

【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 7月25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】	日本株 2 2 5 ・米ドルコース 日本株 2 2 5 ・ブラジルリアルコース 日本株 2 2 5 ・豪ドルコース 日本株 2 2 5 ・資源 3 通貨コース
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各々につき、1兆円を上限とします。
【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1月25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。なお、平成30年4月27日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。）の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正箇所および訂正事項】

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成29年11月末現在）

(以下略)

<訂正後>

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成30年5月末現在）

(以下略)

2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(2) 投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

(以下略)

投資信託証券の概要は、平成29年11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。

(以下略)

(3) 運用体制

(以下略)

* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成29年11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投資信託証券の概要

(以下略)

投資信託証券の概要は、平成30年5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。

(以下略)

(3) 運用体制

(以下略)

* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成30年5月末現在で約100名です。

(以下略)

[次へ](#)

3 投資リスク

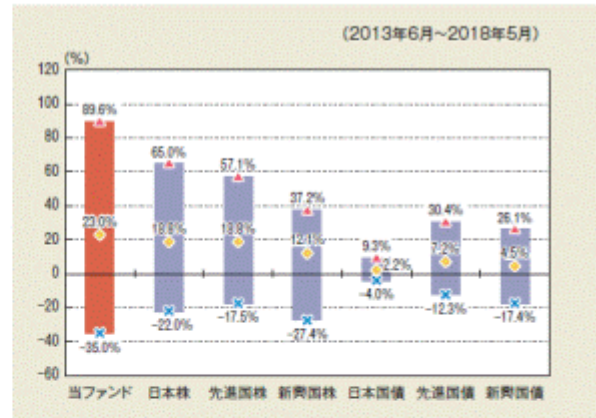
< 参考情報 >

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移 米ドルコース



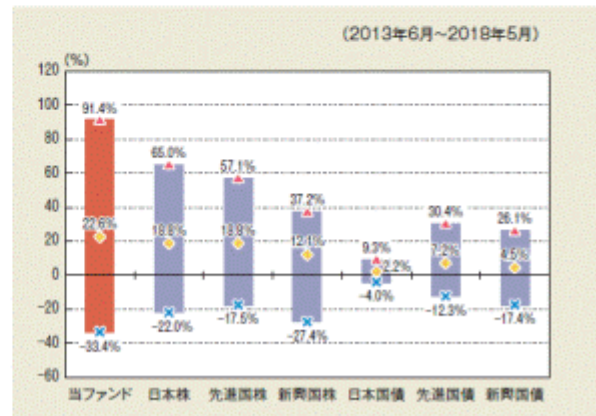
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 米ドルコース



ブラジルリアルコース



ブラジルリアルコース



■ 年間騰落率 (右目盛) — 分配金再投資基準価額 (左目盛)

◆ 平均値 ▲ 最大値 × 最小値

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

豪ドルコース



資源3通貨コース



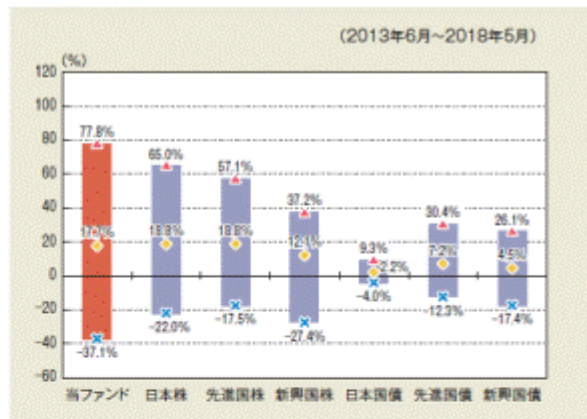
■ 年間騰落率 (右目盛) — 分配金再投資基準価額 (左目盛)

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

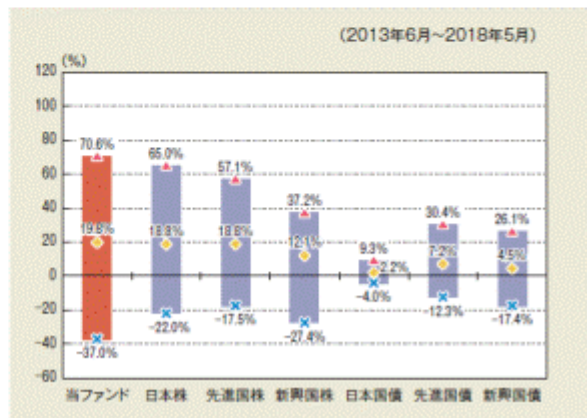
※年間騰落率および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

