b>トリニダード・トバゴ</b>				
Consolidated Energy Finance SA, Reg. S 6.75% 15/10/2019	USD	1,670,000	1,701,313	0.10
			<b>1,701,313</b>	<b>0.10</b>
<b>アラブ首長国連邦</b>				
DAE Funding LLC, 144A 4% 01/08/2020	USD	1,700,000	1,711,976	0.10
DAE Funding LLC, 144A 4.5% 01/08/2022	USD	1,920,000	1,890,509	0.11
DAE Funding LLC, 144A 5% 01/08/2024	USD	2,010,000	1,885,307	0.12
			<b>5,587,792</b>	<b>0.33</b>
<b>イギリス</b>				
Ashtead Capital, Inc., 144A 4.125% 15/08/2025	USD	1,650,000	1,667,985	0.10
Ashtead Capital, Inc., 144A 4.375% 15/08/2027	USD	1,870,000	1,907,400	0.11
Royal Bank of Scotland Group plc, FRN 7.5% Perpetual	USD	605,000	535,113	0.03
Royal Bank of Scotland Group plc, FRN 8.625% Perpetual	USD	3,560,000	4,003,522	0.24
Virgin Media Secured Finance plc, 144A 5.25% 15/01/2026	USD	4,340,000	4,419,509	0.26
Virgin Media Secured Finance plc, 144A 5.5% 15/08/2026	USD	2,590,000	2,662,559	0.16
			<b>15,196,088</b>	<b>0.90</b>
<b>アメリカ</b>				
Acquire LLC, 144A 7% 15/11/2025	USD	4,700,000	4,570,750	0.27
ADT Corp. (The) 6.25% 15/10/2021	USD	6,590,000	7,215,862	0.43
Advanced Disposal Services, Inc., 144A 5.625% 15/11/2024	USD	2,320,000	2,410,758	0.14
Advanced Micro Devices, Inc. 7% 01/07/2024	USD	6,365,000	6,617,563	0.39
Albertsons Cos. LLC 6.625% 15/06/2024	USD	3,795,000	3,627,261	0.22
Albertsons Cos. LLC 5.75% 15/03/2025	USD	3,820,000	3,458,131	0.21

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Alliance Data Systems Corp., 144A 5.875% 01/11/2021	USD	2,793,000	2,839,616	0.17
Alliance Resource Operating Partners LP, 144A 7.5% 01/05/2025	USD	2,050,000	2,185,812	0.13
Alliant Holdings Intermediate LLC, 144A 8.25% 01/08/2023	USD	7,785,000	8,193,713	0.49
Allion Transmission, Inc., 144A 5% 01/10/2024	USD	5,530,000	5,703,587	0.34
AMC Networks, Inc. 4.75% 01/08/2025	USD	1,960,000	1,949,259	0.12
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 'B', 144A 5.625% 15/07/2022	USD	693,907	723,637	0.04
American Axle & Manufacturing, Inc., 144A 6.25% 01/04/2025	USD	8,180,000	8,620,877	0.51
American Greetings Corp., 144A 7.875% 15/02/2025	USD	1,580,000	1,714,300	0.10
Apex Tool Group LLC, 144A 7% 01/02/2021	USD	5,795,000	5,606,663	0.33
Archrock Partners LP 6% 01/04/2021	USD	1,275,000	1,281,376	0.08
Archrock Partners LP 6% 01/10/2022	USD	2,670,000	2,629,016	0.16
AssuredPartners, Inc., 144A 7% 15/08/2025	USD	3,475,000	3,466,312	0.21
AV Homes, Inc. 6.625% 15/05/2022	USD	1,495,000	1,567,732	0.09
Beacon Escrow Corp., 144A 4.875% 01/11/2025	USD	1,445,000	1,451,127	0.09
Big River Steel LLC, 144A 7.25% 01/09/2025	USD	3,755,000	3,980,300	0.24
Block Communications, Inc., 144A 6.875% 15/02/2025	USD	1,305,000	1,374,517	0.08
Booz Allen Hamilton, Inc., 144A 5.125% 01/05/2025	USD	2,070,000	2,080,360	0.12
Brand Industrial Services, Inc., 144A 8.5% 15/07/2025	USD	2,670,000	2,810,175	0.17
Brink's Co. (The), 144A 4.625% 15/10/2027	USD	4,245,000	4,176,019	0.25
BWAY Holding Co., 144A 5.5% 15/04/2024	USD	5,870,000	6,124,464	0.36
BWAY Holding Co., 144A 7.25% 15/04/2025	USD	3,115,000	3,219,602	0.19
Carizzo Oil & Gas, Inc. 8.25% 15/07/2025	USD	2,090,000	2,299,000	0.14
CCO Holdings LLC, 144A 5.5% 01/05/2026	USD	12,020,000	12,350,550	0.73
CCO Holdings LLC, 144A 5% 01/02/2028	USD	15,785,000	15,360,778	0.91
CDK Global, Inc., 144A 4.875% 01/06/2027	USD	4,915,000	4,988,725	0.30
CDW LLC 5% 01/09/2025	USD	4,830,000	5,014,506	0.30
Centennial Resource Production LLC, 144A 5.375% 15/01/2026	USD	1,730,000	1,766,762	0.10
Central Garden & Pet Co. 5.125% 01/02/2028	USD	1,770,000	1,776,230	0.11
Coquel Communications Holdings I LLC, 144A 6.375% 15/09/2020	USD	4,313,000	4,389,017	0.26
Coquel Communications Holdings I LLC, 144A 7.75% 15/07/2025	USD	3,720,000	3,968,980	0.24
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/06/2024	USD	3,505,000	3,989,882	0.24
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31/03/2025	USD	1,985,000	2,156,474	0.13
Chesapeake Energy Corp., 144A 8% 15/06/2027	USD	1,690,000	1,634,745	0.10
Chesapeake Energy Corp., Reg. S 8% 15/12/2022	USD	1,908,000	2,065,410	0.12
Chobani LLC, 144A 7.5% 15/04/2025	USD	7,380,000	7,850,476	0.47



銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 7.625% 15/03/2020	USD	3,440,000	3,389,742	0.20
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 6.5% 15/11/2022	USD	5,010,000	5,098,902	0.30
CommScope Technologies LLC, 144A 6% 15/06/2025	USD	4,465,000	4,754,888	0.28
Continental Resources, Inc., 144A 4.375% 15/01/2028	USD	2,945,000	2,904,815	0.17
Covey Park Energy LLC, 144A 7.5% 15/05/2025	USD	2,495,000	2,607,450	0.15
CRC Escrow Issuer LLC, 144A 5.25% 15/10/2025	USD	6,905,000	6,971,323	0.41
CrownRock LP, 144A 5.625% 15/10/2025	USD	3,450,000	3,456,520	0.21
CSC Holdings LLC, 144A 6.625% 15/10/2025	USD	3,080,000	3,341,738	0.20
CSC Holdings LLC, 144A 10.875% 15/10/2025	USD	11,129,000	13,257,421	0.79
CDI Compresso LP 7.25% 15/08/2022	USD	3,795,000	3,595,763	0.21
CVR Partners LP, 144A 9.25% 15/06/2023	USD	12,065,000	13,030,200	0.77
DCP Midstream LP, FRN 7.375% Perpetual	USD	3,360,000	3,337,925	0.20
DCP Midstream Operating LP, 144A 9.75% 15/03/2019	USD	980,000	1,070,581	0.06
DCP Midstream Operating LP, FRN, 144A 5.85% 21/05/2043	USD	5,446,000	5,063,850	0.30
Dell International LLC, 144A 5.875% 15/06/2021	USD	1,520,000	1,583,133	0.09
Dell International LLC, 144A 7.125% 15/06/2024	USD	2,615,000	2,858,404	0.17
DISH DBS Corp. 6.75% 01/06/2021	USD	3,285,000	3,474,594	0.21
DISH DBS Corp. 5.875% 15/07/2022	USD	1,505,000	1,514,820	0.09
DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	USD	6,275,000	6,646,480	0.40
Eagle Holding Co. II LLC, 144A 7.625% 15/05/2022	USD	1,105,000	1,124,337	0.07
BIG Investors Corp. 10.875% 01/02/2024	USD	3,800,000	4,237,000	0.25
Bldorado Resorts, Inc. 7% 01/08/2023	USD	3,955,000	4,227,322	0.25
Bldorado Resorts, Inc. 6% 01/04/2025	USD	675,000	708,912	0.04
EMI Music Publishing Group North America Holdings, Inc., 144A 7.625% 15/06/2024	USD	1,025,000	1,130,063	0.07
Endeavor Energy Resources LP, 144A 5.5% 30/01/2028	USD	1,225,000	1,249,500	0.07
Endeavor Energy Resources LP, 144A 5.75% 30/01/2028	USD	1,240,000	1,269,450	0.08
Endo Inc., 144A 6% 01/02/2025	USD	2,500,000	1,923,200	0.11
Endo Finance LLC, 144A 7.25% 15/01/2022	USD	2,615,000	2,294,663	0.14
Equinix, Inc., REIT 5.375% 01/01/2022	USD	2,190,000	2,286,141	0.14
Equinix, Inc., REIT 5.75% 01/01/2025	USD	1,185,000	1,262,481	0.08
Equinix, Inc., REIT 5.375% 15/05/2027	USD	2,410,000	2,579,965	0.15
EW Scripps Co. (The), 144A 5.125% 15/05/2025	USD	2,590,000	2,583,525	0.15
Exterran Energy Solutions LP, 144A 8.125% 01/05/2025	USD	5,585,000	6,017,837	0.36
FAGE International SA, 144A 5.625% 15/08/2026	USD	5,610,000	5,427,675	0.32
Fomigac LP 6.75% 15/01/2022	USD	2,145,000	1,989,917	0.12
First Data Corp., 144A 5.375% 15/08/2023	USD	2,280,000	2,378,952	0.14
Five Point Operating Co. LP, 144A 7.875% 15/11/2025	USD	6,365,000	6,492,300	0.39
Freedom Mortgage Corp., 144A 8.125% 15/11/2024	USD	3,320,000	3,390,550	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(%)
Garner, Inc., 144A 5.125% 01/04/2025	USD	1,030,000	1,078,926	0.06
Groystar Real Estate Partners LLC, 144A 5.75% 01/12/2025	USD	1,970,000	2,028,096	0.12
Group 1 Automotive, Inc., 144A 5.25% 15/12/2023	USD	5,120,000	5,312,000	0.32
GTT Communications, Inc., 144A 7.875% 31/12/2024	USD	2,175,000	2,300,063	0.14
H&E Equipment Services, Inc., 144A 5.625% 01/09/2025	USD	3,320,000	3,475,990	0.21
Harland Clarke Holdings Corp., 144A 6.875% 01/03/2020	USD	1,810,000	1,846,225	0.10
Harland Clarke Holdings Corp., 144A 9.25% 01/03/2021	USD	2,125,000	2,151,775	0.13
Harland Clarke Holdings Corp., 144A 8.375% 15/06/2022	USD	5,145,000	5,389,388	0.32
HISRom Holdings, Inc., 144A 5.75% 01/09/2023	USD	1,275,000	1,340,344	0.08
Howard Hughes Corp. (The), 144A 6.375% 15/03/2025	USD	10,955,000	11,212,652	0.67
Hub Holdings LLC, 144A 8.125% 15/07/2019	USD	3,195,000	3,202,988	0.19
Hughes Satellite Systems Corp. 6.625% 01/08/2026	USD	3,890,000	4,091,171	0.24
Huntington Ingalls Industries, Inc., 144A 6% 15/11/2025	USD	2,030,000	2,170,578	0.13
HeartCommunications, Inc. 9% 15/12/2019	USD	7,305,000	5,460,488	0.32
HeartCommunications, Inc. 9% 15/09/2022	USD	3,490,000	2,512,800	0.15
inSite Issuer LLC, Series 2016-1A 'C', 144A 6.414% 15/11/2046	USD	1,190,000	1,213,950	0.07
Intelcat Jackson Holdings SA, 144A 9.5% 30/09/2022	USD	9,595,000	11,106,212	0.66
iStar, Inc., REIT 4.625% 15/09/2020	USD	830,000	842,799	0.05
James Hardie International Finance DAC, 144A 4.75% 15/01/2025	USD	1,425,000	1,442,812	0.09
Jeld-Wen, Inc., 144A 4.625% 15/12/2025	USD	1,515,000	1,530,150	0.09
JoAnn Stores Holdings, Inc., FRN, 144A 9.75% 15/10/2019	USD	7,605,000	7,471,913	0.44
Joseph T Ryerson & Son, Inc., 144A 11% 15/05/2022	USD	6,360,000	7,131,150	0.42
KFC Holding Co., 144A 5% 01/05/2024	USD	1,140,000	1,178,476	0.07
KFC Holding Co., 144A 5.25% 01/05/2026	USD	6,205,000	6,646,276	0.39
Kinetic Concepts, Inc., 144A 12.5% 01/11/2021	USD	4,530,000	5,130,226	0.30
Kiornor Holdings LP, 144A 6.375% 01/12/2022	USD	4,565,000	4,633,475	0.28
Koppers, Inc., 144A 6% 15/02/2025	USD	2,790,000	2,971,350	0.18
Ladder Capital Finance Holdings LLLP, 144A 5.875% 01/08/2021	USD	1,675,000	1,731,531	0.10
Lamb Weston Holdings, Inc., 144A 4.625% 01/11/2024	USD	2,120,000	2,194,200	0.13
Laureate Education, Inc., 144A 8.25% 01/05/2025	USD	4,870,000	5,174,375	0.31
LIN Television Corp. 5.875% 15/11/2022	USD	2,165,000	2,262,425	0.13
Live Nation Entertainment, Inc., 144A 4.875% 01/11/2024	USD	90,000	82,707	0.01
LPL Holdings, Inc., 144A 5.75% 15/09/2025	USD	8,135,000	8,302,012	0.49
LTF Merger Sub, Inc., 144A 8.5% 15/06/2023	USD	5,625,000	5,976,563	0.36
Match Group, Inc., 144A 6% 15/12/2027	USD	860,000	870,750	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（%）
MDC Partners, Inc., 144A 6.6% 01/05/2024	USD	8,060,000	8,140,600	0.48
MEDNAX, Inc., 144A 5.25% 01/12/2023	USD	3,510,000	3,568,617	0.21
Mercer International, Inc., 144A 5.5% 15/01/2026	USD	2,320,000	2,361,296	0.14
Mercer International, Inc. 7.75% 01/12/2022	USD	1,520,000	1,615,836	0.10
Microsm Corp., 144A 9.125% 15/04/2023	USD	6,300,000	7,103,260	0.42
MPH Acquisition Holdings LLC, 144A 7.125% 01/06/2024	USD	1,210,000	1,290,574	0.08
MSCI, Inc., 144A 5.25% 15/11/2024	USD	1,985,000	2,099,088	0.12
MSCI, Inc., 144A 5.75% 15/08/2025	USD	2,390,000	2,564,327	0.15
MSCI, Inc., 144A 4.75% 01/08/2026	USD	2,080,000	2,188,472	0.13
Naviant Corp. 8% 25/03/2020	USD	2,255,000	2,440,846	0.15
Naviant Corp. 6.5% 15/06/2022	USD	1,950,000	2,045,989	0.12
Naviant Corp. 7.25% 25/09/2023	USD	2,160,000	2,309,612	0.14
Naviant Corp. 6.125% 25/03/2024	USD	1,075,000	1,088,824	0.06
Netflix, Inc., 144A 4.875% 15/04/2028	USD	3,600,000	3,533,166	0.21
Netflix, Inc. 5.75% 01/03/2024	USD	695,000	741,044	0.04
Netflix, Inc. 5.75% 01/03/2024	USD	895,000	1,060,919	0.06
NextEra Energy Operating Partners LP, 144A 4.5% 15/09/2027	USD	5,150,000	5,189,312	0.31
NFP Corp., 144A 6.875% 15/07/2025	USD	4,370,000	4,413,700	0.26
NGPL PipeCo LLC, 144A 4.375% 15/08/2022	USD	1,650,000	1,691,250	0.10
Novlic Corp., 144A 6.25% 15/08/2024	USD	3,105,000	3,244,136	0.19
Novlic Corp., 144A 5.875% 30/09/2026	USD	1,675,000	1,710,912	0.10
NRG Energy, Inc., 144A 5.75% 15/01/2028	USD	5,130,000	5,181,300	0.31
Otho-Clinical Diagnostics, Inc., 144A 6.625% 15/05/2022	USD	2,165,000	2,196,650	0.13
Pacifi LLC 7.95% 15/12/2025	USD	1,405,000	1,591,724	0.09
Park-Ohio Industries, Inc. 6.625% 15/04/2027	USD	3,420,000	3,702,150	0.22
Parsley Energy LLC, 144A 5.625% 15/10/2027	USD	4,705,000	4,822,625	0.29
POC Energy, Inc., 144A 5.75% 15/05/2026	USD	2,375,000	2,437,344	0.14
PF Chang's China Bistro, Inc., 144A 10.25% 30/06/2020	USD	1,050,000	960,750	0.06
Plains All American Pipeline LP, FRN 5.125% Perpetual	USD	2,285,000	2,266,423	0.13
Platform Specialty Products Corp., 144A 6.5% 01/02/2022	USD	2,075,000	2,147,625	0.13
Platform Specialty Products Corp., 144A 5.875% 01/12/2025	USD	2,105,000	2,089,212	0.12
Polaris Intermediate Corp., 144A 8.5% 01/12/2022	USD	2,195,000	2,282,800	0.14
Post Holdings, Inc., 144A 5.5% 01/03/2025	USD	1,575,000	1,636,299	0.10
Post Holdings, Inc., 144A 8% 15/07/2025	USD	1,630,000	1,726,988	0.10
Post Holdings, Inc., 144A 5.75% 01/03/2027	USD	1,585,000	1,599,227	0.10
Post Holdings, Inc., 144A 5.625% 15/01/2028	USD	2,470,000	2,486,266	0.15
PQ Corp., 144A 5.75% 15/11/2022	USD	1,540,000	1,654,699	0.10
PQ Corp., 144A 5.75% 15/12/2025	USD	1,125,000	1,147,500	0.07
Prime Security Services Borrower LLC, 144A 9.25% 15/05/2023	USD	4,820,000	5,353,020	0.32
Quicken Loans, Inc., 144A 5.75% 01/05/2025	USD	3,320,000	3,433,013	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（%）
Rackspace Hosting, Inc., 144A 8.625% 15/11/2024	USD	3,415,000	3,651,403	0.22
Rayonier AM Products, Inc., 144A 5.5% 01/06/2024	USD	185,000	185,231	0.01
Reynolds Group Issuer, Inc., 144A 7% 15/07/2024	USD	3,820,000	4,107,856	0.24
Riverbed Technology, Inc., 144A 8.875% 01/03/2023	USD	2,420,000	2,292,950	0.14
Rockies Express Pipeline LLC, 144A 6% 15/01/2019	USD	732,000	755,245	0.04
RP Crown Parent LLC, 144A 7.375% 15/10/2024	USD	2,950,000	3,068,472	0.18
RDI Home Products, Inc., 144A 6.6% 15/03/2023	USD	3,485,000	3,667,963	0.22
Sable Permian Resources Land LLC, 144A 7.125% 01/11/2020	USD	2,700,000	2,173,500	0.13
Sabre GLBL, Inc., 144A 5.375% 15/04/2023	USD	1,050,000	1,074,003	0.06
Scientific Games International, Inc. 10% 01/12/2022	USD	18,165,000	19,932,182	1.19
Seminole Hard Rock Entertainment, Inc., 144A 5.875% 15/05/2021	USD	2,520,000	2,570,400	0.15
Shea Homes LP, 144A 5.875% 01/04/2023	USD	1,610,000	1,678,425	0.10
Silversea Cruise Finance Ltd., 144A 7.25% 01/02/2025	USD	3,800,000	4,123,000	0.25
Sirius XM Radio, Inc., 144A 6% 01/08/2027	USD	1,480,000	1,487,385	0.09
Six Flags Entertainment Corp., 144A 5.5% 15/04/2027	USD	3,285,000	3,391,763	0.20
Solera LLC, 144A 10.6% 01/03/2024	USD	5,830,000	6,566,679	0.39
Sonic Automotive, Inc. 5% 15/05/2023	USD	2,880,000	2,800,800	0.17
SPX FLOW, Inc., 144A 5.625% 15/08/2024	USD	3,505,000	3,706,538	0.22
SPX FLOW, Inc., 144A 5.875% 15/08/2025	USD	3,530,000	3,748,507	0.22
SS&C Technologies Holdings, Inc. 5.875% 15/07/2023	USD	1,785,000	1,868,403	0.11
StandardAero Aviation Holdings, Inc., 144A 10% 15/07/2023	USD	10,365,000	11,427,413	0.68
Summit Materials LLC, 144A 5.125% 01/06/2025	USD	1,405,000	1,400,476	0.08
Surgery Center Holdings, Inc., 144A 8.875% 15/04/2021	USD	2,150,000	2,238,000	0.13
Talgrass Energy Partners LP, 144A 5.5% 15/09/2024	USD	5,545,000	5,718,281	0.34
Tapstone Energy LLC, 144A 9.75% 01/06/2022	USD	1,930,000	1,662,212	0.10
Targa Resources Partners LP 5.25% 01/05/2023	USD	3,730,000	3,819,800	0.23
Targa Resources Partners LP 5.125% 01/02/2025	USD	3,750,000	3,831,675	0.23
Taylor Morrison Communities, Inc., 144A 5.875% 15/04/2023	USD	2,010,000	2,130,600	0.13
Team Health Holdings, Inc., 144A 6.375% 01/02/2025	USD	3,250,000	2,916,875	0.17
Tenet Healthcare Corp., 144A 7.5% 01/01/2022	USD	1,295,000	1,368,050	0.08
Tenet Healthcare Corp., 144A 5.125% 01/05/2025	USD	3,195,000	3,141,979	0.19
TerraForm Power Operating LLC, 144A 4.25% 31/01/2023	USD	970,000	961,512	0.06
TerraForm Power Operating LLC, 144A 5% 31/01/2028	USD	1,470,000	1,456,300	0.09
Tesla, Inc., 144A 5.3% 15/08/2025	USD	11,935,000	11,505,280	0.68
TI Group Automotive Systems LLC, 144A 8.75% 15/07/2023	USD	1,867,000	2,002,368	0.12