豪ドルコース



資源3通貨コース



◆ 平均値 ▲ 最大値 × 最小値

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

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

<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX (配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村證券株式会社
先進国債	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。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は平成29年11月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

< 訂正後 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は平成30年5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。

日本株 2 2 5 ・ミドルコース

(1) 投資状況

（平成30年5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 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	50,088	0.00%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	11,277,468,997	97.64%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		272,387,983	2.36%
純資産総額		11,549,907,068	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5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	Japan Stock 225 Fund USD Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	12,856,211,807	0.8944 11,499,635,231	0.8772 11,277,468,997	- -	97.64%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	49,237	1.0172 50,088	1.0173 50,088	- -	0.00%

（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
投資信託受益証券	97.64%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	97.64%

（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5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5月末現在）

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成23年10月31日）	93	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成24年4月25日）	21	-	1.0739	-
第2特定期間末 （平成24年10月25日）	32	-	0.9792	-
第3特定期間末 （平成25年4月25日）	95	-	1.7383	-
第4特定期間末 （平成25年10月25日）	907	-	1.7616	-
第5特定期間末 （平成26年4月25日）	3,527	-	1.8261	-
第6特定期間末 （平成26年10月27日）	5,308	5,529	1.9144	2.0344
第7特定期間末 （平成27年4月27日）	11,452	12,240	2.4953	2.6753
第8特定期間末 （平成27年10月26日）	19,796	20,998	2.1991	2.3791
第9特定期間末 （平成28年4月25日）	21,335	23,298	1.7209	1.9009

第10特定期間末 (平成28年10月25日)	16,732	18,929	1.3931	1.5731
第11特定期間末 (平成29年4月25日)	14,566	15,921	1.4754	1.6054
平成29年5月末日	14,693	-	1.5272	-
平成29年6月末日	14,629	-	1.5741	-
平成29年7月末日	13,554	-	1.5115	-
平成29年8月末日	12,929	-	1.4483	-
平成29年9月末日	13,420	-	1.5304	-
第12特定期間末 (平成29年10月25日)	13,334	14,410	1.6324	1.7524
平成29年10月末日	13,290	-	1.6376	-
平成29年11月末日	12,775	-	1.6401	-
平成29年12月末日	12,261	-	1.6508	-
平成30年1月末日	11,703	-	1.6070	-
平成30年2月末日	11,291	-	1.5083	-
平成30年3月末日	10,871	-	1.4024	-
第13特定期間末 (平成30年4月25日)	11,767	12,678	1.4898	1.6098
平成30年4月末日	11,850	-	1.4956	-
平成30年5月末日	11,549	-	1.4507	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(平成23年10月31日～平成24年4月25日)	0
第2特定期間(平成24年4月26日～平成24年10月25日)	0
第3特定期間(平成24年10月26日～平成25年4月25日)	0
第4特定期間(平成25年4月26日～平成25年10月25日)	0
第5特定期間(平成25年10月26日～平成26年4月25日)	0
第6特定期間(平成26年4月26日～平成26年10月27日)	0.1200
第7特定期間(平成26年10月28日～平成27年4月27日)	0.1800
第8特定期間(平成27年4月28日～平成27年10月26日)	0.1800
第9特定期間(平成27年10月27日～平成28年4月25日)	0.1800
第10特定期間(平成28年4月26日～平成28年10月25日)	0.1800
第11特定期間(平成28年10月26日～平成29年4月25日)	0.1300
第12特定期間(平成29年4月26日～平成29年10月25日)	0.1200
第13特定期間(平成29年10月26日～平成30年4月25日)	0.1200