銘柄名	通貨	積数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Titan International, Inc., 144A 6.5% 30/11/2023	USD	2,680,000	2,631,600	0.16
T-Mobile USA, Inc. 4% 15/04/2022	USD	4,260,000	4,484,347	0.27
T-Mobile USA, Inc. 6.375% 01/03/2025	USD	1,406,000	1,505,422	0.09
T-Mobile USA, Inc. 6.5% 15/01/2026	USD	3,895,000	4,257,488	0.25
TMG International Corp., 144A 7.25% 15/08/2025	USD	3,670,000	3,695,842	0.22
Townsquare Media, Inc., 144A 6.5% 01/04/2023	USD	3,507,000	3,450,011	0.21
Triumph Group, Inc., 144A 7.75% 15/08/2025	USD	2,260,000	2,504,935	0.15
United Airlines Pass Through Trust, Series 2014-2 III 4.625% 03/03/2024	USD	527,248	546,334	0.03
Univar USA, Inc., 144A 6.75% 15/07/2023	USD	3,675,000	3,658,750	0.23
Univision Communications, Inc., 144A 5.125% 15/02/2025	USD	7,699,000	7,554,952	0.45
Valant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 7.6% 15/07/2021	USD	4,255,000	4,243,142	0.26
Valant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 6.5% 15/03/2022	USD	3,860,000	4,069,540	0.24
Valant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 7% 15/03/2024	USD	5,575,000	5,995,509	0.36
Valant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 5.5% 01/11/2025	USD	2,485,000	2,540,167	0.15
Valant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 9% 15/12/2025	USD	3,175,000	3,331,591	0.20
Valvoline, Inc., 144A 4.375% 15/08/2025	USD	6,660,000	6,734,925	0.40
VB-01 Issuer LLC, Series 2016-1A P, 144A 6.901% 15/06/2046	USD	860,000	879,838	0.05
VeriGign, Inc. 5.25% 01/04/2025	USD	270,000	293,958	0.02
VeriGign, Inc. 4.75% 15/07/2027	USD	2,485,000	2,552,493	0.15
Vortac US, Inc., 144A 7.5% 01/02/2023	USD	5,160,000	5,418,000	0.32
Vortac US, Inc., 144A 10.5% 01/02/2024	USD	12,755,000	13,328,975	0.79
ViaSat, Inc., 144A 5.625% 15/05/2025	USD	3,755,000	3,801,937	0.23
VCI Properties 1 LLC, REIT 8% 15/10/2023	USD	2,530,000	2,633,119	0.17
Vine Oil & Gas LP, 144A 8.75% 15/04/2023	USD	3,425,000	3,313,687	0.20
Watco Cos. LLC, 144A 6.375% 01/04/2023	USD	2,210,000	2,292,124	0.14
Weekley Homes LLC, 144A 6.625% 15/08/2025	USD	5,020,000	4,948,585	0.29
West Corp., 144A 8.5% 15/10/2025	USD	3,485,000	3,441,438	0.20
Western Digital Corp., 144A 7.375% 01/04/2023	USD	2,450,000	2,650,092	0.16
Wrangler Buyer Corp., 144A 6% 01/10/2025	USD	1,270,000	1,314,450	0.08
Zayo Group LLC, 144A 5.75% 15/01/2027	USD	1,150,000	1,180,855	0.07
Zekelman Industries, Inc., 144A 9.875% 15/06/2023	USD	5,085,000	5,733,338	0.34
			<b>793,920,574</b>	<b>47.21</b>
<b>ザンビア</b>				
First Quantum Minerals Ltd., 144A 7.25% 01/04/2023	USD	1,015,000	1,087,136	0.06
First Quantum Minerals Ltd., 144A 7.5% 01/04/2025	USD	2,315,000	2,512,759	0.15
			<b>3,599,895</b>	<b>0.21</b>
<b>債券 計</b>			<b>1,039,077,840</b>	<b>61.79</b>

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
<b>転換社債券</b>				
<b>アメリカ</b>				
Caesars Entertainment Corp. 5% 01/10/2024	USD	890,392	1,715,117	0.10
<b>転換社債券 計</b>			<b>1,715,117</b>	<b>0.10</b>
<b>株式</b>				
<b>アイルランド</b>				
SmurfitKone Container Corp. Preference <sup>1</sup>	USD	7,275	-	-
<b>株式 計</b>			<b>-</b>	<b>-</b>
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			<b>1,040,792,957</b>	<b>61.89</b>
<b>有価証券 計</b>			<b>1,612,464,034</b>	<b>95.89</b>

## 為替予約取引

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	満期日	取引相手方	評価 (換) 益 USD	純資産 比率(%)
CAD	463,000	USD	376,005	26/01/2018	HSBC	8,720	-
EUR	58,811,800	USD	66,808,736	19/01/2018	HSBC	3,792,967	0.23
EUR	30,784,736	USD	35,528,682	19/01/2018	J.P. Morgan	1,405,432	0.08
EUR	190	USD	228	19/01/2018	Morgan Stanley	1	-
EUR	1,994,760	USD	2,354,358	19/01/2018	PBC	40,288	-
EUR	1,086,010	USD	1,279,956	23/02/2018	Bank of America	25,233	-
EUR	211,446	USD	262,331	23/02/2018	Citibank	2,022	-
EUR	29,426,049	USD	34,986,091	23/02/2018	Deutsche Bank	425,798	0.03
EUR	80,553,686	USD	95,759,117	23/02/2018	J.P. Morgan	1,141,194	0.07
EUR	19,148,087	USD	22,646,251	23/02/2018	PBC	387,523	0.02
EUR	465,194	USD	545,989	23/03/2018	J.P. Morgan	2,589	-
EUR	29,603,596	USD	35,160,585	20/04/2018	J.P. Morgan	579,744	0.04
EUR	2,195,909	USD	2,634,175	25/05/2018	J.P. Morgan	24,359	-
EUR	29,000,161	USD	34,486,997	25/05/2018	PBC	596,808	0.04
GBP	1,423,080	USD	1,864,558	26/01/2018	Bank of America	60,706	-
GBP	943,916	USD	1,256,251	26/01/2018	Citibank	20,757	-
GBP	4,423,601	USD	5,805,478	26/01/2018	HSBC	179,147	0.01
GBP	1,116,644	USD	1,470,336	26/01/2018	J.P. Morgan	40,220	-
NOK	197,318,300	USD	23,426,067	19/01/2018	Bank of America	671,382	0.04
NOK	17,478,400	USD	2,089,332	19/01/2018	J.P. Morgan	43,619	-
NOK	4,649,657	USD	563,646	15/06/2018	J.P. Morgan	6,366	-
SEK	14,202,400	USD	1,661,173	19/01/2018	Bank of America	81,523	0.01
SEK	6,954,673	USD	1,068,844	19/01/2018	J.P. Morgan	33,616	-
SEK	819,325	USD	96,871	18/05/2018	J.P. Morgan	1,852	-
SEK	32,645	USD	3,915	15/06/2018	Bank of America	94	-
SEK	6,883,616	USD	828,596	15/06/2018	Goldman Sachs	19,250	-
SEK	5,089,540	USD	612,554	15/06/2018	J.P. Morgan	11,855	-
USD	4,645,363	CAD	5,700,000	26/01/2018	Bank of America	105,130	0.01
USD	296,080	NOK	2,403,086	19/01/2018	J.P. Morgan	2,822	-

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	満期日	取引相手	評価 (損)益 USD	純資産 比率(%)
USD	100,321	NOK	817,736	16/06/2018	J.P. Morgan	73	-
USD	164,371	SEK	1,237,309	23/03/2018	J.P. Morgan	2,841	-
為替予約取引にかかる評価益 計						<b>6,713,041</b>	<b>0.58</b>
CAD	496,892	USD	399,361	26/01/2018	Bank of America	(1,398)	-
CAD	346,610	USD	280,637	26/01/2018	HBOC	(4,651)	-
CAD	216,416	USD	172,883	26/01/2018	J.P. Morgan	(1,297)	-
EUR	123,865	USD	149,024	19/01/2018	J.P. Morgan	(327)	-
EUR	894,672	USD	720,200	23/02/2018	J.P. Morgan	(4,852)	-
EUR	27,521,580	USD	33,313,891	23/03/2018	HBOC	(149,298)	(0.01)
NOK	149,626	USD	18,544	19/01/2018	J.P. Morgan	(296)	-
NOK	196,668,600	USD	24,384,866	23/02/2018	Goldman Sachs	(484,615)	(0.03)
NOK	3,391,614	USD	427,207	23/02/2018	J.P. Morgan	(12,933)	-
NOK	924,384	USD	117,351	23/02/2018	Morgan Stanley	(4,441)	-
NOK	190,172,886	USD	24,171,027	23/03/2018	Deutsche Bank	(923,769)	(0.06)
NOK	13,129,053	USD	1,668,397	23/03/2018	J.P. Morgan	(61,464)	-
NOK	196,549,501	USD	26,301,837	20/04/2018	Deutsche Bank	(1,262,796)	(0.07)
NOK	7,184,098	USD	914,010	20/04/2018	J.P. Morgan	(34,991)	-
NOK	193,012,472	USD	24,478,747	19/06/2018	Deutsche Bank	(839,678)	(0.06)
NOK	1,126,787	USD	140,968	18/06/2018	J.P. Morgan	(2,968)	-
NOK	366,412	USD	44,996	15/06/2018	J.P. Morgan	(77)	-
NOK	191,853,139	USD	23,616,944	15/06/2018	RBC	(97,190)	(0.01)
SEK	5,937,901	USD	738,670	19/01/2018	J.P. Morgan	(14,244)	-
SEK	16,189,900	USD	1,869,030	23/02/2018	Goldman Sachs	(2,023)	-
SEK	19,769,697	USD	2,468,199	23/02/2018	J.P. Morgan	(41,299)	-
SEK	801,180	USD	99,925	23/02/2018	Morgan Stanley	(1,979)	-
SEK	16,606,119	USD	2,076,321	23/03/2018	Deutsche Bank	(42,733)	-
SEK	6,368,635	USD	680,856	23/03/2018	J.P. Morgan	(23,172)	-
SEK	12,015,461	USD	1,529,821	20/04/2018	Goldman Sachs	(55,524)	-
SEK	1,842,704	USD	229,189	20/04/2018	J.P. Morgan	(3,088)	-
SEK	1,079,425	USD	133,196	18/05/2018	J.P. Morgan	(520)	-
SEK	7,159,101	USD	890,591	18/05/2018	RBC	(10,491)	-
USD	891,250	EUR	750,307	19/01/2018	Bank of America	(9,470)	-
USD	183,194	EUR	154,988	19/01/2018	BNP Paribas	(2,893)	-
USD	73,024,996	EUR	62,477,896	19/01/2018	J.P. Morgan	(1,977,766)	(0.12)
USD	22,636,903	EUR	19,302,000	23/02/2018	Bank of America	(562,017)	(0.04)
USD	26,477,667	EUR	21,679,000	23/02/2018	Citibank	(600,723)	(0.04)
USD	38,210,719	EUR	32,266,888	23/02/2018	J.P. Morgan	(490,668)	(0.03)
USD	30,313,426	EUR	26,429,864	23/03/2018	J.P. Morgan	(330,266)	(0.02)
USD	4,339,725	GBP	3,236,616	26/01/2018	Bank of America	(39,043)	-
USD	349,899	GBP	269,708	26/01/2018	Citibank	(1,664)	-
USD	26,576,440	GBP	21,441,000	26/01/2018	Goldman Sachs	(430,768)	(0.03)
USD	900,886	GBP	668,871	26/01/2018	J.P. Morgan	(4,240)	-
USD	20,490	NOK	170,110	19/01/2018	Bank of America	(299)	-
USD	139,262	NOK	1,149,294	19/01/2018	BNP Paribas	(990)	-
USD	1,207,078	NOK	10,023,722	19/01/2018	J.P. Morgan	(16,153)	-
USD	1,061,965	SEK	6,802,191	19/01/2018	J.P. Morgan	(21,904)	-
為替予約取引にかかる評価損 計						<b>(8,581,509)</b>	<b>(0.51)</b>
為替予約取引にかかる評価 (損)益 計						<b>1,132,232</b>	<b>0.07</b>

## クレジット・デフォルト・スワップ取引

総定 元本	通貨	取引相手方	伊限先	売買	利息 (支払) 受取 レート	満期日	評価額		新資産 比率 (%)
							USD	USD	
2,284,675	USD	Citibank	CenturyLink Inc. 6.15% 15/09/2019	Buy	(1.00)%	20/06/2022	281,186	281,186	0.02
915,000	USD	Goldman Sachs	CenturyLink Inc. 6.15% 15/09/2019	Buy	(1.00)%	20/06/2022	112,614	112,614	0.01
1,300,000	USD	Goldman Sachs	Murphy Oil Corp. 4% 01/06/2022	Buy	(1.00)%	20/12/2022	24,896	24,896	-
106,000	USD	Barclays	Murphy Oil Corp. 4% 01/06/2022	Buy	(1.00)%	20/12/2022	2,011	2,011	-
625,000	EUR	Goldman Sachs	TWN Finance Corp. II AB 7.375% 15/12/2020	Sell	5.00%	20/06/2019	54,810	54,810	-
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかると評価額 計							475,517	475,517	0.03
23,000,000	USD	J.P. Morgan	CDX NAHY29V1	Buy	(5.00)%	20/12/2022	(1,910,228)	(1,910,228)	(0.11)
25,000,000	USD	J.P. Morgan	CDX NAIG29V1	Buy	(1.00)%	20/12/2022	(587,116)	(587,116)	(0.04)
6,139,000	USD	J.P. Morgan	Kroger Co. (The) 5.15% 15/01/2020	Buy	(1.00)%	20/12/2022	(54,365)	(54,365)	-
クレジット・デフォルト・スワップ取 引にかかると評価額 計							(2,551,709)	(2,551,709)	(0.15)
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかると評価 (損) 益 計							(2,076,192)	(2,076,192)	(0.12)

## 売建オプション取引

数量	銘柄名	通貨	取引相手方	グローバル・エ クスボージャヤー		新資産 比率 (%)
				USD	USD	
(1,712,500)	Howard Hughes Corp. (The), Cal. 125,000, 15/01/2018	USD	Morgan Stanley	(194,861,713)	(94,308)	(0.01)
売建オプション取引 計				(94,308)	(0.01)	

## スワプション取引

数量	銘柄名	通貨	取引相手方	グローバル・エ クスボージャヤー	
				USD	USD
86,200,000	CDX NA HY 29V1, Cal. 1,060, 21/03/2018	USD	J.P. Morgan	86,200,000	433,046
スワプション取引にかかると買建評価額					433,046
(172,400,000)	CDX NA HY 29V1, Put, 1,020, 21/03/2018	USD	J.P. Morgan	(172,400,000)	(246,631)
(23,425,000)	CDX NA HY 29V1, Put, 0.960, 20/06/2018	USD	Barclays	(23,425,000)	(60,564)
スワプション取引にかかると売建評価額					(407,195)
スワプション取引にかかると評価額 計					25,851



現金	41,138,097	2.45
その他資産（負債）	28,049,413	1.66
純資産 計	1,681,651,544	100.00

#### 国別投資比率

	純資産比率 (%)
アメリカ	68.80
カナダ	4.19
ルクセンブルグ	3.23
イギリス	2.84
イタリア	1.75
オランダ	1.74
ブラジル	1.68
フランス	1.43
アイルランド	1.28
スイス	1.25
オーストラリア	1.13
ドイツ	0.99
アルゼンチン	0.88
コロンビア	0.64
日本	0.60
ベルギー	0.58
スペイン	0.48
トリニダード・トバゴ	0.42
ジャマイカ	0.41
アラブ首長国連邦	0.33
チリ	0.28
ザンビア	0.21
パナマ	0.20
香港	0.15
オーストリア	0.14
ノルウェー	0.11
インドネシア	0.10
カザフスタン	0.04
有価証券 計	95.89
現金及びその他資産（負債）	4.11
合計	100.00