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(平成23年10月31日～平成24年4月25日)	7.4%
第2特定期間(平成24年4月26日～平成24年10月25日)	8.8%
第3特定期間(平成24年10月26日～平成25年4月25日)	77.5%
第4特定期間(平成25年4月26日～平成25年10月25日)	1.3%
第5特定期間(平成25年10月26日～平成26年4月25日)	3.7%
第6特定期間(平成26年4月26日～平成26年10月27日)	11.4%
第7特定期間(平成26年10月28日～平成27年4月27日)	39.7%
第8特定期間(平成27年4月28日～平成27年10月26日)	4.7%
第9特定期間(平成27年10月27日～平成28年4月25日)	13.6%
第10特定期間(平成28年4月26日～平成28年10月25日)	8.6%
第11特定期間(平成28年10月26日～平成29年4月25日)	15.2%
第12特定期間(平成29年4月26日～平成29年10月25日)	18.8%
第13特定期間(平成29年10月26日～平成30年4月25日)	1.4%

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

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1特定期間(平成23年10月31日～平成24年4月25日)	121,995,218	102,183,305
第2特定期間(平成24年4月26日～平成24年10月25日)	26,775,144	13,287,610
第3特定期間(平成24年10月26日～平成25年4月25日)	64,582,148	42,832,670
第4特定期間(平成25年4月26日～平成25年10月25日)	637,230,534	176,898,490
第5特定期間(平成25年10月26日～平成26年4月25日)	2,060,935,164	644,547,178
第6特定期間(平成26年4月26日～平成26年10月27日)	2,686,490,609	1,845,062,348
第7特定期間(平成26年10月28日～平成27年4月27日)	6,128,278,438	4,311,844,295
第8特定期間(平成27年4月28日～平成27年10月26日)	6,074,706,201	1,662,098,398
第9特定期間(平成27年10月27日～平成28年4月25日)	5,923,094,919	2,528,066,846
第10特定期間(平成28年4月26日～平成28年10月25日)	2,709,531,261	3,095,829,001
第11特定期間(平成28年10月26日～平成29年4月25日)	1,581,952,610	3,719,805,175
第12特定期間(平成29年4月26日～平成29年10月25日)	698,091,883	2,402,282,121
第13特定期間(平成29年10月26日～平成30年4月25日)	1,084,953,069	1,355,083,646

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

日本株 2.2.5・ブラジルリアルコース

(1)投資状況

（平成30年5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 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	400,709	0.15%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	265,321,055	97.87%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,369,388	1.98%
純資産総額		271,091,152	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成30年5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	Japan Stock 225 Fund BRL Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	394,412,154	0.7035 277,496,045	0.6727 265,321,055	- -	97.87%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	393,895	1.0172 400,709	1.0173 400,709	- -	0.15%

（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
投資信託受益証券	97.87%
親投資信託受益証券	0.15%
合計	98.02%

（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5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5月末現在）

該当事項はありません。

(3)運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成23年10月31日）	1,846	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成24年4月25日）	238	255	0.9771	0.9971
第2特定期間末 （平成24年10月25日）	322	332	0.8194	0.8494
第3特定期間末 （平成25年4月25日）	398	407	1.5444	1.5744
第4特定期間末 （平成25年10月25日）	1,061	1,082	1.4505	1.4805
第5特定期間末 （平成26年4月25日）	1,070	1,092	1.5157	1.5457
第6特定期間末 （平成26年10月27日）	1,087	1,154	1.4726	1.6026
第7特定期間末 （平成27年4月27日）	1,267	1,398	1.6287	1.8087
第8特定期間末 （平成27年10月26日）	704	823	1.1062	1.2862
第9特定期間末 （平成28年4月25日）	756	863	0.9084	1.0584
第10特定期間末 （平成28年10月25日）	580	642	0.8894	0.9794

第11特定期間末 （平成29年4月25日）	462	496	1.0103	1.0753
平成29年5月末日	492	-	1.0120	-
平成29年6月末日	438	-	1.0412	-
平成29年7月末日	444	-	1.0598	-
平成29年8月末日	420	-	1.0192	-
平成29年9月末日	411	-	1.0793	-
第12特定期間末 （平成29年10月25日）	380	405	1.1317	1.1917
平成29年10月末日	380	-	1.1375	-
平成29年11月末日	376	-	1.1648	-
平成29年12月末日	375	-	1.1494	-
平成30年1月末日	381	-	1.1681	-
平成30年2月末日	340	-	1.0812	-
平成30年3月末日	303	-	0.9905	-
第13特定期間末 （平成30年4月25日）	302	321	1.0137	1.0737
平成30年4月末日	302	-	1.0118	-
平成30年5月末日	271	-	0.9236	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金（円）
第1特定期間（平成23年10月31日～平成24年4月25日）	0.0200
第2特定期間（平成24年4月26日～平成24年10月25日）	0.0300
第3特定期間（平成24年10月26日～平成25年4月25日）	0.0300
第4特定期間（平成25年4月26日～平成25年10月25日）	0.0300
第5特定期間（平成25年10月26日～平成26年4月25日）	0.0300
第6特定期間（平成26年4月26日～平成26年10月27日）	0.1300
第7特定期間（平成26年10月28日～平成27年4月27日）	0.1800
第8特定期間（平成27年4月28日～平成27年10月26日）	0.1800
第9特定期間（平成27年10月27日～平成28年4月25日）	0.1500
第10特定期間（平成28年4月26日～平成28年10月25日）	0.0900
第11特定期間（平成28年10月26日～平成29年4月25日）	0.0650
第12特定期間（平成29年4月26日～平成29年10月25日）	0.0600
第13特定期間（平成29年10月26日～平成30年4月25日）	0.0600

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間（平成23年10月31日～平成24年4月25日）	0.3%
第2特定期間（平成24年4月26日～平成24年10月25日）	13.1%
第3特定期間（平成24年10月26日～平成25年4月25日）	92.1%
第4特定期間（平成25年4月26日～平成25年10月25日）	4.1%
第5特定期間（平成25年10月26日～平成26年4月25日）	6.6%
第6特定期間（平成26年4月26日～平成26年10月27日）	5.7%
第7特定期間（平成26年10月28日～平成27年4月27日）	22.8%
第8特定期間（平成27年4月28日～平成27年10月26日）	21.0%
第9特定期間（平成27年10月27日～平成28年4月25日）	4.3%
第10特定期間（平成28年4月26日～平成28年10月25日）	7.8%
第11特定期間（平成28年10月26日～平成29年4月25日）	20.9%
第12特定期間（平成29年4月26日～平成29年10月25日）	18.0%
第13特定期間（平成29年10月26日～平成30年4月25日）	5.1%

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

（4）設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成23年10月31日～平成24年4月25日）	2,104,442,769	1,859,947,278
第2特定期間（平成24年4月26日～平成24年10月25日）	333,222,765	184,299,281
第3特定期間（平成24年10月26日～平成25年4月25日）	670,900,547	806,566,914
第4特定期間（平成25年4月26日～平成25年10月25日）	855,666,786	381,866,379
第5特定期間（平成25年10月26日～平成26年4月25日）	569,932,717	595,250,743
第6特定期間（平成26年4月26日～平成26年10月27日）	688,999,545	656,686,084
第7特定期間（平成26年10月28日～平成27年4月27日）	639,668,056	600,125,510
第8特定期間（平成27年4月28日～平成27年10月26日）	149,827,750	291,181,065
第9特定期間（平成27年10月27日～平成28年4月25日）	429,936,932	233,714,590
第10特定期間（平成28年4月26日～平成28年10月25日）	51,181,721	231,391,022
第11特定期間（平成28年10月26日～平成29年4月25日）	49,697,968	244,796,338
第12特定期間（平成29年4月26日～平成29年10月25日）	82,582,042	204,147,192
第13特定期間（平成29年10月26日～平成30年4月25日）	33,679,900	71,004,349

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

日本株 2.2.5・豪ドルコース

（1）投資状況

（平成30年5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 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	150,266	0.03%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	504,999,085	97.85%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,937,683	2.12%
純資産総額		516,087,034	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5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	Japan Stock 225 Fund AUD Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	594,956,510	0.8662 515,387,379	0.8488 504,999,085	- -	97.85%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	147,711	1.0172 150,266	1.0173 150,266	- -	0.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	97.85%
親投資信託受益証券	0.03%
合計	97.88%

（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5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5月末現在）

該当事項はありません。

（3）運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成23年10月31日）	653	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成24年4月25日）	77	80	1.0552	1.0652
第2特定期間末 （平成24年10月25日）	126	128	0.9687	0.9837
第3特定期間末 （平成25年4月25日）	125	126	1.7617	1.7767
第4特定期間末 （平成25年10月25日）	157	159	1.6662	1.6812
第5特定期間末 （平成26年4月25日）	319	322	1.6851	1.7001
第6特定期間末 （平成26年10月27日）	590	619	1.6768	1.8018
第7特定期間末 （平成27年4月27日）	647	701	1.9348	2.1148
第8特定期間末 （平成27年10月26日）	836	914	1.5463	1.7263
第9特定期間末 （平成28年4月25日）	835	925	1.2578	1.4178