\* これらの証券は公正価値で評価されている。

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

2017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 (%)
<b>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</b>				
<b>債券</b>				
<b>オーストラリア</b>				
SGGP Australia Assets Pty. Ltd., Reg. S 3.3% 09/04/2023	USD	400,000	402,572	0.09
			<b>402,572</b>	<b>0.09</b>
<b>ベルギー</b>				
Arheuter-Busch InBev Finance, Inc. 4.9% 01/02/2046	USD	2,269,000	2,625,131	0.57
Solvay Finance America LLC, 144A 4.45% 03/12/2025	USD	550,000	584,926	0.13
			<b>3,210,056</b>	<b>0.70</b>
<b>バミューダ</b>				
Bermuda Government Bond, 144A 4.854% 06/02/2024	USD	406,000	439,897	0.09
			<b>439,897</b>	<b>0.09</b>
<b>ブラジル</b>				
Braskem Finance Ltd., Reg. S 7.375% Perpetual	USD	370,000	374,899	0.08
			<b>374,899</b>	<b>0.08</b>
<b>カナダ</b>				
Province of Ontario Canada 2.5% 10/09/2021	USD	230,000	230,423	0.05
Thomson Reuters Corp. 3.35% 15/05/2026	USD	290,000	288,698	0.06
			<b>519,121</b>	<b>0.11</b>
<b>チリ</b>				
Corp. Nacional del Cobre de Chile, 144A 3.625% 01/08/2027	USD	200,000	200,367	0.05
Enel Americas SA 4% 25/10/2026	USD	600,000	611,610	0.13
			<b>811,977</b>	<b>0.18</b>
<b>中国</b>				
Alibaba Group Holding Ltd. 3.125% 28/11/2021	USD	306,000	309,697	0.07
Alibaba Group Holding Ltd. 3.6% 28/11/2024	USD	435,000	448,757	0.10
Alibaba Group Holding Ltd. 3.4% 06/12/2027	USD	705,000	703,153	0.15
Alibaba Group Holding Ltd. 4% 06/12/2037	USD	255,000	262,813	0.06
CCCI Treasury Ltd., Reg. S, FRN 3.5% Perpetual	USD	200,000	199,741	0.04
CNOOC Finance 2015 USA LLC 3.5% 05/05/2025	USD	450,000	454,346	0.10
CRCC Yupeng Ltd., Reg. S, FRN 3.95% Perpetual	USD	350,000	353,098	0.08
Proven Honour Capital Ltd., Reg. S 4.125% 19/05/2026	USD	560,000	577,284	0.12
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.8% 11/02/2025	USD	1,975,000	2,050,129	0.44
			<b>5,359,016</b>	<b>1.16</b>
<b>コロンビア</b>				
Banco de Bogota SA, 144A 4.375% 03/08/2027	USD	350,000	349,853	0.08
			<b>349,853</b>	<b>0.08</b>
<b>香港</b>				
FC Development Corporate Treasury Ltd., Reg. S 2.375% 21/05/2019	USD	300,000	298,581	0.06
			<b>298,581</b>	<b>0.06</b>
<b>インドネシア</b>				
Indonesia Government Bond, 144A 3.7% 08/01/2022	USD	200,000	205,754	0.05
Indonesia Government Bond 2.95% 11/01/2023	USD	665,000	661,487	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(%)
Portamina Porsoro PT, 144A 6.45% 30/05/2044	USD	400,000	480,224	0.10
Perusahaan Gas Negara Porsoro Tbk. PT, 144A 5.125% 16/05/2024	USD	500,000	537,913	0.12
			<b>1,885,378</b>	<b>0.41</b>
<b>アイルランド</b>				
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/09/2023	USD	1,080,000	1,059,917	0.23
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2026	USD	715,000	698,391	0.15
			<b>1,758,308</b>	<b>0.38</b>
<b>イスラエル</b>				
Teva Pharmaceutical Finance IV BV 3.65% 10/11/2021	USD	515,000	492,044	0.11
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 2.2% 21/07/2021	USD	520,000	476,237	0.10
			<b>968,281</b>	<b>0.21</b>
<b>クウェート</b>				
Equate Petrochemical BV, Reg. S 4.25% 03/11/2026	USD	560,000	571,673	0.12
			<b>571,673</b>	<b>0.12</b>
<b>メキシコ</b>				
BBVA Bancomer SA, 144A 4.375% 10/04/2024	USD	295,000	308,466	0.07
Grupo Televisa SAB 4.625% 30/01/2026	USD	500,000	531,040	0.12
Mexico Government Bond 3.6% 30/01/2025	USD	225,000	228,229	0.06
Mexico Government Bond 4.125% 21/01/2026	USD	585,000	610,594	0.13
Sigma Alimentos SA de CV, Reg. S 4.125% 02/05/2026	USD	295,000	298,817	0.06
			<b>1,977,148</b>	<b>0.43</b>
<b>モロッコ</b>				
OCP SA, Reg. S 5.625% 25/04/2024	USD	200,000	214,626	0.05
			<b>214,626</b>	<b>0.05</b>
<b>オランダ</b>				
AerCap Ireland Capital DAC 3.95% 01/02/2022	USD	815,000	840,929	0.18
AerCap Ireland Capital DAC 3.5% 26/05/2022	USD	165,000	167,659	0.04
AerCap Ireland Capital DAC 4.625% 01/07/2022	USD	405,000	429,405	0.09
AerCap Ireland Capital DAC 3.65% 21/07/2027	USD	445,000	439,914	0.10
ING Bank NV, Reg. S, FRN 4.125% 21/11/2023	USD	500,000	506,873	0.11
			<b>2,384,780</b>	<b>0.52</b>
<b>パナマ</b>				
Autoridad del Canal de Panama, 144A 4.95% 29/07/2026	USD	200,000	223,750	0.05
			<b>223,750</b>	<b>0.05</b>
<b>スペイン</b>				
Banco Santander SA 3.5% 11/04/2022	USD	800,000	815,804	0.18
Banco Santander SA 3.8% 23/02/2028	USD	800,000	800,825	0.13
			<b>1,416,629</b>	<b>0.31</b>
<b>スイス</b>				
UBS Group Funding Switzerland AG, FRN, 144A 2.859% 15/08/2023	USD	990,000	978,115	0.21
			<b>978,115</b>	<b>0.21</b>
<b>イギリス</b>				
Barclays Bank plc 5.14% 14/10/2020	USD	560,000	592,933	0.13
Barclays plc 3.684% 10/01/2023	USD	895,000	908,635	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 (%)
Healthrow Funding Ltd., 144A 4.875% 15/07/2023	USD	180,000	192,433	0.04
HGBIC Holdings plc 2.95% 25/05/2021	USD	335,000	337,563	0.07
HGBIC Holdings plc 2.65% 05/01/2022	USD	485,000	491,914	0.11
HGBIC Holdings plc, FRN 3.262% 13/03/2023	USD	365,000	369,962	0.08
Royal Bank of Scotland Group plc 3.875% 12/09/2023	USD	785,000	778,445	0.17
Royal Bank of Scotland Group plc, FRN 3.498% 15/05/2023	USD	380,000	380,994	0.08
Santander UK Group Holdings plc 2.875% 16/10/2020	USD	70,000	70,280	0.02
Santander UK Group Holdings plc 2.875% 05/08/2021	USD	550,000	548,486	0.12
WFP Finance 2010 3.75% 19/09/2024	USD	500,000	511,687	0.11
			<b>5,184,302</b>	<b>1.13</b>
<b>アメリカ</b>				
AbbVie, Inc. 3.6% 14/05/2025	USD	880,000	903,395	0.20
AbbVie, Inc. 3.2% 14/05/2026	USD	520,000	519,173	0.11
AbbVie, Inc. 4.45% 14/05/2046	USD	435,000	472,243	0.10
Air Lease Corp. 2.75% 15/01/2023	USD	390,000	384,524	0.08
Air Lease Corp. 3.625% 01/12/2027	USD	820,000	818,529	0.18
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.95% 15/01/2027	USD	530,000	541,575	0.12
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.95% 15/01/2028	USD	110,000	112,406	0.02
American Campus Communities Operating Partnership LP, REIT 3.625% 15/11/2027	USD	205,000	203,501	0.04
Anthem, Inc. 3.5% 15/08/2024	USD	1,200,000	1,223,070	0.27
Anthem, Inc. 4.65% 15/01/2043	USD	500,000	549,560	0.12
Apple, Inc. 2.4% 03/05/2023	USD	2,000,000	1,977,910	0.43
Arconic, Inc. 5.72% 23/02/2019	USD	130,000	134,271	0.03
Arconic, Inc. 6.15% 15/08/2020	USD	385,000	416,461	0.09
Arconic, Inc. 5.87% 23/02/2022	USD	295,000	319,236	0.07
Avnet, Inc. 4.625% 15/04/2026	USD	845,000	881,259	0.19
Bank of America Corp. 3.3% 11/01/2023	USD	3,490,000	3,573,428	0.78
Bank of America Corp. 4.2% 26/08/2024	USD	105,000	110,632	0.02
Bank of America Corp. 3.248% 21/10/2027	USD	975,000	965,508	0.21
Becton Dickinson and Co. 3.363% 06/06/2024	USD	480,000	480,852	0.10
Becton Dickinson and Co. 3.734% 15/12/2024	USD	205,000	209,747	0.05
Becton Dickinson and Co. 3.7% 06/06/2027	USD	985,000	1,001,463	0.22
Becton Dickinson and Co. 4.669% 06/06/2047	USD	565,000	613,324	0.13
Boardwalk Pipelines LP 3.375% 01/02/2023	USD	105,000	104,545	0.02
Boardwalk Pipelines LP 4.95% 15/12/2024	USD	315,000	336,048	0.07
Boardwalk Pipelines LP 5.95% 01/06/2026	USD	285,000	329,988	0.07
Boardwalk Pipelines LP 4.45% 15/07/2027	USD	70,000	71,147	0.02
Boston Properties LP, REIT 3.2% 15/01/2025	USD	430,000	428,276	0.09
Boston Properties LP, REIT 3.65% 01/02/2026	USD	365,000	371,240	0.08

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Boston Properties LP, REIT 2.75% 01/10/2026	USD	730,000	690,430	0.15
Brimor Operating Partnership LP, REIT 3.875% 15/08/2022	USD	362,000	371,802	0.08
Brimor Operating Partnership LP, REIT 3.65% 15/06/2024	USD	299,000	296,647	0.06
Brimor Operating Partnership LP, REIT 3.85% 01/02/2025	USD	115,000	115,212	0.03
Brimor Operating Partnership LP, REIT 4.125% 15/06/2026	USD	336,000	338,273	0.07
Brimor Operating Partnership LP, REIT 3.9% 15/03/2027	USD	332,000	329,346	0.07
Capital One Bank USA NA 3.375% 15/02/2023	USD	960,000	967,426	0.21
Capital One Financial Corp. 3.3% 30/10/2024	USD	583,000	580,951	0.13
CG Holdings: CG V LLC, REIT 3.849% 15/04/2023	USD	710,000	732,251	0.16
CNA Financial Corp. 5.875% 15/08/2020	USD	625,000	673,869	0.15
Crown Castle International Corp., REIT 5.25% 15/01/2023	USD	195,000	213,434	0.05
Crown Castle International Corp., REIT 4.75% 15/05/2047	USD	810,000	854,744	0.19
Delta Air Lines, Inc. 3.625% 15/03/2022	USD	930,000	946,414	0.21
Discover Financial Services 3.75% 04/03/2025	USD	1,300,000	1,311,921	0.28
Enbridge Energy Partners LP 7.375% 15/10/2045	USD	330,000	439,746	0.10
EnLink Midstream Partners LP 4.85% 15/07/2026	USD	225,000	235,791	0.05
Essex Portfolio LP, REIT 3.375% 15/04/2026	USD	440,000	436,374	0.09
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	1,030,000	1,056,347	0.23
GATX Corp. 2.5% 30/07/2019	USD	180,000	180,020	0.04
GATX Corp. 4.85% 01/06/2021	USD	150,000	160,143	0.03
GATX Corp. 3.25% 30/03/2025	USD	260,000	257,535	0.06
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 5.75% 24/01/2022	USD	715,000	791,952	0.17
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3% 28/04/2022	USD	1,400,000	1,405,901	0.31
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.625% 22/01/2023	USD	695,000	716,816	0.16
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.5% 16/11/2026	USD	620,000	623,023	0.14
Hess Corp. 4.3% 01/04/2027	USD	810,000	810,154	0.18
Hess Corp. 5.8% 01/04/2047	USD	455,000	505,693	0.11
Humana, Inc. 3.85% 01/10/2024	USD	520,000	540,563	0.12
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 4% 15/03/2022	USD	845,000	876,438	0.19
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 3.75% 15/02/2023	USD	70,000	72,040	0.02
Interpublic Group of Cos., Inc. (The) 4.2% 15/04/2024	USD	585,000	612,442	0.13
J.P.Morgan Chase & Co. 3.9% 15/07/2025	USD	150,000	157,190	0.03
J.P.Morgan Chase & Co. 3.3% 01/04/2026	USD	240,000	241,744	0.05
Keysight Technologies, Inc. 4.5% 05/04/2027	USD	705,000	745,114	0.16
Kiroy Realty LP, REIT 4.375% 01/10/2025	USD	440,000	461,408	0.10
Kimco Realty Corp., REIT 3.3% 01/02/2025	USD	205,000	203,131	0.04
Kimco Realty Corp., REIT 3.8% 01/04/2027	USD	600,000	606,819	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(%)
Life Technologic Corp. 6% 01/03/2020	USD	310,000	331,919	0.07
Lockheed Martin Corp. 3.6% 01/03/2035	USD	900,000	906,719	0.20
Marsh & McLennan Cos., Inc. 4.35% 30/01/2047	USD	135,000	149,777	0.03
Martin Marietta Materials, Inc. 4.25% 02/07/2024	USD	370,000	391,449	0.08
Martin Marietta Materials, Inc. 4.25% 15/12/2047	USD	370,000	367,634	0.08
Mead Johnson Nutrition Co. 4.125% 15/11/2025	USD	355,000	379,078	0.08
Morgan Stanley 3.75% 25/02/2023	USD	690,000	714,909	0.16
Morgan Stanley 3.7% 23/10/2024	USD	885,000	913,842	0.20
Morgan Stanley 3.125% 27/07/2026	USD	295,000	290,506	0.06
Morgan Stanley 3.625% 20/01/2027	USD	1,580,000	1,614,744	0.35
MPT Operating Partnership LP, REIT 5.25% 01/08/2026	USD	75,000	78,375	0.02
MPT Operating Partnership LP, REIT 5% 15/10/2027	USD	410,000	419,010	0.09
NISource Finance Corp. 4.375% 15/05/2047	USD	475,000	518,170	0.11
Omnicom Group, Inc. 3.65% 01/11/2024	USD	775,000	796,328	0.17
Omnicom Group, Inc. 3.6% 15/04/2026	USD	555,000	560,300	0.12
Plains All American Pipeline LP 2.85% 31/01/2023	USD	95,000	91,062	0.02
Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	USD	245,000	252,324	0.05
Plains All American Pipeline LP 4.5% 15/12/2026	USD	630,000	638,774	0.14
Regency Centers LP, REIT 3.6% 01/02/2027	USD	175,000	174,745	0.04
Reinsurance Group of America, Inc. 6.45% 15/11/2019	USD	145,000	155,162	0.03
Reinsurance Group of America, Inc. 5% 01/08/2021	USD	105,000	112,315	0.02
Reinsurance Group of America, Inc. 4.7% 15/09/2023	USD	170,000	182,450	0.04
Reynolds American, Inc. 4% 12/06/2022	USD	115,000	120,208	0.03
Reynolds American, Inc. 3.25% 01/11/2022	USD	90,000	89,685	0.02
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	200,000	213,337	0.05
Reynolds American, Inc. 5.85% 15/08/2045	USD	400,000	500,188	0.11
Southern Co. (The) 3.25% 01/07/2026	USD	262,000	257,587	0.06
Spectra Energy Partners LP 3.375% 15/10/2026	USD	750,000	741,146	0.16
US Treasury 1.25% 31/10/2018	USD	12,475,000	12,424,320	2.70
US Treasury 1.5% 31/05/2019	USD	2,775,000	2,761,233	0.60
US Treasury 1.75% 15/11/2020	USD	2,090,000	2,077,754	0.45
US Treasury 2% 31/08/2021	USD	19,495,000	19,425,701	4.22
US Treasury 0.125% 15/04/2022	USD	4,228,300	4,255,008	0.92
US Treasury 1.75% 30/06/2022	USD	2,420,000	2,375,381	0.52
US Treasury 1.625% 31/08/2022	USD	2,455,000	2,392,954	0.52
US Treasury 2% 31/10/2022	USD	1,695,000	1,679,507	0.36
US Treasury 0.644% 15/01/2026	USD	3,256,800	3,429,947	0.74
US Treasury 0.125% 15/07/2026	USD	350,500	351,869	0.08
US Treasury 2.25% 15/02/2027	USD	1,365,000	1,345,698	0.29
US Treasury 2.25% 15/11/2027	USD	6,795,000	6,690,421	1.45
US Treasury 5.375% 15/02/2031	USD	410,000	544,211	0.12
US Treasury 2.75% 15/08/2042	USD	700,000	703,172	0.15
US Treasury 3.375% 15/05/2044	USD	510,000	570,722	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(%)
US Treasury 2.5% 15/02/2045	USD	1,480,000	1,407,041	0.31
US Treasury 3% 15/11/2045	USD	1,000,000	1,048,953	0.23
US Treasury 2.5% 15/02/2046	USD	925,000	877,738	0.19
US Treasury 2.5% 15/05/2046	USD	4,190,000	3,974,606	0.86
US Treasury 2.875% 15/11/2046	USD	7,800,000	7,976,719	1.73
US Treasury 3% 15/05/2047	USD	500,000	523,984	0.11
US Treasury 2.75% 15/08/2047	USD	6,595,000	6,579,543	1.43
US Treasury 2.75% 15/11/2047	USD	1,700,000	1,697,344	0.37
US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/07/2027	USD	2,200,000	2,202,838	0.48
VERET Operating Partnership LP, REIT 4.875% 01/06/2026	USD	810,000	858,041	0.19
VERET Operating Partnership LP, REIT 3.95% 15/08/2027	USD	358,000	353,496	0.08
Verizon Communications, Inc. 5.25% 16/03/2037	USD	960,000	1,055,693	0.23
Verizon Communications, Inc. 4.862% 21/08/2046	USD	1,385,000	1,435,712	0.31
Via, Inc. 4.3% 14/12/2045	USD	1,205,000	1,370,700	0.30
Vulcan Materials Co. 4.5% 15/06/2047	USD	695,000	714,088	0.16
Wabtec Corp. 3.45% 15/11/2026	USD	635,000	621,554	0.13
Western Gas Partners LP 4% 01/07/2022	USD	140,000	142,878	0.03
			<b>144,441,766</b>	<b>31.36</b>
債券 計			<b>173,770,756</b>	<b>37.73</b>
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			<b>173,770,756</b>	<b>37.73</b>

### 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 4.25% 15/07/2027	USD	1,045,000	1,080,007	0.23
Boral Finance Pty. Ltd., 144A 3% 01/11/2022	USD	55,000	54,569	0.01
Boral Finance Pty. Ltd., 144A 3.75% 01/05/2028	USD	347,000	348,787	0.08
Brambles USA, Inc., 144A 4.125% 23/10/2025	USD	85,000	88,233	0.02
Origin Energy Finance Ltd., 144A 3.5% 09/10/2018	USD	405,000	407,533	0.09
SMART ABC Trust, Series 2016-2US 'A3A' 1.71% 15/03/2021	USD	550,000	544,870	0.12
SMART ABC Trust, Series 2014-1US 'AAA' 1.68% 14/12/2019	USD	122,307	122,249	0.03
SMART ABC Trust, Series 2016-2US 'AAA' 2.05% 14/12/2022	USD	695,000	685,626	0.15
Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 144A 4.125% 02/02/2026	USD	150,000	156,121	0.03
Transurban Finance Co. Pty. Ltd., 144A 3.375% 22/03/2027	USD	605,000	592,449	0.13
Woodside Finance Ltd., 144A 3.65% 05/03/2025	USD	165,000	166,199	0.03
Woodside Finance Ltd., 144A 3.7% 15/09/2026	USD	672,000	675,303	0.15
Woodside Finance Ltd., 144A 3.7% 15/03/2028	USD	248,000	246,698	0.05
			<b>5,158,644</b>	<b>1.12</b>

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
<b>カナダ</b>				
Conovus Energy, Inc. 4.25% 15/04/2027	USD	165,000	164,889	0.03
Conovus Energy, Inc. 5.4% 15/06/2047	USD	660,000	592,035	0.13
Enbridge, Inc., FRN 6% 15/01/2077	USD	380,000	396,931	0.09
Toronto-Dominion Bank (The), FRN 3.625% 15/09/2031	USD	710,000	708,505	0.15
			<b>1,861,360</b>	<b>0.40</b>
<b>チリ</b>				
Banco Santander Chile, 144A 3.875% 20/09/2022	USD	150,000	156,379	0.03
Celulosa Arauco y Constitucion SA, 144A 3.875% 02/11/2027	USD	280,000	277,664	0.06
Celulosa Arauco y Constitucion SA, 144A 5.5% 02/11/2047	USD	200,000	208,048	0.05
Cencosud SA, Reg. S 5.15% 12/02/2025	USD	450,000	478,577	0.10
			<b>1,120,668</b>	<b>0.24</b>
<b>中国</b>				
Baidu, Inc. 2.875% 06/07/2022	USD	775,000	766,875	0.17
			<b>766,875</b>	<b>0.17</b>
<b>フランス</b>				
BNP Paribas SA, 144A 2.95% 23/05/2022	USD	495,000	496,693	0.11
BNP Paribas SA, 144A 3.8% 10/01/2024	USD	555,000	574,042	0.13
BPCE SA, 144A 3% 22/05/2022	USD	610,000	610,268	0.13
BPCE SA, 144A 3.5% 23/10/2027	USD	1,375,000	1,356,499	0.29
Credit Agricole SA, 144A 3.25% 04/10/2024	USD	690,000	685,067	0.15
			<b>3,722,569</b>	<b>0.81</b>
<b>イタリア</b>				
Enel Finance International NV, 144A 2.75% 05/04/2023	USD	780,000	768,148	0.17
Enel Finance International NV, 144A 3.625% 25/05/2027	USD	905,000	898,495	0.19
Enel Finance International NV, 144A 4.75% 25/05/2047	USD	785,000	849,860	0.18
Intesa Sanpaolo SpA, 144A 3.125% 14/07/2022	USD	530,000	526,356	0.11
UniCredit SpA, 144A 3.75% 12/04/2022	USD	205,000	208,453	0.05
UniCredit SpA, 144A 4.625% 12/04/2027	USD	1,070,000	1,129,059	0.25
			<b>4,380,371</b>	<b>0.95</b>
<b>メキシコ</b>				
Petroleos Mexicanos, 144A 5.375% 13/03/2022	USD	105,000	111,569	0.03
Petroleos Mexicanos 3.5% 23/07/2020	USD	45,000	45,614	0.01
Petroleos Mexicanos 5.5% 21/01/2021	USD	245,000	260,586	0.06
Petroleos Mexicanos 6.375% 04/02/2021	USD	505,000	549,346	0.12
Petroleos Mexicanos 4.875% 24/01/2022	USD	460,000	479,978	0.10
			<b>1,447,093</b>	<b>0.32</b>
<b>シンガポール</b>				
HPHT Finance 15 Ltd., 144A 2.25% 17/03/2018	USD	200,000	199,876	0.04
			<b>199,876</b>	<b>0.04</b>



銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
<b>スイス</b>				
Credit Suisse Group AG, FRN, 144A 2.997% 14/12/2023	USD	1,580,000	1,561,672	0.34
UBG Group Funding Switzerland AG, 144A 3.491% 23/06/2023	USD	700,000	710,917	0.15
UBG Group Funding Switzerland AG, 144A 4.125% 24/09/2025	USD	820,000	859,909	0.19
			<b>3,132,496</b>	<b>0.68</b>
<b>イギリス</b>				
HGBG Holdings plc, FRN 6.375% Perpetual	USD	200,000	215,607	0.05
Nationwide Building Society, 144A 3.9% 21/07/2025	USD	395,000	413,668	0.09
Rockitt Benckiser Treasury Services plc, 144A 3% 26/06/2027	USD	945,000	922,389	0.20
WPP Finance 2010 4.75% 21/11/2021	USD	355,000	379,580	0.08
			<b>1,991,144</b>	<b>0.42</b>
<b>アメリカ</b>				
225 Liberty Street Trust, Series 2016- 225L 'A', 144A 3.597% 10/02/2036	USD	100,000	103,110	0.02
280 Park Avenue Mortgage Trust, FRN, Series 2017-280P 'A', 144A, 2.13% 15/09/2034	USD	585,000	586,896	0.13
Activision Blizzard, Inc. 4.6% 15/06/2047	USD	765,000	804,612	0.17
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.45% 30/04/2025	USD	405,000	403,425	0.09
Ally Auto Receivables Trust, Series 2017-2 'B' 2.33% 15/06/2022	USD	45,000	44,714	0.01
Ally Auto Receivables Trust, Series 2017-3 'B' 2.24% 15/07/2022	USD	1,035,000	1,025,064	0.22
Ally Master Owner Trust, Series 2015-3 'A' 1.53% 15/05/2020	USD	575,000	574,565	0.12
Amazon.com, Inc., 144A 3.875% 22/08/2037	USD	615,000	652,217	0.14
Amazon.com, Inc., 144A 4.05% 22/08/2047	USD	1,400,000	1,500,114	0.33
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-1 'A' 4% 15/01/2027	USD	60,078	61,983	0.01
American Airlines Pass Through Trust, Series 2013-2 'A' 4.95% 15/07/2024	USD	145,896	154,109	0.03
American Airlines Pass Through Trust, Series 2016-2 'A' 3.65% 15/12/2029	USD	889,224	903,000	0.20
American Airlines Pass Through Trust, Series 2017-2 'A' 3.36% 15/04/2031	USD	190,000	189,762	0.04
American Airlines Pass Through Trust, Series 2014-1 'B' 4.375% 01/04/2024	USD	121,741	125,089	0.03
American Airlines Pass Through Trust, Series 2015-1 'B' 3.7% 01/11/2024	USD	38,189	38,189	0.01
American Airlines Pass Through Trust, Series 2017-1B 'B' 4.95% 15/08/2026	USD	305,000	320,260	0.07
American Express Credit Account Master Trust, FRN, Series 2017-5 'B' 2.057% 18/02/2025	USD	385,000	386,464	0.08
American Express Credit Account Master Trust, Series 2017-7 'B' 2.54% 15/05/2025	USD	260,000	257,795	0.06
AmariCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-1 'A3' 1.26% 08/11/2019	USD	1,102	1,102	-
AmariCredit Automobile Receivables Trust, Series 2016-1 'A3' 1.81% 08/10/2020	USD	44,570	44,557	0.01

銘柄名	通貨	株数または 類別金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-3 'B' 2.08% 08/09/2020	USD	170,000	170,096	0.04
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2014-1 'C' 2.15% 08/03/2020	USD	262,092	262,248	0.06
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2014-2 'C' 2.18% 08/06/2020	USD	525,000	525,346	0.11
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2015-2 'C' 2.4% 08/01/2021	USD	152,000	152,437	0.03
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2016-1 'C' 2.89% 10/01/2022	USD	1,370,000	1,379,821	0.30
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2016-2 'C' 2.87% 08/11/2021	USD	85,000	85,520	0.02
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2017-3 'C' 2.69% 19/06/2023	USD	1,330,000	1,327,422	0.29
AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2013-5 'C' 2.86% 09/12/2019	USD	345,000	346,395	0.08
Apple, Inc. 3% 08/02/2024	USD	925,000	937,007	0.20
Apple, Inc. 3.2% 11/05/2027	USD	1,660,000	1,677,754	0.36
Apple, Inc. 3.75% 13/11/2047	USD	745,000	753,845	0.17
ARI Fleet Lease Trust, Series 2017-A 'A2', 144A 1.91% 15/04/2026	USD	525,000	523,895	0.11
ARI Fleet Lease Trust, Series 2016-A 'A3', 144A 2.11% 15/07/2024	USD	300,000	300,001	0.07
ARI Fleet Lease Trust, Series 2017-A 'A3', 144A 2.28% 15/04/2026	USD	610,000	606,657	0.13
Ascension Health 3.945% 15/11/2046	USD	390,000	412,344	0.09
Accentium Equipment Receivables Trust, Series 2017-1A 'A2', 144A 1.87% 10/07/2019	USD	40,000	39,946	0.01
Accentium Equipment Receivables Trust, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.92% 10/12/2019	USD	170,000	169,885	0.04
Accentium Equipment Receivables Trust, Series 2017-1A 'A3', 144A 2.29% 10/06/2021	USD	40,000	39,883	0.01
Albium Hotel Portfolio Trust, FRN, Series 2017-ATRM 'A', 144A 2.408% 15/11/2019	USD	725,000	729,995	0.16
Avic Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2013-1A 'A', 144A 1.92% 20/09/2019	USD	420,000	419,399	0.09
Avic Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2013-2A 'A', 144A 2.97% 20/02/2020	USD	160,000	161,090	0.03
Avic Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2014-1A 'A', 144A 2.46% 20/07/2020	USD	1,135,000	1,136,806	0.25
Avic Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2014-2A 'A', 144A 2.5% 20/02/2021	USD	1,105,000	1,105,177	0.24
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J '2A1' 3.715% 25/11/2035	USD	90,342	84,757	0.02
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-A '2A2' 3.584% 25/02/2034	USD	6,327	6,330	-
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-B '2A2' 3.602% 25/03/2034	USD	36,043	36,546	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 (%)
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-D '2A2' 3.688% 25/05/2034	USD	80,894	81,706	0.02
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-H '2A2' 3.586% 25/09/2034	USD	48,568	48,131	0.01
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2005-J '3A1' 4% 25/11/2035	USD	46,661	48,348	0.01
Banc of America Mortgage Trust, FRN, Series 2004-I '3A2' 3.773% 25/10/2034	USD	19,075	19,305	-
Bank of America Corp., FRN 3.824% 20/01/2028	USD	675,000	698,487	0.16
Bank of America Corp., FRN 4.244% 24/04/2038	USD	595,000	646,539	0.14
BANK Trust, FRN, Series 2017-BNK5 'C' 4.4% 15/06/2060	USD	145,000	147,589	0.03
Barclays Dyrrock Issuance Trust, Series 2014-3 'A' 2.41% 15/07/2022	USD	325,000	326,495	0.07
Barclays Dyrrock Issuance Trust, Series 2015-1 'A' 2.2% 15/12/2022	USD	100,000	99,934	0.02
Bay Area Toll Authority 'F2' 6.263% 01/04/2049	USD	255,000	377,030	0.08
Baylor Scott & White Holdings 3.967% 15/11/2046	USD	375,000	389,960	0.08
Bayview Mortgage Fund I/vc Trust, FRN, Series 2017-RT3 'A', 144A 3.5% 28/01/2058	USD	356,037	364,413	0.08
Bayview Opportunity Master Fund I/v Trust, FRN, Series 2017-SPL4 'A', 144A 3.5% 28/01/2055	USD	240,250	244,166	0.05
BMW Vehicle Lease Trust, Series 2017-2 'A3' 2.07% 20/10/2020	USD	285,000	284,187	0.06
Broadcom Corp., 144A 3% 15/01/2022	USD	595,000	590,181	0.13
Broadcom Corp., 144A 3.625% 15/01/2024	USD	685,000	679,478	0.19
Broadcom Corp., 144A 3.875% 15/01/2027	USD	295,000	291,345	0.06
BX Trust, FRN, Series 2017-MC 'A', 144A 2.3% 15/10/2032	USD	560,000	561,556	0.12
BXP Trust, Series 2017-GM 'A', 144A 3.379% 13/06/2039	USD	735,000	751,861	0.16
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2015-2 'A3' 1.73% 20/09/2019	USD	124,227	124,227	0.03
Capital Auto Receivables Asset Trust, Series 2014-1 'C' 2.84% 22/04/2019	USD	4,456	4,459	-
Capital One Multi-Asset Execution Trust, FRN, Series 2005-B3 'B3' 1.909% 15/05/2028	USD	310,000	305,424	0.07
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-4 'A3' 1.4% 15/08/2021	USD	585,000	579,164	0.13
CarMax Auto Owner Trust, Series 2017-4 'A3' 2.11% 17/10/2022	USD	175,000	174,045	0.04
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-1 'A4' 1.88% 15/06/2021	USD	340,000	337,665	0.07
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 'E' 1.69% 15/08/2019	USD	25,000	24,990	0.01
CarMax Auto Owner Trust, Series 2016-2 'E' 2.16% 15/12/2021	USD	90,000	89,373	0.02
CarMax Auto Owner Trust, Series 2014-1 'C' 1.83% 15/11/2019	USD	35,000	34,995	0.01
CCG Receivables Trust, Series 2016-1 'A2', 144A 1.69% 14/09/2022	USD	126,042	126,780	0.03
CCG Receivables Trust, Series 2017-1 'A2', 144A 1.84% 14/11/2023	USD	335,000	333,083	0.07
CCG Receivables Trust, Series 2015-1 'E', 144A 2.6% 17/01/2023	USD	375,000	375,638	0.08

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
Colgate Corp. 3.625% 15/05/2024	USD	400,000	411,216	0.09
Colgate Corp. 3.875% 15/08/2025	USD	1,105,000	1,144,946	0.25
Colgate Corp. 4.35% 15/11/2047	USD	410,000	425,641	0.09
Charter Communications Operating LLC 4.908% 23/07/2025	USD	1,010,000	1,075,185	0.23
Chase Issuance Trust, Series 2015-A2 'A2' 1.59% 18/02/2020	USD	265,000	264,953	0.06
Chicago Metropolitan Water Reclamation 5.72% 01/12/2038	USD	410,000	534,337	0.12
Chicago O Hare International Airport 'B' 6.285% 01/01/2040	USD	170,000	237,828	0.05
Chrysler Capital Auto Receivables Trust, Series 2016-BA 'A2', 144A 1.36% 15/01/2020	USD	62,253	62,182	0.01
Chrysler Capital Auto Receivables Trust, Series 2016-BA 'A3', 144A 1.64% 15/07/2021	USD	165,000	164,107	0.04
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2015-GC27 'A5' 3.571% 10/02/2048	USD	110,000	110,885	0.02
Citigroup, Inc. FRN 2.876% 24/07/2023	USD	2,540,000	2,525,585	0.55
Citigroup, Inc. FRN 3.887% 10/01/2028	USD	1,330,000	1,373,192	0.30
City of Los Angeles Department of Airports 7.053% 15/05/2040	USD	70,000	100,933	0.02
City of New York 6.271% 01/12/2037	USD	165,000	223,286	0.05
CLNG Trust, FRN, Series 2017-KPR 'A', 144A 2.045% 11/09/2032	USD	470,000	470,887	0.10
CNH Equipment Trust, Series 2016-C 'A3' 1.44% 15/12/2021	USD	240,000	237,602	0.05
Comcast Corp. 3.3% 01/02/2027	USD	770,000	784,087	0.17
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2014-TWC 'A', 144A 2.094% 13/02/2032	USD	100,000	100,168	0.02
COMM Mortgage Trust, Series 2014- UBG5 'A4' 3.638% 10/09/2047	USD	395,000	415,406	0.09
COMM Mortgage Trust, Series 2015- CR26 'A4' 3.63% 10/10/2048	USD	345,000	359,443	0.08
COMM Mortgage Trust, Series 2015- DC1 'AM' 3.724% 10/02/2048	USD	780,000	792,206	0.17
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LG21 'B' 4.454% 10/07/2048	USD	170,000	173,768	0.04
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-PC1 'B' 4.589% 10/07/2050	USD	85,000	86,900	0.02
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2014-UBG4 'C' 4.781% 10/08/2047	USD	150,000	151,060	0.03
COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2015-CRC5 'C' 4.697% 10/08/2048	USD	215,000	220,535	0.05
Commonwealth of Virginia Transportation Board 5.35% 15/05/2035	USD	265,000	318,217	0.07
Concho Resources, Inc. 3.75% 01/10/2027	USD	1,110,000	1,125,651	0.24
Continental Airlines Pass Through Trust, Series 2012-1 'A' 4.15% 11/10/2025	USD	35,033	36,697	0.01
Credit Suisse Mortgage Capital Certificator Trust, Series 2015-GLPB 'A', 144A 3.639% 15/11/2034	USD	200,000	208,154	0.05
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates Trust, FRN, Series 2015- GLPB 'B', 144A 3.938% 15/11/2034	USD	170,000	176,272	0.04
Crown Castle Towers LLC, 144A 6.113% 15/01/2040	USD	113,000	118,999	0.03
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.222% 15/05/2042	USD	25,000	25,302	0.01
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.663% 15/05/2045	USD	255,000	259,995	0.06

銘柄名	通貨	株数または 額出金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C3 'A4' 3.718% 15/08/2048	USD	590,000	614,105	0.13
DB Master Finance LLC, Series 2017-1A 'A2', 144A 3.629% 20/11/2047	USD	260,000	261,526	0.06
DBCG Mortgage Trust, FRN, Series 2017-BBG 'A', 144A 1.95% 15/06/2034	USD	985,000	986,784	0.21
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2010-2 'A' 4.96% 23/11/2020	USD	25,805	26,494	0.01
Delta Air Lines Pass Through Trust Series 2011-1 'A' 5.3% 18/10/2020	USD	28,931	29,920	0.01
Delta Air Lines Pass Through Trust, Series 2015-1 'AA' 3.625% 30/01/2029	USD	109,734	113,936	0.02
Denver Public Schools 4.242% 15/12/2037	USD	70,000	74,462	0.02
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2013-2 'A', 144A 2.27% 20/05/2026	USD	84,046	83,884	0.02
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2015-1 'A', 144A 2.73% 20/07/2027	USD	24,391	24,302	0.01
Diamond Resorts Owner Trust, Series 2015-2 'A', 144A 2.99% 22/05/2028	USD	53,587	53,388	0.01
District of Columbia 5.691% 01/12/2034	USD	60,000	74,282	0.02
East Bay Municipal Utility District 5.874% 01/06/2040	USD	515,000	691,408	0.15
Elara HGV Timeshare Issuer LLC, Series 2014-A 'A', 144A 2.53% 25/02/2027	USD	29,164	28,815	0.01
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2015-1 'A2', 144A 1.3% 20/09/2020	USD	17,234	17,229	-
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2015-2 'A2', 144A 1.74% 22/02/2022	USD	339,997	339,357	0.07
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2017-2 'A2', 144A 1.97% 20/01/2023	USD	100,000	99,776	0.02
Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2016-1 'A3', 144A 2.08% 20/09/2021	USD	560,000	559,426	0.12
Expedia, Inc., 144A 3.8% 15/02/2028	USD	765,000	740,765	0.16
Expedia, Inc. 6% 15/02/2026	USD	1,070,000	1,144,106	0.25
Express Scripts Holding Co. 4.5% 25/02/2026	USD	505,000	534,467	0.12
Express Scripts Holding Co. 4.8% 15/07/2046	USD	220,000	234,495	0.05
FHLMC, Series K025 'A1' 1.875% 25/04/2022	USD	83,591	82,974	0.02
FHLMC, FRN, Series 2017-DNA2 'M1' 2.527% 25/10/2029	USD	241,132	244,983	0.05
FHLMC, FRN, Series 2017-DNA3 'M1' 2.077% 25/03/2030	USD	246,163	247,178	0.05
FHLMC, FRN, Series 2017-HQA2 'M1' 2.127% 25/12/2029	USD	240,868	241,691	0.05
FHLMC, FRN, Series 2017-HQA3 'M1' 1.878% 25/04/2030	USD	245,831	245,870	0.05
FHLMC, FRN, Series 2014-HQ2 'M2' 3.528% 25/09/2024	USD	238,498	246,148	0.05
FHLMC, FRN, Series 2014-HQ3 'M2' 3.978% 25/10/2024	USD	39,873	39,939	0.01
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA1 'M2' 3.178% 25/10/2027	USD	250,000	256,183	0.06
FHLMC, FRN, Series 2015-DNA3 'M2' 4.178% 25/04/2028	USD	848,615	878,512	0.19
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ1 'M2' 3.752% 25/03/2025	USD	86,980	87,712	0.02

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率（%）
FHLMC, FRN, Series 2015-HQ2 'M2' 3.278% 25/05/2025	USD	242,374	248,048	0.05
FHLMC, FRN, Series 2015-HQA1 'M2' 3.978% 25/03/2028	USD	135,060	137,779	0.03
FHLMC, FRN, Series 2015-HQA2 'M2' 4.128% 25/05/2028	USD	599,977	620,541	0.13
FHLMC, FRN, Series 2016-DNA1 'M2' 4.228% 25/07/2028	USD	250,000	257,691	0.06
FHLMC, FRN, Series 2016-DNA3 'M2' 3.328% 25/12/2028	USD	430,000	437,618	0.10
FHLMC A26586 6% 01/09/2034	USD	2,621	2,978	-
FHLMC A71375 6% 01/01/2038	USD	1,663	1,859	-
FHLMC A71803 6% 01/01/2038	USD	1,220	1,364	-
FHLMC A90053 4.5% 01/12/2039	USD	56,749	61,029	0.01
FHLMC A91947 6% 01/04/2040	USD	9,998	10,891	-
FHLMC A93451 4.5% 01/08/2040	USD	194,770	207,730	0.05
FHLMC A94185 4% 01/10/2040	USD	2,933	3,078	-
FHLMC A94251 4% 01/10/2040	USD	1,936	2,031	-
FHLMC A94576 4% 01/10/2040	USD	768	805	-
FHLMC A94713 4% 01/11/2040	USD	1,648	1,729	-
FHLMC A95734 4% 01/12/2040	USD	14,567	15,393	-
FHLMC A96312 4% 01/01/2041	USD	64,648	67,839	0.01
FHLMC A97620 4.5% 01/03/2041	USD	2,080	2,223	-
FHLMC C01787 6% 01/02/2034	USD	52,762	59,610	0.01
FHLMC C09036 3.5% 01/03/2043	USD	185,198	190,948	0.04
FHLMC E01341 5.5% 01/03/2018	USD	288	288	-
FHLMC E01497 5.5% 01/11/2018	USD	509	514	-
FHLMC G01777 6% 01/02/2035	USD	42,601	47,717	0.01
FHLMC G01899 6% 01/09/2035	USD	14,603	16,498	-
FHLMC G02712 6% 01/12/2038	USD	7,040	7,957	-
FHLMC G03551 6% 01/11/2037	USD	50,230	56,441	0.01
FHLMC G04814 5.5% 01/10/2038	USD	190,507	210,796	0.05
FHLMC G05535 4.5% 01/07/2039	USD	105,996	113,040	0.02
FHLMC G05659 4.5% 01/10/2039	USD	158,684	169,268	0.04
FHLMC G05955 5% 01/08/2040	USD	102,654	112,048	0.02
FHLMC G06958 6% 01/08/2040	USD	257,703	280,966	0.06
FHLMC G06231 4% 01/12/2040	USD	96,230	103,079	0.02
FHLMC G06252 4% 01/02/2041	USD	2,771	2,924	-
FHLMC G06505 4% 01/12/2040	USD	514	539	-
FHLMC G07543 4.5% 01/08/2041	USD	25,457	27,382	0.01
FHLMC G08016 6% 01/10/2034	USD	244,733	275,505	0.06
FHLMC G08534 3% 01/05/2043	USD	300,482	301,829	0.07
FHLMC G08677 4% 01/11/2045	USD	880,837	920,702	0.20
FHLMC G60038 3.5% 01/01/2044	USD	151,208	155,899	0.03
FHLMC G60180 4.5% 01/05/2042	USD	121,723	129,807	0.03
FHLMC G60334 4.5% 01/10/2041	USD	90,294	96,290	0.02
FHLMC G60440 3.5% 01/03/2046	USD	1,074,384	1,109,143	0.24
FHLMC J03640 6% 01/10/2021	USD	13,866	14,309	-
FHLMC J15139 4% 01/05/2026	USD	40,504	42,277	0.01
FHLMC O04674 4% 01/12/2041	USD	39,222	41,158	0.01
FHLMC Q14426 3% 01/01/2043	USD	414,429	416,373	0.09
FHLMC Q40647 3.5% 01/05/2046	USD	399,056	410,558	0.09
FHLMC U90932 3% 01/02/2043	USD	38,910	38,715	0.01
FHLMC U91090 3% 01/03/2043	USD	18,066	17,976	-
FHLMC V80025 3% 01/04/2043	USD	33,133	33,292	0.01
FHLMC REMIC, FRN, Series 4623 'EF' 1.7% 15/10/2046	USD	115,550	116,510	0.03
FHLMC REMIC, FRN, Series 4596 'FA' 1.75% 15/04/2046	USD	189,914	191,680	0.04
FHLMC REMIC, FRN, Series 4614 'FG' 1.75% 15/09/2046	USD	346,798	350,070	0.08