第10特定期間末 （平成28年10月25日）	617	691	1.0056	1.1256
第11特定期間末 （平成29年4月25日）	571	623	1.0634	1.1584
平成29年5月末日	671	-	1.0846	-
平成29年6月末日	609	-	1.1497	-
平成29年7月末日	585	-	1.1516	-
平成29年8月末日	537	-	1.0904	-
平成29年9月末日	546	-	1.1451	-
第12特定期間末 （平成29年10月25日）	534	580	1.2129	1.3029
平成29年10月末日	542	-	1.2015	-
平成29年11月末日	524	-	1.1886	-
平成29年12月末日	517	-	1.2296	-
平成30年1月末日	532	-	1.2424	-
平成30年2月末日	488	-	1.1252	-
平成30年3月末日	469	-	1.0296	-
第13特定期間末 （平成30年4月25日）	531	571	1.0829	1.1729
平成30年4月末日	529	-	1.0819	-
平成30年5月末日	516	-	1.0503	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金（円）
第1特定期間（平成23年10月31日～平成24年4月25日）	0.0100
第2特定期間（平成24年4月26日～平成24年10月25日）	0.0150
第3特定期間（平成24年10月26日～平成25年4月25日）	0.0150
第4特定期間（平成25年4月26日～平成25年10月25日）	0.0150
第5特定期間（平成25年10月26日～平成26年4月25日）	0.0150
第6特定期間（平成26年4月26日～平成26年10月27日）	0.1250
第7特定期間（平成26年10月28日～平成27年4月27日）	0.1800
第8特定期間（平成27年4月28日～平成27年10月26日）	0.1800
第9特定期間（平成27年10月27日～平成28年4月25日）	0.1600
第10特定期間（平成28年4月26日～平成28年10月25日）	0.1200
第11特定期間（平成28年10月26日～平成29年4月25日）	0.0950
第12特定期間（平成29年4月26日～平成29年10月25日）	0.0900
第13特定期間（平成29年10月26日～平成30年4月25日）	0.0900

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間（平成23年10月31日～平成24年4月25日）	6.5%
第2特定期間（平成24年4月26日～平成24年10月25日）	6.8%
第3特定期間（平成24年10月26日～平成25年4月25日）	83.4%
第4特定期間（平成25年4月26日～平成25年10月25日）	4.6%
第5特定期間（平成25年10月26日～平成26年4月25日）	2.0%
第6特定期間（平成26年4月26日～平成26年10月27日）	6.9%
第7特定期間（平成26年10月28日～平成27年4月27日）	26.1%
第8特定期間（平成27年4月28日～平成27年10月26日）	10.8%
第9特定期間（平成27年10月27日～平成28年4月25日）	8.3%
第10特定期間（平成28年4月26日～平成28年10月25日）	10.5%
第11特定期間（平成28年10月26日～平成29年4月25日）	15.2%
第12特定期間（平成29年4月26日～平成29年10月25日）	22.5%
第13特定期間（平成29年10月26日～平成30年4月25日）	3.3%

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

（4）設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成23年10月31日～平成24年4月25日）	736,851,691	663,312,398
第2特定期間（平成24年4月26日～平成24年10月25日）	101,184,505	44,134,105
第3特定期間（平成24年10月26日～平成25年4月25日）	82,065,798	141,301,750
第4特定期間（平成25年4月26日～平成25年10月25日）	45,829,504	22,465,779
第5特定期間（平成25年10月26日～平成26年4月25日）	171,358,782	76,547,128
第6特定期間（平成26年4月26日～平成26年10月27日）	270,696,134	108,366,937
第7特定期間（平成26年10月28日～平成27年4月27日）	333,912,742	351,333,679
第8特定期間（平成27年4月28日～平成27年10月26日）	345,926,115	139,126,711
第9特定期間（平成27年10月27日～平成28年4月25日）	314,447,080	191,755,264
第10特定期間（平成28年4月26日～平成28年10月25日）	86,438,541	136,541,415