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FHLMC REMIC, FRN, Series 4621 'FK' 1.75% 15/10/2046	USD	182,462	184,221	0.04
FHLMC REMIC, FRN, Series 4654 'FK' 1.75% 15/02/2047	USD	93,141	93,996	0.02
FHLMC REMIC, FRN, Series 4650 'FL' 1.7% 15/01/2047	USD	222,721	225,882	0.05
FHLMC REMIC, FRN, Series 4623 'MF' 1.75% 15/10/2046	USD	111,267	112,269	0.02
FirstEnergy Transmission LLC, 144A 4.35% 15/01/2025	USD	1,050,000	1,107,299	0.24
FirstKey Mortgage Trust, FRN, Series 2014-1 'B2', 144A 4.017% 25/11/2044	USD	172,567	180,901	0.04
Florida Street Bond Fund 2.163% 01/07/2019	USD	110,000	109,777	0.02
FNMA, FRN, Series 2017-C01 '1M1' 2.628% 25/07/2029	USD	123,012	124,296	0.03
FNMA, FRN, Series 2017-C05 '1M1' 2.077% 25/02/2030	USD	224,043	226,021	0.05
FNMA 7.125% 15/01/2030	USD	100,000	143,774	0.03
FNMA 190360 5% 01/08/2035	USD	21,825	23,713	0.01
FNMA 254869 5.5% 01/09/2033	USD	73,065	81,096	0.02
FNMA 254903 5% 01/10/2033	USD	13,230	14,371	-
FNMA 545759 6.5% 01/07/2032	USD	23,622	26,783	0.01
FNMA 555526 5.5% 01/05/2018	USD	110	110	-
FNMA 725027 5% 01/11/2033	USD	14,033	15,246	-
FNMA 725229 6% 01/03/2034	USD	71,584	80,308	0.02
FNMA 725232 5% 01/03/2034	USD	5,815	6,317	-
FNMA 725238 5% 01/03/2034	USD	23,806	25,860	0.01
FNMA 725423 5.5% 01/05/2034	USD	179,813	199,652	0.04
FNMA 735061 6% 01/11/2034	USD	7,907	8,968	-
FNMA 735115 6% 01/12/2034	USD	2,567	2,917	-
FNMA 735141 5.5% 01/01/2035	USD	43,641	48,438	0.01
FNMA 735318 4.5% 01/11/2019	USD	2,905	2,953	-
FNMA 735500 5.5% 01/05/2035	USD	15,084	16,745	-
FNMA 735502 6% 01/04/2035	USD	4,758	5,403	-
FNMA 735575 5.5% 01/12/2018	USD	2	2	-
FNMA 735578 5% 01/06/2035	USD	36,700	39,867	0.01
FNMA 735579 5% 01/06/2035	USD	5,732	6,227	-
FNMA 735580 5% 01/06/2035	USD	3,332	3,610	-
FNMA 735591 5% 01/06/2035	USD	1,620	1,759	-
FNMA 735667 5% 01/07/2035	USD	11,044	11,998	-
FNMA 735669 5% 01/04/2035	USD	8,957	9,730	-
FNMA 735676 5% 01/07/2035	USD	499,988	543,123	0.12
FNMA 735697 5.5% 01/11/2035	USD	13,863	15,384	-
FNMA 745428 5.5% 01/01/2036	USD	91,337	101,391	0.02
FNMA 745458 6% 01/04/2036	USD	240	272	-
FNMA 745947 6.5% 01/10/2036	USD	3,794	4,261	-
FNMA 750412 6.5% 01/11/2033	USD	15,736	17,450	-
FNMA, FRN 763199 2.861% 01/10/2033	USD	11,568	11,914	-
FNMA, FRN 848522 2.965% 01/12/2035	USD	11,608	12,156	-
FNMA 888174 5.5% 01/06/2035	USD	403,109	445,991	0.10
FNMA 888223 5.5% 01/01/2036	USD	17,094	18,981	-
FNMA 888284 5.5% 01/04/2037	USD	63,906	70,757	0.02
FNMA 888343 5% 01/11/2035	USD	415,227	450,890	0.10
FNMA 888430 5% 01/11/2033	USD	14,277	15,509	-
FNMA 888567 5.5% 01/12/2036	USD	113,538	125,857	0.03
FNMA 889117 5% 01/10/2035	USD	207,082	224,964	0.05
FNMA 889298 5% 01/12/2036	USD	44,523	48,349	0.01
FNMA 889307 5% 01/07/2037	USD	16,766	18,212	-
FNMA 889479 5% 01/07/2037	USD	139,504	151,585	0.03

銘柄名	通貨	株式会社 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
FNMA 889579 6% 01/05/2038	USD	3,352	3,781	-
FNMA 889829 5% 01/07/2035	USD	153,245	167,298	0.04
FNMA 890263 4% 01/11/2025	USD	68,013	70,879	0.02
FNMA 890527 4.5% 01/09/2042	USD	72,457	77,512	0.02
FNMA 890565 3% 01/11/2043	USD	191,612	192,360	0.04
FNMA 890738 3.5% 01/09/2043	USD	200,973	207,358	0.05
FNMA 900724 5.5% 01/08/2021	USD	2,067	2,140	-
FNMA 901646 6.5% 01/12/2036	USD	1,271	1,410	-
FNMA 902382 6.5% 01/11/2036	USD	9,998	11,199	-
FNMA 906064 6% 01/01/2037	USD	785	888	-
FNMA 933051 6.5% 01/10/2037	USD	62,570	59,692	0.01
FNMA 942477 6% 01/08/2022	USD	1,736	1,813	-
FNMA 948410 6% 01/08/2022	USD	1,337	1,383	-
FNMA 995024 5.5% 01/08/2037	USD	191,304	212,346	0.05
FNMA 995051 6% 01/03/2037	USD	57,953	65,647	0.01
FNMA 995112 5.5% 01/07/2036	USD	29,204	32,416	0.01
FNMA 995113 5.5% 01/09/2036	USD	180,405	200,240	0.04
FNMA 995203 5% 01/07/2035	USD	84,456	91,746	0.02
FNMA 995388 5.5% 01/08/2037	USD	8,971	9,953	-
FNMA 995434 5% 01/09/2023	USD	24,052	24,610	0.01
FNMA 995629 6.5% 01/12/2032	USD	26,390	30,026	0.01
FNMA AA4328 4% 01/04/2024	USD	49,513	51,431	0.01
FNMA AB5614 3.5% 01/07/2042	USD	482,155	496,307	0.11
FNMA AB5615 3.5% 01/07/2042	USD	39,503	40,675	0.01
FNMA AB5807 3.5% 01/08/2042	USD	78,196	80,515	0.02
FNMA AB6317 3.5% 01/09/2042	USD	21,089	21,773	-
FNMA AB6491 3% 01/10/2042	USD	66,282	66,501	0.01
FNMA AB6670 3% 01/10/2042	USD	42,025	42,188	0.01
FNMA AB6768 3% 01/10/2042	USD	70,969	71,274	0.02
FNMA AB7733 3% 01/01/2043	USD	216,434	216,274	0.05
FNMA AB7846 3% 01/02/2043	USD	115,603	116,100	0.03
FNMA AB8464 2.5% 01/02/2043	USD	147,733	142,999	0.03
FNMA AB8898 3% 01/04/2043	USD	214,837	215,653	0.05
FNMA AC3237 5% 01/10/2039	USD	321,267	350,463	0.08
FNMA AC9580 4.5% 01/02/2040	USD	732,065	783,548	0.17
FNMA AC9582 5.5% 01/01/2040	USD	53,780	59,290	0.01
FNMA AD0163 6% 01/11/2034	USD	237,510	270,302	0.06
FNMA AD0220 6% 01/10/2038	USD	312,270	353,149	0.08
FNMA AEO524 4% 01/11/2040	USD	75,900	79,681	0.02
FNMA AEO698 4.5% 01/12/2040	USD	30,610	32,798	0.01
FNMA AE7723 4% 01/11/2040	USD	66,906	69,751	0.01
FNMA AH1111 4% 01/12/2040	USD	358,944	376,821	0.08
FNMA AH3394 4% 01/01/2041	USD	102,549	107,664	0.02
FNMA AH6889 4% 01/02/2041	USD	104,683	109,905	0.02
FNMA AJ7679 3.5% 01/12/2041	USD	20,431	21,134	-
FNMA AL0065 4.5% 01/04/2041	USD	106,218	113,813	0.02
FNMA AL0251 5% 01/07/2037	USD	3,339	3,627	-
FNMA AL0546 5% 01/07/2041	USD	118,639	127,927	0.03
FNMA AL0803 4% 01/09/2041	USD	205,624	215,862	0.05
FNMA AL1105 4.5% 01/12/2040	USD	78,576	84,390	0.02
FNMA AL1371 4% 01/01/2027	USD	126,083	132,010	0.03
FNMA AL1524 4.5% 01/12/2040	USD	21,210	22,730	-
FNMA AL1577 5% 01/01/2042	USD	22,556	24,326	0.01
FNMA AL1938 4% 01/12/2026	USD	36,366	37,892	0.01
FNMA AL2579 4% 01/12/2026	USD	138,871	145,359	0.03
FNMA AL2645 4.5% 01/01/2027	USD	137,077	144,625	0.03
FNMA AL2661 4% 01/10/2026	USD	14,847	15,541	-
FNMA AL3192 5% 01/05/2042	USD	108,535	117,054	0.03
FNMA AL3657 3.5% 01/06/2043	USD	57,475	59,367	0.01
FNMA AL4010 3.5% 01/07/2043	USD	37,570	38,809	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 AL4301 4.5% 01/04/2042	USD	51,730	55,430	0.01
FNMA ALS224 5% 01/02/2038	USD	11,703	12,713	-
FNMA ALS362 5% 01/09/2039	USD	178,245	193,592	0.04
FNMA ALS590 5.5% 01/09/2041	USD	8,162	9,059	-
FNMA AL6078 5% 01/03/2042	USD	24,191	26,065	0.01
FNMA AL6167 3.5% 01/01/2044	USD	36,280	37,356	0.01
FNMA AL6549 5% 01/07/2042	USD	243,811	262,866	0.06
FNMA AL6715 4% 01/02/2045	USD	329,940	345,170	0.07
FNMA AL6966 6.5% 01/08/2038	USD	36,347	40,967	0.01
FNMA AL7033 5% 01/06/2039	USD	21,766	23,655	0.01
FNMA AL7035 5% 01/12/2038	USD	30,410	33,029	0.01
FNMA AL7121 3% 01/01/2044	USD	1,311,197	1,316,307	0.29
FNMA AL7389 4% 01/03/2029	USD	95,742	99,754	0.02
FNMA AL7991 3.5% 01/01/2046	USD	21,118	21,769	-
FNMA AL8310 3.5% 01/03/2044	USD	93,599	96,727	0.02
FNMA AL8387 4% 01/03/2046	USD	237,879	248,925	0.05
FNMA AL8626 3.5% 01/06/2046	USD	606,147	624,845	0.14
FNMA AL9027 4% 01/09/2046	USD	33,254	34,787	0.01
FNMA AL9061 3% 01/08/2046	USD	57,425	57,386	0.01
FNMA AL9062 3% 01/09/2046	USD	60,529	60,487	0.01
FNMA AL9074 6% 01/05/2041	USD	349,670	396,432	0.09
FNMA ALS267 3% 01/10/2046	USD	1,964,772	1,966,421	0.43
FNMA ALS412 3% 01/11/2036	USD	593,404	603,424	0.13
FNMA ALS413 3% 01/11/2036	USD	242,310	246,932	0.05
FNMA ALS473 3% 01/11/2046	USD	552,789	553,882	0.12
FNMA ALS666 3.5% 01/06/2046	USD	829,814	858,030	0.19
FNMA ALS716 3.5% 01/12/2044	USD	375,609	385,329	0.08
FNMA ALS878 3% 01/02/2037	USD	893,564	906,919	0.20
FNMA ALS893 5% 01/02/2045	USD	417,303	448,542	0.10
FNMA A04163 3.5% 01/06/2042	USD	31,725	32,686	0.01
FNMA A06755 3.5% 01/06/2042	USD	43,141	44,415	0.01
FNMA A00532 2.5% 01/11/2042	USD	47,653	46,030	0.01
FNMA A00535 3% 01/11/2042	USD	41,292	41,453	0.01
FNMA A07277 3.5% 01/12/2042	USD	115,344	118,786	0.03
FNMA A07316 2.5% 01/01/2043	USD	300,024	290,409	0.06
FNMA A08803 3.5% 01/01/2043	USD	58,687	60,427	0.01
FNMA A09735 3.5% 01/01/2043	USD	131,365	135,258	0.03
FNMA AR2626 2.5% 01/02/2043	USD	160,968	155,810	0.03
FNMA AR9048 3% 01/03/2043	USD	16,369	16,388	-
FNMA AR9139 3% 01/03/2043	USD	17,175	17,194	-
FNMA AR9188 2.5% 01/03/2043	USD	58,600	56,727	0.01
FNMA AR9226 3% 01/03/2043	USD	52,831	52,890	0.01
FNMA A05663 4.5% 01/09/2043	USD	267,811	285,233	0.06
FNMA AS1133 4.5% 01/11/2043	USD	121,674	129,650	0.03
FNMA AS2275 4.5% 01/04/2044	USD	110,238	117,453	0.03
FNMA AS4794 3.5% 01/04/2045	USD	905,046	932,995	0.20
FNMA AS4835 3% 01/04/2045	USD	23,670	23,727	0.01
FNMA AS4864 2.5% 01/05/2030	USD	637,949	638,632	0.14
FNMA AS5175 3.5% 01/06/2045	USD	190,817	196,705	0.04
FNMA AS5184 3.5% 01/06/2045	USD	1,850,356	1,903,155	0.41
FNMA AS5298 2.5% 01/07/2030	USD	238,706	238,962	0.05
FNMA AS5713 3.5% 01/09/2045	USD	477,476	493,685	0.11
FNMA AS5887 4% 01/09/2045	USD	40,753	42,632	0.01
FNMA AS6191 3.5% 01/11/2045	USD	74,571	76,744	0.02
FNMA AS6313 4% 01/12/2045	USD	300,660	316,258	0.07
FNMA AS6324 3.5% 01/12/2045	USD	2,262,799	2,311,907	0.50
FNMA AS6328 3.5% 01/12/2045	USD	445,857	457,555	0.10
FNMA AS6349 4% 01/12/2045	USD	323,639	341,191	0.07
FNMA AS6351 4% 01/12/2045	USD	41,455	43,367	0.01
FNMA AS6400 4% 01/12/2045	USD	152,349	159,282	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 A56563 3.5% 01/01/2046	USD	20,741	21,380	-
FNMA A56840 4% 01/03/2046	USD	491,231	517,926	0.11
FNMA A57171 3.5% 01/05/2046	USD	1,262,323	1,296,443	0.28
FNMA A58067 3% 01/10/2046	USD	1,039,812	1,040,684	0.23
FNMA A58194 2.5% 01/10/2031	USD	197,708	197,368	0.04
FNMA A58301 3% 01/11/2046	USD	386,589	386,913	0.08
FNMA A58305 3% 01/11/2046	USD	272,421	272,491	0.06
FNMA A58318 3% 01/11/2046	USD	1,822,000	1,820,174	0.40
FNMA A58453 3% 01/12/2046	USD	1,001,684	1,001,316	0.22
FNMA A58470 3% 01/12/2046	USD	814,667	816,159	0.18
FNMA A58471 3% 01/12/2046	USD	536,604	537,058	0.12
FNMA A58483 3% 01/12/2046	USD	897,058	896,159	0.19
FNMA A58485 3% 01/12/2046	USD	810,494	812,097	0.18
FNMA A59031 3% 01/06/2033	USD	18,901	18,962	-
FNMA A59032 3% 01/08/2043	USD	74,449	74,451	0.02
FNMA A59043 3% 01/04/2033	USD	8,416	8,470	-
FNMA A59044 3% 01/06/2043	USD	136,118	136,268	0.03
FNMA A59236 3% 01/02/2044	USD	15,044	15,045	-
FNMA A59241 3% 01/09/2044	USD	25,761	25,790	0.01
FNMA A59394 4.5% 01/04/2047	USD	828,832	882,218	0.19
FNMA A59990 4.5% 01/07/2047	USD	319,861	341,192	0.07
FNMA AT0238 2.5% 01/03/2043	USD	63,108	51,407	0.01
FNMA AT1934 3.5% 01/04/2043	USD	25,429	26,177	0.01
FNMA AT2016 3% 01/04/2043	USD	207,588	208,397	0.05
FNMA AT2717 2.5% 01/05/2043	USD	160,203	155,073	0.03
FNMA AT2723 3% 01/05/2043	USD	360,880	362,268	0.08
FNMA AU0640 3.5% 01/07/2043	USD	30,496	31,358	0.01
FNMA AU4293 4% 01/09/2043	USD	1,252,088	1,312,510	0.28
FNMA AU6198 3.5% 01/08/2043	USD	33,771	34,819	0.01
FNMA AX2901 4% 01/10/2044	USD	90,881	95,075	0.02
FNMA AX2909 3% 01/10/2029	USD	441,296	450,130	0.10
FNMA AY4204 3.5% 01/05/2045	USD	164,441	159,209	0.03
FNMA AZ0814 3.5% 01/07/2045	USD	202,966	208,880	0.05
FNMA AZ0880 2.5% 01/07/2030	USD	79,397	79,482	0.02
FNMA AZ2118 3% 01/10/2030	USD	63,158	64,422	0.01
FNMA AZ2867 3.5% 01/10/2045	USD	78,402	80,687	0.02
FNMA AZ4779 4% 01/10/2045	USD	1,487,199	1,555,044	0.34
FNMA AZ7353 3.5% 01/11/2045	USD	1,126,403	1,156,967	0.25
FNMA BC0822 3.5% 01/04/2046	USD	603,605	619,443	0.13
FNMA BC0880 3.5% 01/05/2046	USD	606,343	621,291	0.13
FNMA BC4714 3% 01/10/2046	USD	1,823,453	1,823,921	0.40
FNMA BC4764 3% 01/10/2046	USD	425,490	425,063	0.09
FNMA BC5074 3.5% 01/07/2044	USD	799,902	824,976	0.18
FNMA BC6395 2.5% 01/05/2046	USD	63,336	61,050	0.01
FNMA BC9089 3% 01/12/2046	USD	227,553	227,744	0.05
FNMA BC9556 3% 01/11/2046	USD	172,570	172,886	0.04
FNMA BD0440 3.5% 01/01/2047	USD	214,086	219,703	0.05
FNMA BD0453 3% 01/01/2047	USD	146,066	146,334	0.03
FNMA BD6464 3% 01/11/2046	USD	254,511	254,975	0.06
FNMA BD6496 3% 01/12/2046	USD	140,963	141,221	0.03
FNMA BE1214 3% 01/11/2046	USD	114,836	115,045	0.03
FNMA BE3702 4% 01/06/2047	USD	2,443,666	2,556,065	0.55
FNMA BE3767 3.5% 01/07/2047	USD	424,900	436,161	0.09
FNMA BF0131 3.5% 01/08/2056	USD	656,880	671,559	0.15
FNMA BH2623 4% 01/08/2047	USD	1,252,430	1,310,136	0.28
FNMA BM1423 2.5% 01/05/2032	USD	578,249	577,511	0.13
FNMA BM1879 3.5% 01/01/2044	USD	321,088	331,905	0.07
FNMA MA0561 4% 01/11/2040	USD	207,261	217,828	0.05
FNMA MA0583 4% 01/12/2040	USD	138,856	145,800	0.03
FNMA MA0907 4% 01/11/2041	USD	28,862	30,293	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 MA0971 4% 01/02/2042	USD	44,004	46,186	0.01
FNMA MA1086 3.5% 01/06/2042	USD	52,621	54,280	0.01
FNMA MA1437 3.5% 01/05/2043	USD	79,622	81,984	0.02
FNMA MA2471 3.5% 01/12/2045	USD	177,225	181,875	0.04
FNMA MA2495 3.5% 01/01/2046	USD	719,688	738,571	0.16
FNMA MA2834 3.5% 01/12/2046	USD	1,056,664	1,084,389	0.24
FNMA MA2930 4% 01/03/2047	USD	881,577	921,923	0.20
FNMA MA2959 3.5% 01/04/2047	USD	78,694	80,759	0.02
FNMA MA2960 4% 01/04/2047	USD	452,439	473,166	0.10
FNMA MA2974 4.5% 01/04/2047	USD	334,130	355,618	0.08
FNMA MA3026 3.5% 01/06/2047	USD	2,293,115	2,363,281	0.51
FNMA MA3060 3% 01/07/2032	USD	399,825	407,177	0.09
FNMA MA3090 3% 01/08/2032	USD	1,068,956	1,088,628	0.24
FNMA MA3101 4.5% 01/06/2047	USD	1,379,563	1,468,975	0.32
FNMA MA3120 3.5% 01/09/2047	USD	108,060	110,902	0.02
FNMA MA3155 3% 01/10/2032	USD	301,959	307,516	0.07
FNMA MA3179 3% 01/11/2047	USD	1,144,491	1,143,345	0.25
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-63 'AF' 2.052% 25/09/2046	USD	463,089	468,486	0.10
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-70 'F' 2.002% 25/10/2046	USD	218,559	220,252	0.05
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-64 'FA' 2.052% 25/09/2046	USD	848,324	855,080	0.19
FNMA REMIC, FRN, Series 2017-16 'FA' 2.002% 25/03/2047	USD	183,204	184,667	0.04
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-84 'FT' 2.052% 25/11/2046	USD	254,946	257,637	0.06
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-103 'LF' 2.052% 25/01/2047	USD	84,913	85,767	0.02
FNMA REMIC, FRN, Series 2016-79 'NF' 2.002% 25/11/2046	USD	453,807	457,075	0.10
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2016-A 'A4' 1.6% 15/06/2021	USD	235,000	233,200	0.05
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust, Series 2017-1 'B' 2.25% 15/05/2022	USD	335,000	331,837	0.07
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2017-3 'A' 2.48% 15/09/2024	USD	400,000	398,043	0.09
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2016-5 'B' 2.16% 15/11/2021	USD	685,000	681,825	0.15
Galton Funding Mortgage Trust, FRN, Series 2017-1 'B2', 144A, 3.95% 25/07/2066	USD	880,414	888,328	0.19
George Washington University (The) 3.545% 15/09/2046	USD	200,000	193,062	0.04
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2017-3 'A3' 2.01% 20/11/2020	USD	220,000	219,216	0.05
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2015-3 'A4' 1.81% 20/11/2019	USD	360,000	359,802	0.08
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2016-2 'B' 2.08% 20/03/2020	USD	205,000	203,799	0.04
GM Financial Automobile Leasing Trust, Series 2016-2 'C' 2.58% 20/03/2020	USD	125,000	124,608	0.03
GM Financial Consumer Automobile Receivables Trust, Series 2017-3A 'B', 144A 2.33% 16/03/2023	USD	70,000	69,425	0.02
GMF Floorplan Owner Revolving Trust, Series 2016-1 'B', 144A 2.41% 17/05/2021	USD	100,000	99,815	0.02

銘柄名	通貨	株数または 類出金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
GMF Floorplan Owner Revolving Trust, Series 2017-1 'B', 144A 2.58% 18/01/2022	USD	550,000	550,635	0.12
GMF Floorplan Owner Revolving Trust, Series 2017-3 'B', 144A 2.28% 16/08/2021	USD	425,000	422,096	0.09
GNMA, IO, Series 2011-41 'A'	USD	105,451	5,045	-
GNMA, IO, Series 2012-84 'B'	USD	122,832	13,006	-
GNMA, IO, Series 2011-88 'E'	USD	16,044	949	-
GNMA, IO, Series 2013-82 'G'	USD	164,924	33,157	0.01
GNMA, IO, Series 2010-103 'N'	USD	5,783	277	-
GNMA, IO, Series 2013-24 'O'	USD	52,505	9,544	-
GNMA, IO, Series 2010-82 'P'	USD	5,082	5	-
GNMA 3306 5.5% 20/11/2032	USD	79,413	88,063	0.02
GNMA 3490 6.5% 20/12/2033	USD	80,021	92,765	0.02
GNMA 3611 6% 20/09/2034	USD	48,288	55,420	0.01
GNMA 4060 6% 20/12/2037	USD	5,450	6,153	-
GNMA 4558 4.5% 20/10/2039	USD	113,465	120,315	0.03
GNMA 4559 5% 20/10/2039	USD	23,115	25,194	0.01
GNMA 4577 4.5% 20/11/2039	USD	11,613	12,321	-
GNMA 4715 5% 20/06/2040	USD	17,273	18,855	-
GNMA 4772 5% 20/08/2040	USD	12,167	13,233	-
GNMA 4801 4.5% 20/09/2040	USD	47,607	50,496	0.01
GNMA 4834 4.5% 20/10/2040	USD	39,473	41,858	0.01
GNMA 4854 4.5% 20/11/2040	USD	41,406	43,912	0.01
GNMA 4946 4.5% 20/02/2041	USD	152,391	161,602	0.04
GNMA 4978 4.5% 20/03/2041	USD	42,445	45,010	0.01
GNMA 4979 5% 20/03/2041	USD	94,985	103,345	0.02
GNMA 5054 4% 20/05/2041	USD	69,367	72,952	0.02
GNMA 710827 5% 15/10/2039	USD	12,855	13,908	-
GNMA 723339 5% 15/09/2039	USD	24,652	26,998	0.01
GNMA 782888 5% 15/02/2040	USD	38,361	42,400	0.01
GNMA 782889 5% 15/02/2040	USD	38,361	42,419	0.01
GNMA 783403 3.5% 15/09/2041	USD	75,385	78,026	0.02
GNMA 783726 3.5% 20/03/2043	USD	106,972	110,585	0.02
GNMA 783972 5% 15/12/2039	USD	146,433	160,245	0.03
GNMA 784012 5.5% 15/10/2038	USD	9,938	11,040	-
GNMA 784057 4.5% 15/09/2045	USD	316,084	334,914	0.07
GNMA 784059 5% 15/06/2040	USD	63,260	68,625	0.01
GNMA 784145 3.5% 20/02/2046	USD	302,342	313,535	0.07
GNMA AA3342 3% 15/10/2042	USD	11,106	11,237	-
GNMA AA6403 3% 15/05/2043	USD	15,453	15,688	-
GNMA AD1732 2.5% 15/02/2043	USD	53,551	52,170	0.01
GNMA AJ9334 3.5% 20/10/2044	USD	30,016	31,105	0.01
GNMA AL4508 3.5% 20/02/2045	USD	61,996	64,247	0.01
GNMA AM4385 3.5% 20/05/2045	USD	22,355	23,163	0.01
GNMA AM4931 3.5% 20/04/2045	USD	21,612	22,397	-
GNMA AM8053 3.5% 20/05/2045	USD	48,367	50,107	0.01
GNMA AP0556 3.5% 20/01/2046	USD	17,645	18,245	-
GNMA AR7632 3.5% 20/02/2046	USD	345,555	358,056	0.08
GNMA AC8186 3.5% 20/05/2046	USD	24,292	25,127	0.01
GNMA AC9176 3.5% 20/05/2046	USD	22,914	23,749	0.01
GNMA AC9216 3% 20/05/2046	USD	36,141	36,542	0.01
GNMA AC9217 3% 20/05/2046	USD	23,382	23,633	0.01
GNMA AC9258 3% 20/07/2046	USD	32,361	32,721	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(%)
GNMA AS9259 3% 20/07/2046	USD	66,710	67,399	0.01
GNMA AS9260 3% 20/07/2046	USD	62,975	63,629	0.01
GNMA AT3441 3% 20/07/2046	USD	92,882	93,847	0.02
GNMA AT3442 3% 20/06/2046	USD	70,900	71,590	0.02
GNMA AT4041 3.5% 20/05/2046	USD	3,566	3,688	-
GNMA AT4164 3% 20/07/2046	USD	128,180	129,503	0.03
GNMA AT4176 3% 20/07/2046	USD	24,789	25,046	0.01
GNMA AU0255 3% 20/08/2046	USD	28,467	28,736	0.01
GNMA AU0271 3% 20/08/2046	USD	48,756	49,262	0.01
GNMA AU2016 3% 20/08/2046	USD	53,751	54,282	0.01
GNMA AV8326 3% 20/09/2046	USD	28,162	28,518	0.01
GNMA AV8327 3% 20/09/2046	USD	30,721	31,040	0.01
GNMA MA0221 4% 20/07/2042	USD	134,463	141,342	0.03
GNMA MA0318 3.5% 20/08/2042	USD	136,651	141,940	0.03
GNMA MA0392 3.5% 20/09/2042	USD	46,669	47,426	0.01
GNMA MA0393 4% 20/09/2042	USD	9,146	9,613	-
GNMA MA0460 2.5% 20/10/2042	USD	238,917	236,621	0.06
GNMA MA0535 4% 20/11/2042	USD	85,775	90,156	0.02
GNMA MA0623 2.5% 20/12/2042	USD	559,444	551,734	0.12
GNMA MA0625 3.5% 20/12/2042	USD	59,417	61,717	0.01
GNMA MA0699 3.5% 20/01/2043	USD	868,427	902,041	0.20
GNMA MA0783 3.5% 20/02/2043	USD	47,594	49,437	0.01
GNMA MA1012 3.5% 20/05/2043	USD	289,445	300,648	0.07
GNMA MA1285 3.5% 20/09/2043	USD	658,062	683,537	0.15
GNMA MA1678 4% 20/02/2044	USD	315,545	331,255	0.07
GNMA MA2222 3% 20/09/2044	USD	189,612	191,581	0.04
GNMA MA2896 5.5% 20/06/2045	USD	174,892	189,883	0.04
GNMA MA3033 3% 20/08/2045	USD	980,171	988,386	0.21
GNMA MA3376 3.5% 20/01/2046	USD	354,819	367,082	0.08
GNMA MA3377 4% 20/01/2046	USD	323,274	338,903	0.07
GNMA MA3664 4% 20/05/2046	USD	507,618	530,966	0.12
GNMA MA4068 3% 20/11/2046	USD	224,165	226,044	0.06
GNMA MA4198 4.5% 20/01/2047	USD	44,122	46,477	0.01
GNMA MA4320 3% 20/03/2047	USD	1,021,871	1,030,435	0.22
GNMA MA4323 4.5% 20/03/2047	USD	491,805	518,368	0.11
GNMA MA4452 4% 20/05/2047	USD	4,231,350	4,410,487	0.96
GNMA MA4485 3.5% 20/06/2032	USD	221,304	229,223	0.06
GNMA MA4511 4% 20/06/2047	USD	5,894,202	6,145,466	1.33
GNMA MA4513 5% 20/06/2047	USD	218,559	235,324	0.06
GNMA MA4560 3.5% 20/07/2032	USD	532,250	551,514	0.12
GNMA MA4587 4% 20/07/2047	USD	174,957	182,411	0.04
GNMA MA4588 4.5% 20/07/2047	USD	145,428	153,235	0.03
GNMA MA4589 5% 20/07/2047	USD	139,678	149,247	0.03
GNMA MA4625 3.5% 20/08/2032	USD	165,512	171,435	0.04
GNMA MA4652 3.5% 20/08/2047	USD	927,712	959,388	0.21
GNMA MA4653 4% 20/08/2047	USD	780,509	816,737	0.18
GNMA MA4654 4.5% 20/08/2047	USD	2,626,362	2,770,356	0.60
GNMA MA4655 5% 20/08/2047	USD	230,699	247,169	0.06
GNMA MA4657 6% 20/08/2047	USD	88,197	97,844	0.02
GNMA MA4691 3.5% 20/09/2032	USD	140,706	145,741	0.03
GNMA MA4721 4.5% 20/09/2047	USD	1,700,025	1,796,203	0.39
GNMA MA4722 5% 20/09/2047	USD	680,139	728,411	0.16
GNMA MA4750 3.5% 20/10/2032	USD	798,728	827,298	0.18
GNMA MA4780 4.5% 20/10/2047	USD	211,611	223,713	0.06
GNMA MA4781 5% 20/10/2047	USD	619,278	663,491	0.14
GNMA MA4809 3.5% 20/11/2032	USD	556,740	576,662	0.13
GNMA MA4840 5% 20/11/2047	USD	497,151	531,993	0.12
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 3.691% 06/06/2028	USD	2,015,000	2,043,240	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(%)
Grain Spectrum Funding LLC, 144A 4% 10/10/2033	USD	195,000	195,019	0.04
Great Wolf Trust, FRN, Series 2017- WOLF 'A', 144A 2.477% 15/09/2034	USD	695,000	696,302	0.15
Great Wolf Trust, FRN, Series 2017- WOLF 'B', 144A 2.677% 15/09/2034	USD	355,000	355,367	0.08
GG Mortgage Securities Trust, Series 2015-GC34 'A4' 3.506% 10/10/2048	USD	155,000	159,492	0.03
GG Mortgage-Backed Securities Trust, FRN, Series 2014EB1A '2A1', 144A 2.47% 25/07/2044	USD	43,466	43,112	0.01
GCAA Home Equity Trust, FRN, Series 2005-6 'A3' 1.982% 25/06/2035	USD	37,821	37,563	0.01
Hilton Grand Vacations Trust, Series 2014AA 'A', 144A 1.77% 25/11/2026	USD	46,230	45,520	0.01
Hilton Grand Vacations Trust, Series 2017-AA 'A', 144A 2.66% 26/12/2028	USD	18,717	18,624	-
Hospitality Mortgage Trust, FRN, Series 2017-HIT 'A', 144A 2.094% 06/05/2030	USD	100,000	100,229	0.02
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2017-B 'A3', 144A 1.97% 15/07/2020	USD	1,095,000	1,092,085	0.24
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2017-C 'A3', 144A 2.12% 16/02/2021	USD	215,000	214,436	0.05
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2015-B 'A4', 144A 1.66% 15/07/2019	USD	310,000	309,927	0.07
Hyundai Auto Lease Securitization Trust, Series 2016-A 'A4', 144A 1.8% 16/12/2019	USD	240,000	239,837	0.05
Hyundai Auto Receivables Trust, Series 2016-A 'A4' 1.73% 16/05/2022	USD	305,000	304,765	0.07
INVISTA Finance LLC, 144A 4.25% 15/10/2019	USD	45,000	45,842	0.01
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-LC11 'A5' 2.96% 15/04/2046	USD	145,000	146,407	0.03
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, FRN, Series 2016-JP3 'B' 3.397% 15/08/2049	USD	170,000	165,721	0.04
J.P.Morgan Chase & Co., FRN 2.595% 24/10/2023	USD	1,780,000	1,826,769	0.40
J.P.Morgan Chase & Co., FRN 3.882% 24/07/2038	USD	3,585,000	3,692,693	0.80
Jimmy Johns Funding LLC, Series 2017-1A 'A2', 144A 3.61% 30/07/2047	USD	94,763	95,231	0.02
JobsOhio Beverage System 'B' 4.532% 01/01/2035	USD	155,000	173,833	0.04
John Deere Owner Trust, Series 2015- A 'A4' 1.65% 15/12/2021	USD	115,000	114,843	0.02
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2014-C22 'A4' 3.801% 15/09/2047	USD	430,000	450,553	0.10
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2016-C2 'A1' 1.423% 15/06/2049	USD	231,660	228,753	0.05
Kaiser Foundation Hospitals, Inc. 3.6% 01/04/2022	USD	250,000	257,361	0.06
Kubota Credit Owner Trust, Series 2015-1A 'A3', 144A 1.54% 15/03/2019	USD	166,231	166,120	0.04
Kubota Credit Owner Trust, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.5% 15/07/2020	USD	120,000	119,139	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 (%)
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.85% 01/08/2044	USD	1,005,000	1,118,595	0.24
Los Angeles Community College District 6.75% 01/08/2049	USD	150,000	232,287	0.05
Maryland State Transportation Authority 5.754% 01/07/2041	USD	85,000	111,964	0.02
Maryland State Transportation Authority 5.888% 01/07/2043	USD	165,000	220,468	0.05
Metropolitan Transportation Authority 7.336% 15/11/2039	USD	80,000	124,067	0.03
Microsoft Corp. 2.4% 06/02/2022	USD	1,850,000	1,850,444	0.40
Mill City Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2016-1 'A1', 144A 2.5% 25/04/2057	USD	117,120	116,654	0.03
Mill City Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2017-2 'A1', 144A 2.75% 25/07/2059	USD	368,292	368,943	0.08
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2017-AA 'A2', 144A 1.73% 18/05/2020	USD	85,765	85,653	0.02
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2014-AA 'A4', 144A 1.59% 08/02/2022	USD	110,000	109,598	0.02
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2015-AA 'A4', 144A 1.93% 18/07/2021	USD	100,000	99,874	0.02
MMAF Equipment Finance LLC, Series 2016-AA 'A4', 144A 1.76% 17/01/2023	USD	335,000	329,695	0.07
Morgan Stanley, FRN 3.591% 22/07/2028	USD	575,000	580,454	0.13
Morgan Stanley, FRN 3.971% 22/07/2038	USD	425,000	438,710	0.10
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2014-C18 '300A' 3.749% 15/08/2031	USD	205,000	209,035	0.05
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2016-C30 'A5' 2.86% 15/09/2049	USD	525,000	515,131	0.11
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015- C24 'A5' 4.036% 15/05/2048	USD	60,000	62,274	0.01
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C27 'A5' 4.068% 15/12/2047	USD	115,000	120,011	0.03
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, FRN, Series 2015- C24 'B' 4.497% 15/05/2048	USD	110,000	109,762	0.02
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2017-H1 'A5' 3.53% 15/06/2050	USD	1,250,000	1,287,517	0.28
Morgan Stanley Capital I Trust, FRN, Series 2015-MC1 'A5' 4.164% 15/05/2048	USD	20,000	20,748	-
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2017-H1 'A5' 3.773% 15/06/2050	USD	165,000	169,176	0.04
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2017-H1 'B' 4.075% 15/06/2050	USD	180,000	183,852	0.04
Morgan Stanley Capital I, Inc., FRN, Series 2017-JWDR 'A', 144A 2.1% 15/11/2034	USD	665,000	665,829	0.14
Morgan Stanley Capital I, Inc., FRN, Series 2017-ASHF 'B', 144A 2.5% 15/11/2034	USD	1,210,000	1,210,579	0.26
MortgageIT Trust, FRN, Series 2005-2 '1M1' 1.989% 25/05/2035	USD	184,522	177,055	0.04
MWV Owner Trust, Series 2013-1A 'A', 144A 2.15% 22/04/2030	USD	380,088	375,297	0.08
MWV Owner Trust, Series 2014-1A 'A', 144A 2.25% 22/09/2031	USD	38,953	38,418	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（%）
M/VW Owner Trust, Series 2017-1A 'A', 144A 2.42% 20/12/2034	USD	96,129	95,289	0.02
Naviert Private Education Loan Trust, Series 2017-A 'A2A', 144A 2.88% 16/12/2058	USD	145,000	143,580	0.03
New York City Municipal Water Finance Authority 5.952% 15/06/2042	USD	320,000	448,045	0.10
New York City Transitional Finance Authority 5.508% 01/08/2037	USD	175,000	223,134	0.06
New York State Dormitory Authority 3.879% 01/07/2046	USD	550,000	565,273	0.12
Nissan Auto Lease Trust, Series 2017- A 'A3' 1.91% 15/04/2020	USD	485,000	483,322	0.10
Nissan Auto Lease Trust, Series 2017- B 'A3' 2.05% 15/09/2020	USD	430,000	429,097	0.09
Nissan Auto Receivables Owner Trust, Series 2016-C 'A3' 1.18% 15/01/2021	USD	250,000	247,453	0.06
Nissan Master Owner Trust, Series 2015-A 'A2' 1.44% 15/01/2020	USD	185,000	184,972	0.04
Nissan Master Owner Trust Receivables, FRN, Series 2017-B 'A' 1.68% 18/04/2022	USD	440,000	442,142	0.10
Nissan Master Owner Trust Receivables, FRN, Series 2017-C 'A' 1.501% 17/10/2022	USD	555,000	556,797	0.12
North Carolina Eastern Municipal Power Agency 2.003% 01/07/2018	USD	5,000	5,002	-
O'Rilly Automotive, Inc. 4.875% 14/01/2021	USD	175,000	185,350	0.04
Palcados Contar Trust, Series 2016- PLSD 'A', 144A 2.713% 13/04/2033	USD	445,000	442,337	0.10
Port Authority of New York and New Jersey 4.458% 01/10/2062	USD	330,000	381,454	0.08
Pricolinc Group, Inc. (The) 3.65% 15/03/2025	USD	365,000	371,420	0.08
Pricolinc Group, Inc. (The) 3.6% 01/06/2026	USD	680,000	684,066	0.15
Pricolinc Group, Inc. (The) 3.55% 15/03/2028	USD	190,000	188,189	0.04
Principal Financial Group, Inc., FRN 4.7% 15/05/2055	USD	620,000	636,111	0.14
OVC, Inc. 5.125% 02/07/2022	USD	795,000	838,021	0.18
OVC, Inc. 4.375% 15/03/2023	USD	225,000	230,388	0.05
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30/06/2026	USD	385,000	432,542	0.09
Sabine Pass Liquefaction LLC 5% 15/03/2027	USD	1,595,000	1,706,187	0.37
Sabine Pass Liquefaction LLC 4.2% 15/03/2028	USD	640,000	649,574	0.14
San Diego County Water Authority Financing Corp. 'B' 6.138% 01/05/2049	USD	70,000	98,963	0.02
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2017-1 'A2' 1.49% 18/02/2020	USD	85,369	85,302	0.02
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2017-1 'B' 2.1% 15/06/2021	USD	60,000	59,864	0.01
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2015-4 'C' 2.97% 15/03/2021	USD	302,000	304,132	0.07
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2017-1 'C' 2.58% 16/05/2022	USD	70,000	69,536	0.02
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2014-3 'D' 2.65% 17/08/2020	USD	70,000	70,226	0.02