第11特定期間(平成28年10月26日～平成29年4月25日)	60,895,794	137,729,428
第12特定期間(平成29年4月26日～平成29年10月25日)	107,027,956	203,307,870
第13特定期間(平成29年10月26日～平成30年4月25日)	136,489,815	86,363,880

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

日本株225・資源3通貨コース

(1)投資状況

(平成30年5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 (キャッシュ・マネジメント・マザーファンド)	日本	50,088	0.01%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	338,798,016	97.19%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,755,847	2.80%
純資産総額		348,603,951	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5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	Japan Stock 225 Fund RCB Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	414,634,704	0.8428 349,478,294	0.8171 338,798,016	- -	97.19%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	49,237	1.0172 50,088	1.0173 50,088	- -	0.01%

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	97.19%
親投資信託受益証券	0.01%
合計	97.20%

(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5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5月末現在)

該当事項はありません。

(3)運用実績

純資産の推移

	純資産総額(百万円)		1口当りの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
設定時 (平成23年10月31日)	177	-	1.0000	-
第1特定期間末 (平成24年4月25日)	36	37	1.0450	1.0610
第2特定期間末 (平成24年10月25日)	37	38	0.8856	0.9096
第3特定期間末 (平成25年4月25日)	76	77	1.5373	1.5613
第4特定期間末 (平成25年10月25日)	124	126	1.4431	1.4671
第5特定期間末 (平成26年4月25日)	108	110	1.4520	1.4760
第6特定期間末 (平成26年10月27日)	1,694	1,773	1.4465	1.5745
第7特定期間末 (平成27年4月27日)	1,186	1,311	1.6659	1.8459
第8特定期間末 (平成27年10月26日)	811	925	1.2470	1.4270
第9特定期間末 (平成28年4月25日)	570	667	0.9702	1.1202

第10特定期末 (平成28年10月25日)	404	450	0.8628	0.9528
第11特定期末 (平成29年4月25日)	403	431	0.9832	1.0482
平成29年5月末日	401	-	1.0038	-
平成29年6月末日	408	-	1.0546	-
平成29年7月末日	407	-	1.0504	-
平成29年8月末日	385	-	1.0073	-
平成29年9月末日	396	-	1.0536	-
第12特定期末 (平成29年10月25日)	416	439	1.1115	1.1715
平成29年10月末日	414	-	1.1050	-
平成29年11月末日	418	-	1.1243	-
平成29年12月末日	423	-	1.1794	-
平成30年1月末日	412	-	1.1967	-
平成30年2月末日	384	-	1.1163	-
平成30年3月末日	354	-	1.0310	-
第13特定期末 (平成30年4月25日)	361	382	1.0679	1.1279
平成30年4月末日	365	-	1.0668	-
平成30年5月末日	348	-	1.0159	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(平成23年10月31日～平成24年4月25日)	0.0160
第2特定期間(平成24年4月26日～平成24年10月25日)	0.0240
第3特定期間(平成24年10月26日～平成25年4月25日)	0.0240
第4特定期間(平成25年4月26日～平成25年10月25日)	0.0240
第5特定期間(平成25年10月26日～平成26年4月25日)	0.0240
第6特定期間(平成26年4月26日～平成26年10月27日)	0.1280
第7特定期間(平成26年10月28日～平成27年4月27日)	0.1800
第8特定期間(平成27年4月28日～平成27年10月26日)	0.1800
第9特定期間(平成27年10月27日～平成28年4月25日)	0.1500
第10特定期間(平成28年4月26日～平成28年10月25日)	0.0900
第11特定期間(平成28年10月26日～平成29年4月25日)	0.0650
第12特定期間(平成29年4月26日～平成29年10月25日)	0.0600
第13特定期間(平成29年10月26日～平成30年4月25日)	0.0600