銘柄名	通貨	株数または 額出金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2015-5 'D', 3.65% 15/12/2021	USD	80,000	81,228	0.02
SBA Tower Trust, 144A 2.898% 11/10/2044	USD	175,000	175,455	0.04
SBA Tower Trust, 144A 3.156% 10/10/2045	USD	300,000	303,375	0.07
SBA Tower Trust, 144A 3.168% 09/04/2047	USD	440,000	434,661	0.09
SBA Tower Trust, 144A 3.869% 08/10/2049	USD	150,000	151,370	0.03
Seavica Mortgage Trust, FRN, Series 2017-5 'B1', 144A 3.9% 25/08/2047	USD	222,938	227,803	0.05
Sierra Timshare Receivables Funding LLC, FRN, Series 2014-2A 'A', 144A 2.05% 20/06/2031	USD	233,083	232,632	0.05
Sierra Timshare Receivables Funding LLC, Series 2014-3A 'A', 144A 2.3% 20/10/2031	USD	19,711	19,647	-
Sierra Timshare Receivables Funding LLC, Series 2015-1A 'A', 144A 2.4% 22/03/2032	USD	378,069	376,718	0.08
Sierra Timshare Receivables Funding LLC, Series 2015-2A 'A', 144A 2.43% 20/06/2032	USD	85,384	84,978	0.02
Sierra Timshare Receivables Funding LLC, Series 2015-3A 'A', 144A 2.58% 20/09/2032	USD	275,615	275,507	0.06
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-9 'A' 2.814% 25/04/2023	USD	536,763	549,756	0.12
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-4 'A4' 2.964% 25/07/2022	USD	412,942	423,680	0.09
SLM Student Loan Trust, FRN, Series 2008-5 'A4' 3.014% 25/07/2023	USD	286,236	295,501	0.06
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-A 'A2A', 144A 2.49% 15/06/2027	USD	129,485	129,249	0.03
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-B 'A2A', 144A 2.98% 15/07/2027	USD	144,093	144,957	0.03
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-C 'A2A', 144A 2.75% 15/07/2027	USD	160,991	161,301	0.04
SMB Private Education Loan Trust, Series 2016-A 'A2A', 144A 2.7% 15/06/2031	USD	105,000	104,518	0.02
SMB Private Education Loan Trust, Series 2015-C 'A2A', 144A 2.34% 15/09/2034	USD	835,000	817,567	0.18
SMB Private Education Loan Trust, FRN, Series 2015-B 'A3', 144A 3% 17/05/2032	USD	400,000	417,445	0.09
SMB Private Education Loan Trust, FRN, Series 2015-C 'A3', 144A 3.2% 16/08/2032	USD	445,000	466,704	0.10
SMB Private Education Loan Trust, Series 2014-A 'B', 144A 3.5% 15/11/2044	USD	990,000	1,003,396	0.22
South Carolina Public Service Authority 'D' 2.388% 01/12/2023	USD	240,000	228,478	0.05
South Carolina State Public Service Authority 'D' 4.77% 01/12/2045	USD	162,000	175,785	0.04
Springleaf Funding Trust, Series 2015-AA 'A', 144A 2.9% 15/11/2029	USD	230,000	230,388	0.05
State Board of Administration Finance Corp. 2.995% 01/07/2020	USD	365,000	369,814	0.08
SunTrust Auto Receivables Trust, Series 2015-1A 'A4', 144A 1.78% 15/01/2021	USD	495,000	493,796	0.11

銘柄名	通貨	枚数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-2 'A' 2.22% 15/01/2022	USD	300,000	300,424	0.07
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2012-7 'A' 1.78% 15/09/2022	USD	315,000	312,708	0.07
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2013-1 'B' 1.69% 15/03/2021	USD	205,000	204,976	0.04
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2015-1 'B' 2.64% 15/03/2023	USD	300,000	300,334	0.07
Synchrony Credit Card Master Note Trust, Series 2017-1 'C' 2.58% 15/06/2023	USD	1,140,000	1,131,901	0.25
Time Warner Cable LLC 6.55% 01/05/2037	USD	353,000	413,183	0.09
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-5 'A1', 144A 2.6% 25/10/2066	USD	800,320	796,263	0.17
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2017-3 'A1', 144A 2.75% 25/06/2057	USD	328,758	328,932	0.07
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2017-5 'A1', 144A 2.162% 25/02/2057	USD	277,024	277,145	0.06
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-2 'A1A', 144A 2.75% 25/08/2055	USD	211,278	211,646	0.05
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-3 'A1B', 144A 3% 25/03/2054	USD	102,034	102,706	0.02
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-4 'A1B', 144A 2.75% 25/04/2055	USD	117,186	117,487	0.03
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-5 'A1B', 144A 2.75% 25/05/2055	USD	344,246	345,089	0.07
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-1 'A1B', 144A 2.75% 25/02/2055	USD	104,617	104,875	0.02
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-1 'A3B', 144A 3% 25/02/2055	USD	132,832	133,478	0.03
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-4 'M1', 144A 3.75% 25/04/2055	USD	1,110,000	1,155,947	0.25
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2015-5 'M1', 144A 3.6% 25/05/2055	USD	225,000	230,367	0.05
Towd Point Mortgage Trust, FRN, Series 2016-4 'M1', 144A 3.25% 25/07/2056	USD	285,000	286,388	0.06
Trinity Acquisition plc 3.6% 15/09/2021	USD	315,000	320,457	0.07
United Airlines Pass Through Trust, Series 2014-2 'B' 4.625% 03/03/2024	USD	356,906	369,826	0.08
University of North Carolina at Chapel Hill 3.847% 01/12/2034	USD	210,000	227,533	0.05
US Airways Pass Through Trust, Series 2012-2 'A' 4.625% 03/12/2026	USD	85,722	91,204	0.02
US Airways Pass Through Trust, Series 2013-1 'A' 3.95% 15/05/2027	USD	96,586	100,566	0.02
USAA Auto Owner Trust, Series 2016-1 'B' 1.82% 15/10/2023	USD	536,000	528,870	0.11
Utah Transit Authority 'B' 5.937% 15/06/2039	USD	145,000	192,305	0.04
Utility Debt Securitization Authority, Series 2013-T T1 0% 15/06/2021	USD	89,000	88,723	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（%）
Verizon Owner Trust, Series 2017-1A 'A', 144A 2.06% 20/09/2021	USD	415,000	414,016	0.09
Verizon Owner Trust, Series 2017-1A 'B', 144A 2.45% 20/09/2021	USD	125,000	125,067	0.03
Verizon Owner Trust, Series 2017-2A 'B', 144A 2.22% 20/12/2021	USD	540,000	533,957	0.12
Verizon Owner Trust, Series 2016-2A 'C', 144A 2.36% 20/05/2021	USD	180,000	178,950	0.04
Verizon Owner Trust, Series 2017-1A 'C', 144A 2.65% 20/09/2021	USD	165,000	164,978	0.04
Volvo Financial Equipment LLC, Series 2016-1A 'A3', 144A 1.67% 18/02/2020	USD	320,000	319,601	0.07
Volvo Financial Equipment Master Owner Trust, FRN, Series 2017-A 'A', 144A 1.764% 15/11/2022	USD	140,000	140,493	0.03
WaMu Mortgage Pass-Through Certificate Trust, FRN, Series 2005-AR8 '2AC2' 1.789% 25/07/2045	USD	244,742	244,938	0.05
Wells Fargo & Co., FRN 2.475% 24/01/2023	USD	215,000	219,281	0.05
Wells Fargo & Co., FRN 3.684% 22/05/2028	USD	1,565,000	1,593,193	0.35
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2016-C34 'A4' 3.096% 15/05/2049	USD	800,000	800,422	0.17
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-NKS2 'A5' 4.039% 15/07/2058	USD	35,000	36,745	0.01
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-NKS2 'B' 4.394% 15/07/2058	USD	50,000	51,067	0.01
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2017-C38 'B' 3.917% 15/07/2050	USD	930,000	942,820	0.20
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2015-LC20 'C' 4.056% 15/04/2050	USD	105,000	101,822	0.02
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-NKS2 'C' 4.394% 15/07/2058	USD	30,000	28,622	0.01
Wendys Funding LLC, Series 2015-1A 'A2', 144A 3.371% 15/06/2045	USD	522,963	525,696	0.11
Wendys Funding LLC, Series 2018-1A 'A2', 144A 3.573% 15/03/2048	USD	345,000	345,324	0.07
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C18 'A3' 3.651% 15/12/2046	USD	100,000	102,823	0.02
WFRBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2014-C22 'A5' 4.069% 15/09/2057	USD	1,000,000	1,045,184	0.23
WFRBS Commercial Mortgage Trust, FRN, Series 2014-C19 'B' 4.723% 15/03/2047	USD	79,000	83,027	0.02
Wheels SPV 2 LLC, Series 2015-1A 'A2', 144A 1.27% 22/04/2024	USD	20,317	20,299	-
Wheels SPV 2 LLC, Series 2017-1A 'A2', 144A 1.88% 20/04/2026	USD	200,000	199,203	0.04
Willis North America, Inc. 3.6% 15/05/2024	USD	505,000	512,724	0.11
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2013-A 'A' 1.61% 15/12/2021	USD	1,080,000	1,079,792	0.23
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2015-A 'A3' 1.34% 15/05/2020	USD	61,898	61,800	0.01
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2016-A 'A4' 1.95% 15/05/2022	USD	225,000	223,503	0.05

銘柄名	通貨	枚数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
World Omni Auto Receivables Trust, Series 2017-B 'B' 2.37% 15/05/2024	USD	340,000	336,412	0.07
Worldwide Plaza Trust, Series 2017- WWP 'A', 144A 3.526% 10/11/2036	USD	390,000	401,309	0.09
			<b>240,095,866</b>	<b>52.13</b>
<b>債券 計</b>			<b>263,816,064</b>	<b>57.28</b>
<b>コマーシャル・ペーパー</b>				
<b>アメリカ</b>				
Boston Scientific Corp. 0% 09/01/2018	USD	400,000	399,769	0.09
Enbridge Energy Partners LP 0% 11/01/2018	USD	490,000	489,589	0.10
			<b>889,358</b>	<b>0.19</b>
<b>コマーシャル・ペーパー 計</b>			<b>889,358</b>	<b>0.19</b>
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 計			<b>294,706,322</b>	<b>57.47</b>
<b>有価証券 計</b>			<b>438,477,080</b>	<b>95.20</b>

## TBA取引

国	銘柄名	通貨	額面	評価額 USD	評価 (損)益 USD	純資産 比率 (%)
United States of America	FNMA, 3.00% 25/01/2032	USD	1,520,000	1,546,719	(2,019)	0.34
United States of America	FNMA, 3.50% 25/01/2032	USD	4,690,000	4,837,203	(9,036)	1.05
United States of America	FNMA, 3.50% 25/01/2047	USD	2,485,000	2,548,096	610	0.55
United States of America	FNMA, 4.00% 25/01/2047	USD	1,440,000	1,504,237	(1,941)	0.33
<b>TBA取引 (ロングポジション) 計</b>				<b>10,436,255</b>	<b>(12,378)</b>	<b>2.27</b>
<b>TBA取引 計</b>				<b>10,436,255</b>	<b>(12,378)</b>	<b>2.27</b>

## 為替予約取引

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	満期日	取引相手方	評価 (損)益 USD	純資産 比率 (%)
EUR	101,300	USD	120,416	31/01/2018	Bank of America	1,286	-
EUR	16,960,200	USD	20,113,631	31/01/2018	Deutsche Bank	250,376	0.06
EUR	11,787,449	USD	13,966,136	31/01/2018	J.P. Morgan	206,263	0.04
EUR	6,464,161	USD	7,723,102	31/01/2018	BNP Paribas	30,891	0.01
EUR	17,668,022	USD	20,929,056	29/02/2018	J.P. Morgan	330,096	0.07
EUR	16,938,993	USD	19,921,689	29/02/2018	FBC	460,258	0.10
EUR	16,823,039	USD	20,067,496	29/03/2018	Barclays	213,058	0.04
EUR	6,867,149	USD	8,143,207	29/03/2018	BNP Paribas	123,241	0.03
EUR	2,213,465	USD	2,646,382	29/03/2018	J.P. Morgan	22,968	-
GBP	69,320	USD	93,272	31/01/2018	J.P. Morgan	626	-
GBP	5,070,742	USD	6,696,247	31/01/2018	FBC	163,144	0.04
<b>為替予約取引にかかる評価益 計</b>						<b>1,801,129</b>	<b>0.39</b>

通貨 買い	金額	通貨 売り	金額	満期日	取引相手方	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)
USD	8,527,055	EUR	7,126,010	31/01/2018	BNP Paribas	(34,107)	(0.01)
USD	1,490,412	EUR	1,248,951	31/01/2018	J.P. Morgan	(10,072)	-
USD	17,848	GBP	13,102	31/01/2018	J.P. Morgan	(181)	-
為替予約取引にかかる評価損 計						(44,360)	(0.01)
為替予約取引にかかる評価 (損) 益 計						1,756,768	0.38

## 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, 20/03/2018 US 10	(23)	USD	(2,890,200)	19,148	-	
Year Ultra Note, 20/03/2018	(170)	USD	(22,676,406)	88,004	0.02	
US 5 Year Note, 29/03/2018	(138)	USD	(15,677,900)	48,781	0.01	
先物取引にかかる評価益 計					154,933	0.03
US 2 Year Note, 29/03/2018	261	USD	56,882,547	(99,077)	(0.02)	
US Long Bond, 20/03/2018	44	USD	6,719,525	(19,250)	-	
US Ultra Bond, 20/03/2018	(7)	USD	(1,189,437)	(1,068)	-	
先物取引にかかる評価損 計					(119,369)	(0.02)
先物取引にかかる評価 (損) 益 計					35,564	0.01

## 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	制約先	売買 先	利息 (支払) 受取 レート	満期日	評価 USD	評価 (損) 益 USD	純資産 比率 (%)
1,960,000	USD	J.P. Morgan	COX NAIG28V1	Sell	1.00%	30/12/2022	46,957	46,957	0.01
クレジット・デフォルト・スワップ取引 にかかる評価益 計								46,957	0.01
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								46,957	0.01

現金	17,355,365	3.77
その他資産 (負債)	4,766,028	1.03
純資産 計	460,508,473	100.00

## 国別投資比率

	純資産比率 (%)
アメリカ	83.68
イギリス	1.55
中国	1.33
オーストラリア	1.21
イタリア	0.95
スイス	0.89
フランス	0.81
メキシコ	0.75
ベルギー	0.70
オランダ	0.52
カナダ	0.51
チリ	0.42
インドネシア	0.41
アイルランド	0.38
スペイン	0.31
イスラエル	0.21
クウェート	0.12
バミューダ	0.09
ブラジル	0.08
コロンビア	0.08
香港	0.06
パナマ	0.06
モロッコ	0.05
シンガポール	0.04
有価証券 計	95.20
現金及びその他資産 (負債)	-4.80
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](#)

## 有価証券明細表

Emerging Markets Equity Fund

2017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 (%)
<b>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</b>				
<b>株式</b>				
<b>アルゼンチン</b>				
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA, ADR	USD	101,039	2,286,513	0.11
MercadoLibre, Inc.	USD	52,600	16,484,840	0.81
Tenaris SA, ADR	USD	256,800	8,073,792	0.40
			<b>26,845,145</b>	<b>1.32</b>
<b>ベルギー</b>				
Anheuser-Busch InBev SA	EUR	70,911	7,922,526	0.39
			<b>7,922,526</b>	<b>0.39</b>
<b>ブラジル</b>				
Banco Bradesco SA Preference	BRL	1,832,123	18,719,962	0.92
BR Malls Participacoes SA	BRL	2,497,099	9,595,240	0.47
BRF SA	BRL	589,512	6,613,870	0.32
Itau Unibanco Holding SA Preference	BRL	5,216,324	67,044,304	3.29
Lojas Renner SA	BRL	4,452,338	47,696,422	2.34
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	BRL	428,223	9,164,481	0.45
Raia Drogasil SA	BRL	1,867,694	46,211,570	2.26
			<b>204,945,849</b>	<b>10.05</b>
<b>チリ</b>				
Banco Santander Chile, ADR	USD	707,643	22,248,296	1.09
SAGI Fabelba	CLP	1,540,957	15,293,494	0.75
			<b>37,541,790</b>	<b>1.84</b>
<b>中国</b>				
58.com, Inc., ADR	USD	124,700	8,869,911	0.43
AAC Technologies Holdings, Inc.	HKD	373,500	6,654,110	0.33
Alibaba Group Holding Ltd., ADR Anhui	USD	586,963	100,881,331	4.95
Conch Cement Co. Ltd. 'A' ** Anhui	CNY	1,717,446	7,744,770	0.38
Conch Cement Co. Ltd. 'H' Baidu, Inc., ADR	USD	2,202,500	10,357,801	0.51
China Longyuan Power Group Corp. Ltd. 'H'	USD	177,100	41,542,347	2.04
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	HKD	8,558,000	6,088,437	0.30
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	HKD	7,371,000	21,926,101	1.07
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	HKD	6,226,000	12,569,806	0.62
Crtp.com International Ltd., ADR Gree	USD	304,500	13,565,475	0.66
Electric Appliances, Inc. 'A' **	USD	603,700	4,056,156	0.20
Hangzhou Hikvision Digital Technology Co. Ltd. 'A' **	CNY	1,631,030	9,779,950	0.48
Hangzhou Robam Appliances Co. Ltd. 'A' **	CNY	531,389	3,929,743	0.19
Hengan International Group Co. Ltd.	HKD	2,551,000	28,309,580	1.39
Huanong Renewables Corp. Ltd. 'H'	HKD	19,464,000	6,596,462	0.32
Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A' **	CNY	116,546	12,391,046	0.61
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	HKD	4,187,600	43,584,485	2.14
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	HKD	980,000	12,516,827	0.61
TAL Education Group, ADR	USD	251,747	7,403,879	0.36
Tencent Holdings Ltd.	HKD	2,843,500	147,432,411	7.23
Wuxi Biologics Cayman, Inc.	HKD	245,000	1,370,471	0.07
			<b>507,571,098</b>	<b>24.89</b>
<b>コロンビア</b>				
Grupo Aval Acciones y Valores SA, ADR Preference	USD	780,209	6,662,985	0.33
			<b>6,662,985</b>	<b>0.33</b>
<b>香港</b>				
AIA Group Ltd.	HKD	5,975,500	50,951,641	2.50
			<b>50,951,641</b>	<b>2.50</b>

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率(%)
<b>ハンガリー</b>				
OTP Bank plc	HUF	202,991	8,384,684	0.41
			<b>8,384,684</b>	<b>0.41</b>
<b>インド</b>				
Axis Bank Ltd.	INR	2,230,267	19,670,129	0.96
HDFC Bank Ltd.	INR	455,442	13,450,156	0.66
HDFC Standard Life Insurance Co. Ltd.	INR	606,091	3,663,214	0.18
Housing Development Finance Corp. Ltd.	INR	1,184,376	31,706,086	1.56
ICICI Bank Ltd.	INR	3,316,696	16,276,981	0.80
ManuS Suzuki India Ltd.	INR	121,783	18,537,951	0.91
NTPC Ltd.	INR	2,434,960	6,746,117	0.33
Power Grid Corp. of India Ltd.	INR	2,809,095	8,806,158	0.43
Tata Motors Ltd.	INR	1,165,790	7,870,988	0.39
Yoc Bank Ltd.	INR	2,948,112	14,529,320	0.71
			<b>141,250,099</b>	<b>6.93</b>
<b>インドネシア</b>				
Astra International Tbk. PT	IDR	30,190,600	18,460,717	0.91
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	17,371,500	28,027,528	1.37
Matahari Department Store Tbk. PT	IDR	4,240,100	3,122,735	0.15
			<b>49,610,980</b>	<b>2.43</b>
<b>メキシコ</b>				
Fresnillo plc	GBP	686,106	13,234,346	0.65
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, ADR	USD	19,268	3,600,610	0.17
Grupo Financiero Santander Mexico SAB de CV, ADR 'B'	USD	670,343	4,792,953	0.24
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	MXN	10,175,940	24,518,219	1.20
			<b>46,046,127</b>	<b>2.26</b>
<b>ペルー</b>				
Credicorp Ltd.	USD	71,000	14,763,030	0.72
Southern Copper Corp.	USD	186,200	8,763,664	0.43
			<b>23,526,694</b>	<b>1.15</b>
<b>フィリピン</b>				
BDO Unibank, Inc.	PHP	2,759,247	9,061,736	0.45
GT Capital Holdings, Inc.	PHP	349,745	9,048,247	0.44
SM Investments Corp.	PHP	1,347,968	26,710,938	1.31
Universal Robina Corp.	PHP	5,151,340	15,574,559	0.76
			<b>60,393,479</b>	<b>2.96</b>
<b>ロシア</b>				
Magnit PJSC, GDR	USD	565,897	15,477,283	0.76
Mail.Ru Group Ltd., GDR Preference	USD	324,119	9,367,039	0.46
Sberbank of Russia PJSC, ADR	USD	3,956,579	66,984,882	3.28
X5 Retail Group NV, GDR	USD	246,937	9,326,811	0.46
Yandex.NV 'A'	USD	253,400	8,368,001	0.41
			<b>100,522,016</b>	<b>5.37</b>
<b>南アフリカ</b>				
Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	ZAR	693,089	15,620,128	0.77
Bid Corp. Ltd.	ZAR	360,098	8,802,487	0.43
Clicks Group Ltd.	ZAR	673,643	9,909,524	0.48
FirstRand Ltd.	ZAR	5,891,628	32,178,085	1.58
Mr Price Group Ltd.	ZAR	725,112	14,420,266	0.71
Naspers Ltd. 'N'	ZAR	112,696	31,686,096	1.56
Sanlam Ltd.	ZAR	2,942,090	20,787,766	1.02
Shoprite Holdings Ltd.	ZAR	1,700,732	30,551,600	1.50
			<b>163,854,051</b>	<b>8.04</b>

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 USD	純資産 比率 (%)
<b>韓国</b>				
AMOREPACIFIC Group	KRW	71,081	9,403,819	0.46
LG Household & Health Care Ltd.	KRW	45,160	50,327,557	2.47
NAVER Corp.	KRW	28,706	23,434,078	1.15
Samsung Electronics Co. Ltd. Preference	KRW	10,301	20,184,706	0.99
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	45,968	109,817,256	5.38
			<b>213,167,416</b>	<b>10.45</b>
<b>台湾</b>				
Catcher Technology Co. Ltd.	TWD	2,257,000	24,955,414	1.23
Largan Precision Co. Ltd.	TWD	295,000	39,976,374	1.96
President Chain Store Corp.	TWD	1,711,000	16,376,286	0.80
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	12,837,050	99,284,524	4.87
Uni-President Enterprises Corp.	TWD	6,256,783	13,920,246	0.68
			<b>194,512,844</b>	<b>9.54</b>
<b>タイ</b>				
Airports of Thailand PCL	THB	7,736,600	16,142,645	0.79
CP ALL PCL	THB	16,516,600	39,023,572	1.92
			<b>55,166,217</b>	<b>2.71</b>
<b>トルコ</b>				
BİM Birleik Magazalar A/S	TRY	883,733	18,173,438	0.89
			<b>18,173,438</b>	<b>0.89</b>
<b>アラブ首長国連邦</b>				
DP World Ltd.	USD	416,498	10,412,450	0.51
Emaar Malls PJSC	AED	8,480,028	4,917,363	0.24
First Abu Dhabi Bank PJSC	AED	6,862,728	19,150,322	0.94
			<b>34,480,135</b>	<b>1.69</b>
<b>株式 計</b>			<b>1,000,536,114</b>	<b>96.15</b>
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			<b>1,000,536,114</b>	<b>96.15</b>
<b>有価証券 計</b>			<b>1,000,536,114</b>	<b>96.15</b>
<b>現金</b>				
			<b>77,017,843</b>	<b>3.81</b>
<b>その他資産（負債）</b>			<b>821,410</b>	<b>0.04</b>
<b>純資産 計</b>			<b>2,038,975,367</b>	<b>100.00</b>

#### 国別投資比率

	純資産比率 (%)
中国	24.89
韓国	10.45
ブラジル	10.05
台湾	9.54
南アフリカ	8.04
インド	6.33
ロシア	5.37
フィリピン	2.96
タイ	2.71
香港	2.50
インドネシア	2.43
メキシコ	2.28
チリ	1.84
アラブ首長国連邦	1.69
アルゼンチン	1.32
ペルー	1.15
トルコ	0.89
ハンガリー	0.41
ベルギー	0.39
コロンビア	0.33
<b>有価証券 計</b>	<b>96.15</b>
現金及びその他資産（負債）	3.85
<b>合計</b>	<b>100.00</b>

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](#)



## 財務諸表に関する注記（抜粋）

2017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

各ファンド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、公認された取引所または通常主要とされる市場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以下を表す。

- ( ) 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
- ( ) 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

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。米ドル以外を基準通貨とする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、当年度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	2017年12月31日 現在のレート	2017年12月31日に終了した 年度の平均レート
カナダ・ドル	1.2559	NA
スイス・フラン	0.9762	NA
ユーロ	0.8338	0.8850
ノルウェー・クローネ	8.1988	NA
スウェーデン・クローナ	8.2051	NA
日本円	112.5050	NA
イギリス・ポンド	0.7398	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。為替ヘッジ・クラスの通貨エクスポージャーのヘッジのための金融商品から発生する「費用、関連する負債、収益」は各クラスに割り当てられる。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証券発行費用は、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

2017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	担保の タイプ	受入担保額	差入担保額
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Bank of America	現金	250,000	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	Citibank	現金	537,995	-
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	-	3,510,000
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	-	850,000
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	HSBC Bank	現金	2,920,000	-
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	-	270,000
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	RBS	現金	290,000	-
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	J.P.Morgan	現金	338,000	-
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	RBS	現金	230,000	-

## 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。2017年12月31日現在、為替予約取引の未実現損益は貸借対照表に反映された。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投資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、深セン・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株にかかる投下資本の回金には、一定の制限と中国政府が関わる行政手続きが課される。ゆえに、政府の要件を満たさなかった場合、資産の持ち出し(回金)が著しく遅延する、または資産価値が毀損する可能性がある。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、2017年12月31日に終了した年度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	21.03
USアグリゲート・ボンド・ファンド	8.67
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	6.25
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	14.33
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	31.63
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	10.51

### 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。分配金は、当該クラスの基準通貨で公表され、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。

2017年12月31日に終了した年度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	0.052846	2017年 1月23日
	Jd	米ドル	0.044216	2017年 2月17日
	Jd	米ドル	0.060279	2017年 3月22日
	Jd	米ドル	0.047105	2017年 4月21日
	Jd	米ドル	0.046701	2017年 5月22日
	Jd	米ドル	0.051504	2017年 6月21日
	Jd	米ドル	0.047271	2017年 7月21日
	Jd	米ドル	0.046760	2017年 8月21日
	Jd	米ドル	0.052723	2017年 9月21日
	Jd	米ドル	0.046672	2017年 10月23日
	Jd	米ドル	0.049029	2017年 11月21日
	Jd	米ドル	0.049056	2017年 12月20日
	USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.025198
Jd		米ドル	0.023053	2017年 2月17日
Jd		米ドル	0.029689	2017年 3月22日
Jd		米ドル	0.025597	2017年 4月21日
Jd		米ドル	0.025212	2017年 5月22日
Jd		米ドル	0.026069	2017年 6月21日
Jd		米ドル	0.026112	2017年 7月21日
Jd		米ドル	0.024392	2017年 8月21日
Jd		米ドル	0.027543	2017年 9月21日
Jd		米ドル	0.025985	2017年 10月23日
Jd		米ドル	0.025965	2017年 11月21日
Jd		米ドル	0.024736	2017年 12月20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	0.020008
	Jd	米ドル	0.046335	2017年 5月22日
	Jd	米ドル	0.047798	2017年 8月21日
	Jd	米ドル	0.020129	2017年 11月21日

### 4. カストディーフィー

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. 会計、受益者サービス

損益および純資産変動計算書における会計、受益者サービスの項目には、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%に逓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

2017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受益証券(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受益証券(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所得税の課税対象となっている。外国所得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。2017年12月31日に終了した年度においては、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・ゲインに起因する当期の税金費用あるいは繰延税金費用は控除されていない。2017年12月31日現在、以下のファンドは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。

エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド 3,428,537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、管理会社報酬を当社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・バリュエーション・エクイティ・ファンド  
上記ファンドのクラスJ受益証券には管理会社報酬はない。

### b) 運用報酬等の権利放棄

費用免除は契約で合意されているものではなく、今後継続する保証はない。2017年12月31日までの年度に關しては、以下の上限経費率が一部のクラスに対して適用された。

2017年12月31日に終了した年度において、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	0.05	0.05
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・バリュエーション・エクイティ・ファンド	J	0.03	0.03

\* 総経費率は、2017年12月31日に終了した年度に、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。2017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	2%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	8%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	15%
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	12%
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	18%

## 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。

2017年12月31日に終了した年度における金額は、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	31,583
USアグリゲート・ボンド・ファンド	米ドル	7,989
エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	米ドル	2,280,249
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	米ドル	94,997
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	米ドル	310,055
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	米ドル	212,339

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30年10月末現在)

## グローバル資産分散オープン

資産総額	8,465,808,671	円
負債総額	14,045,766	円
純資産総額( - )	8,451,762,905	円
発行済数量	9,690,427,710	口
1単位当り純資産額( / )	0.8722	円

## (参考)日本好配当株マザーファンド

資産総額	15,401,378,039	円
負債総額	196,328,418	円
純資産総額( - )	15,205,049,621	円
発行済数量	8,648,754,864	口
1単位当り純資産額( / )	1.7581	円

## (参考)世界REITマザーファンド

資産総額	1,269,223,701	円
負債総額	14	円
純資産総額( - )	1,269,223,687	円
発行済数量	1,128,588,588	口
1単位当り純資産額( / )	1.1246	円

## (参考)グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	56,773,374,969	円
負債総額	6,880,856	円
純資産総額( - )	56,766,494,113	円
発行済数量	29,427,710,498	口
1単位当り純資産額( / )	1.9290	円

## (参考)新興国債券マザーファンド

資産総額	10,399,309,029	円
負債総額	43,489,173	円
純資産総額( - )	10,355,819,856	円
発行済数量	4,534,577,089	口
1単位当り純資産額( / )	2.2837	円

## (参考)欧州債券マザーファンド

資産総額	849,684,376	円
負債総額	2,627,709	円
純資産総額( - )	847,056,667	円
発行済数量	634,896,392	口
1単位当り純資産額( / )	1.3342	円

## (参考)アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	834,962,256	円
負債総額	29	円
純資産総額( - )	834,962,227	円
発行済数量	615,338,516	口
1単位当り純資産額( / )	1.3569	円

## (参考)コモディティ・マザーファンド

資産総額	470,034,194	円
負債総額	64,546,800	円
純資産総額( - )	405,487,394	円
発行済数量	763,522,368	口
1単位当り純資産額( / )	0.5311	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（2018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。

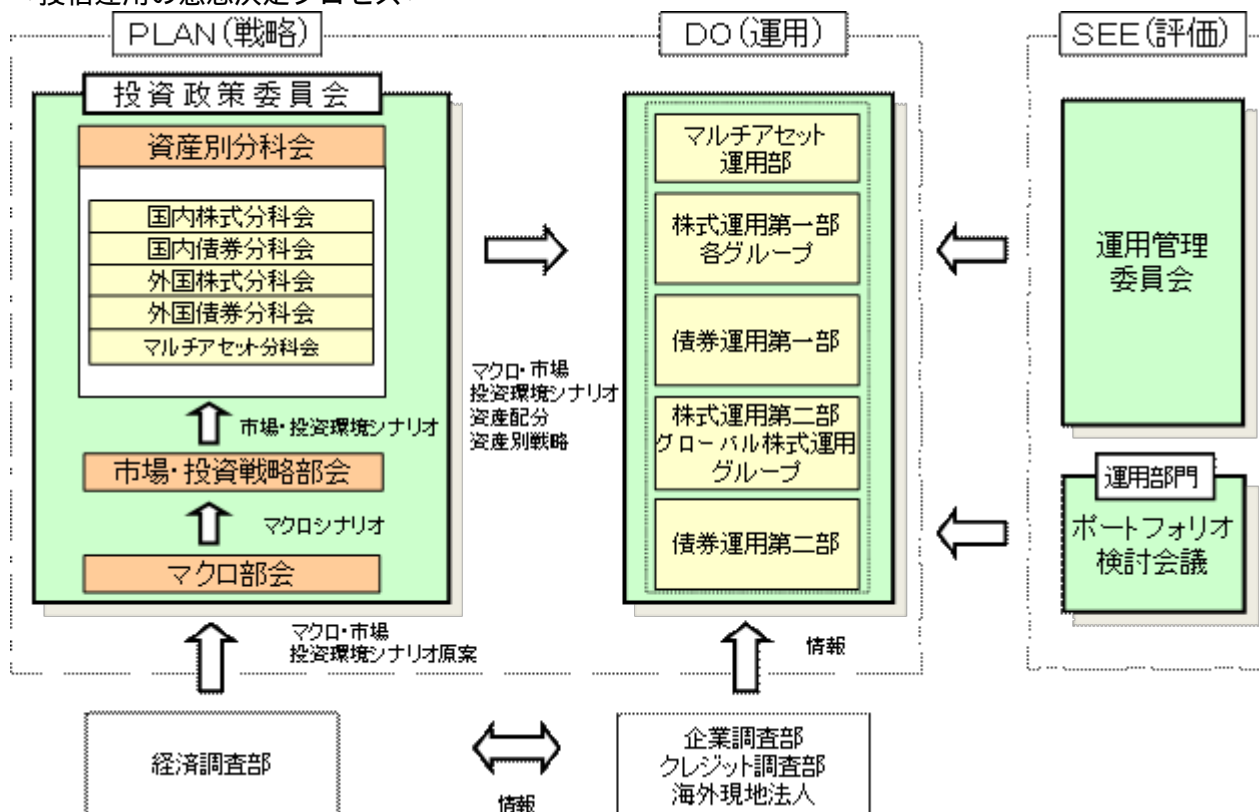
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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1999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。

2018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、398本であり、その純資産総額は、約3,335,621百万円です（なお、親投資信託121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	21	61,976百万円
追加型株式投資信託	301	3,010,146百万円
単位型公社債投資信託	76	263,498百万円
合計	398	3,335,621百万円

[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46期事業年度（平成29年4月1日から平成30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45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30年3月31日)
<b>資産の部</b>			
<b>流動資産</b>			
現金・預金		21,770,643	21,360,895
前払費用		206,930	204,460
未収入金		7,453	12,823
未収委託者報酬		3,291,565	3,363,312
未収運用受託報酬		912,489	1,198,432
未収収益		50,722	41,310
繰延税金資産		447,651	504,497
その他		428	7,553
流動資産計		26,687,885	26,693,285
<b>固定資産</b>			
<b>有形固定資産</b>			
建物	1	110,298	75,557
器具備品	1	66,464	122,169
土地		710	710
リース資産	1	10,562	7,275
有形固定資産計		188,035	205,712
<b>無形固定資産</b>			
ソフトウェア		96,732	73,887
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		109,439	86,593
<b>投資その他の資産</b>			
投資有価証券		6,783,747	10,257,600
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,546	1,170
長期差入保証金		511,637	534,699
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		523,217	536,754
その他		192	-
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		8,838,366	12,348,249
固定資産計		9,135,840	12,640,555

資産合計	35,823,726	39,333,840
------	------------	------------

(単位：千円)

	第45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,524	3,143
未払金	61,012	29,207
未払手数料	1,419,878	1,434,393
未払費用	1,150,008	1,287,722
未払法人税等	459,723	1,397,293
未払消費税等	26,700	135,042
賞与引当金	1,251,100	1,263,100
役員賞与引当金	82,900	85,600
その他	46,283	23,128
流動負債計	4,501,131	5,658,632
固定負債		
リース債務	7,841	4,698
退職給付引当金	1,482,500	1,540,203
役員退職慰労引当金	93,560	88,050
固定負債計	1,583,902	1,632,952
負債合計	6,085,034	7,291,585

(単位：千円)

	第45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30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	26,100,773	28,387,042
利益剰余金合計	27,544,504	29,830,773
株主資本合計	29,700,773	31,987,042
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	37,917	55,213
評価・換算差額等合計	37,917	55,213
純資産合計	29,738,691	32,042,255
負債純資産合計	35,823,726	39,333,840

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	4,371,647	5,111,757
委託者報酬	28,124,470	26,383,145
その他営業収益	64,558	82,997
営業収益計	32,560,677	31,577,899
営業費用		
支払手数料	13,056,474	11,900,832
広告宣伝費	169,346	93,131
公告費	2,915	-
調査費		
調査費	1,331,709	1,637,364
委託調査費	3,213,013	2,959,680
委託計算費	137,135	79,120
営業雑経費		
通信費	39,943	42,497
印刷費	501,370	517,371
協会費	24,788	24,374
諸会費	2,492	3,778
その他	109,609	122,930
営業費用計	18,588,799	17,381,079
一般管理費		
給料		
役員報酬	209,010	218,127

給料・手当	2,852,929	2,809,008
賞与	129,064	86,028
退職金	32,873	9,864
福利厚生費	639,080	647,269
交際費	22,638	29,121
旅費交通費	142,966	159,224
租税公課	174,826	199,255
不動産賃借料	620,232	622,807
退職給付費用	217,625	219,724
固定資産減価償却費	57,699	71,624
賞与引当金繰入額	1,251,100	1,263,100
役員退職慰労引当金繰入額	38,169	36,130
役員賞与引当金繰入額	80,300	85,500
諸経費	564,747	901,001
一般管理費計	7,033,264	7,357,787
営業利益	6,938,613	6,839,032
営業外収益		
受取配当金	4,517	23,350
受取利息	675	199
投資有価証券売却益	6,051	6,350
業務委託関連引当金戻入	4,000	-
為替差益	123	-
その他	5,690	2,831
営業外収益計	21,058	32,732
営業外費用		
投資有価証券売却損	21,990	5,000
為替差損	-	1,784
その他	113	0
営業外費用計	22,103	6,784
経常利益	6,937,568	6,864,980
税引前当期純利益	6,937,568	6,864,980
法人税、住民税及び事業税	1,881,549	2,242,775
法人税等調整額	225,697	78,014
法人税等合計	2,107,247	2,164,761
当期純利益	4,830,321	4,700,218

## (3) 株主資本等変動計算書

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

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	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	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

[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 border="0"> <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>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>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>				

（貸借対照表関係）



第45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30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 454,117千円	建物 465,964千円
器具備品 272,531千円	器具備品 266,621千円
リース資産 10,688千円	リース資産 8,719千円
2.保証債務	2.保証債務
被保証者 従業員	-
被保証債務の内容 住宅ローン	
金額 940千円	

## (株主資本等変動計算書関係)

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

第46期（自平成29年4月1日至平成30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29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29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30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23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等であり、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。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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（*）	891,704	891,704	-
負債計	2,311,583	2,311,583	-

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

第46期（平成30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	21,360,895	21,360,895	-
(2) 未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	-
(3) 未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	-
(4) 未収入金	12,823	12,823	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,206,465	10,206,465	-
資産計	36,141,929	36,141,929	-
(1) 未払手数料	1,434,393	1,434,393	-
(2) 未払費用（*）	959,074	959,074	-
負債計	2,393,468	2,393,468	-

（\*）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45期（平成29年3月31日）	第46期（平成30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	511,637	534,699

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 うち満期があるもの	-	2,222,381	467,133	-
合計	25,982,151	2,222,381	467,133	-

第46期（平成30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	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

（有価証券関係）

## 1. 子会社株式

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。

第46期（平成30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。

第46期（平成30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	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
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	7,683,969	7,850,063	166,093
小計	7,683,969	7,850,063	166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

(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

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30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	398,350	6,350	5,000

### （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45期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第46期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	1,546,322	1,482,500
退職給付費用	149,442	147,235
退職給付の支払額	213,264	105,520
その他	-	15,987
退職給付引当金の期末残高	1,482,500	1,540,203

(注) その他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

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

（単位：千円）

	第45期 （平成29年3月31日）	第46期 （平成30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	1,482,500	1,540,203
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,482,500	1,540,203
退職給付引当金	1,482,500	1,540,203
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,482,500	1,540,203

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第45期 149,442千円 第46期 147,235千円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第45期は68,183千円、第46期は72,489千円であります。

## (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45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30年3月31日)
(1) 流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	12,099	71,030
賞与引当金	386,089	386,761
社会保険料	29,075	30,549
未払事業所税	4,693	4,247
その他	21,191	11,908
繰延税金資産合計	453,148	504,497
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	447,651	504,497
(2) 固定資産		
繰延税金資産		
退職給付引当金	454,152	471,610
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	28,748	26,961
その他	57,051	62,550
繰延税金資産小計	618,499	639,668
評価性引当額	78,546	78,546
繰延税金資産合計	539,952	561,121
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	16,734	24,367
繰延税金負債合計	16,734	24,367
繰延税金資産の純額	523,217	536,754

## 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45期及び第46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。

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30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	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の90%を超えるため、地域ごとの

有形固定資産の記載を省略しております。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

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。

第46期（自平成29年4月1日 至平成30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	3,987,525	未払 手数料	573,578
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	1,969,101	未払 手数料	273,241

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45期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第46期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
1株当たり純資産額	7,724円34銭	8,322円66銭
1株当たり当期純利益金額	1,254円63銭	1,220円84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45期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第46期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
当期純利益(千円)	4,830,321	4,700,218
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,830,321	4,700,218
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）

当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付にて、当社及び三井住友アセットマネジメント株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社、及び住友生命保険相互会社が、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

[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。

大和住銀投信投資顧問株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年4月1日に三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友DSアセットマネジメント株式会社となる予定です。

- (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） 2018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（2018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) 投資顧問会社

名称	資本金の額	事業の内容
ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド (T. Rowe Price International Ltd)	2017年12月末現在 174百万米ドル <sup>(注)</sup> (約19,707百万円)	同社（所在地：英国ロンドン）は、米国ティー・ロウ・プライス・グループの運用会社です。同グループの代表的な会社であるティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクの親会社であるティー・ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S & P 500インデックスの採用銘柄です。ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドは、ティー・ロウ・プライス・グループの運用技術および調査能力を活用することができます。
シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシー (CBRE Clarion Securities LLC)	2017年12月末現在 32,060,827米ドル <sup>(注)</sup> (約3,631百万円)	シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシーは、世界的な不動産サービス会社である米国シービーアールイー・グループの上場不動産証券投資部門を担う運用会社です。同社は、シービーアールイー・グループの世界各国に展開したネットワークから不動産/マーケット情報・リサーチ情報を最大限活用することができます。 所在地：米国ペンシルバニア州ラドノー

(注)米ドルの円貨換算は、2018年10月末現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝113.26円）によります。

## (3) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2018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。

## 3 資本関係

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

受託会社の三井住友信託銀行株式会社は、ファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の2.08%の株式を保有しています。

## (2) 販売会社

株式会社三井住友銀行の親会社である株式会社三井住友フィナンシャルグループは、ファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の48.96%の株式を保有しています。

以上

## 独立監査人の監査報告書

平成30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 佐藤 栄裕 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30年6月5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29年4月1日から平成30年3月31日までの第46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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付にて、会社及び三井住友アセットマネジメント株式会社の主要株主が、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 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。