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(平成23年10月31日～平成24年4月25日)	6.1%
第2特定期間(平成24年4月26日～平成24年10月25日)	13.0%
第3特定期間(平成24年10月26日～平成25年4月25日)	76.3%
第4特定期間(平成25年4月26日～平成25年10月25日)	4.6%
第5特定期間(平成25年10月26日～平成26年4月25日)	2.3%
第6特定期間(平成26年4月26日～平成26年10月27日)	8.4%
第7特定期間(平成26年10月28日～平成27年4月27日)	27.6%
第8特定期間(平成27年4月28日～平成27年10月26日)	14.3%
第9特定期間(平成27年10月27日～平成28年4月25日)	10.2%
第10特定期間(平成28年4月26日～平成28年10月25日)	1.8%
第11特定期間(平成28年10月26日～平成29年4月25日)	21.5%
第12特定期間(平成29年4月26日～平成29年10月25日)	19.2%
第13特定期間(平成29年10月26日～平成30年4月25日)	1.5%

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

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1特定期間(平成23年10月31日～平成24年4月25日)	219,819,555	185,281,743
第2特定期間(平成24年4月26日～平成24年10月25日)	35,238,814	27,326,222
第3特定期間(平成24年10月26日～平成25年4月25日)	54,788,699	47,271,478
第4特定期間(平成25年4月26日～平成25年10月25日)	64,868,341	28,619,047
第5特定期間(平成25年10月26日～平成26年4月25日)	60,874,871	72,370,491
第6特定期間(平成26年4月26日～平成26年10月27日)	1,406,429,154	309,795,352
第7特定期間(平成26年10月28日～平成27年4月27日)	514,626,824	973,867,378
第8特定期間(平成27年4月28日～平成27年10月26日)	323,198,545	384,407,397
第9特定期間(平成27年10月27日～平成28年4月25日)	211,295,419	274,144,660
第10特定期間(平成28年4月26日～平成28年10月25日)	26,183,072	145,605,818
第11特定期間(平成28年10月26日～平成29年4月25日)	11,424,270	69,888,902

第12特定期間(平成29年4月26日～平成29年10月25日)	16,589,148	51,952,618
第13特定期間(平成29年10月26日～平成30年4月25日)	48,390,677	85,067,499

(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

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

(1)投資状況

(平成30年5月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
地方債証券	日本	302,625,400	6.97%
特殊債券	日本	1,814,445,634	41.82%
社債券	日本	702,794,600	16.20%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,518,925,500	35.01%
純資産総額		4,338,791,134	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5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	6政保地方公共6年 日本	特殊債券 -	650,000,000	100.09 650,624,000	100.04 650,261,300	0.2450 2018/07/30	14.99%
2	67 政保道路機構 日本	特殊債券 -	390,000,000	101.15 394,500,600	100.67 392,641,860	1.6000 2018/10/31	9.05%
3	64 政保道路機構 日本	特殊債券 -	319,000,000	101.59 324,078,480	100.40 320,297,054	1.6000 2018/08/29	7.38%
4	66 政保道路機構 日本	特殊債券 -	210,000,000	100.96 212,018,100	100.49 211,044,540	1.5000 2018/09/28	4.86%
5	304 北海道電力 日本	社債券 -	100,000,000	101.63 101,637,000	101.52 101,527,900	1.7030 2019/04/25	2.34%
6	71 共同発行地方 日本	地方債証券 -	100,000,000	101.34 101,348,000	101.10 101,109,500	1.5100 2019/02/25	2.33%
7	20-16 兵庫県公債 日本	地方債証券 -	100,000,000	101.13 101,134,000	101.02 101,028,700	1.6000 2019/01/23	2.33%
8	357 中国電力 日本	社債券 -	100,000,000	100.54 100,542,000	100.52 100,527,200	1.6580 2018/09/25	2.32%
9	467 関西電力 日本	社債券 -	100,000,000	100.74 100,743,000	100.50 100,507,100	1.6700 2018/09/20	2.32%
10	464 名古屋市債 日本	地方債証券 -	100,000,000	100.72 100,725,000	100.48 100,487,200	1.6100 2018/09/20	2.32%
11	18 政保政策投資C 日本	特殊債券 -	100,000,000	100.25 100,257,000	100.16 100,161,900	0.2400 2019/01/21	2.31%
12	3 セブンアンドアイ 日本	社債券 -	100,000,000	101.64 101,642,000	100.10 100,105,000	1.9400 2018/06/20	2.31%
13	41 鹿島建設 日本	社債券 -	100,000,000	100.16 100,167,000	100.09 100,098,500	0.7100 2018/07/19	2.31%
14	25 ホンダファイナンス 日本	社債券 -	100,000,000	100.46 100,469,000	100.02 100,028,800	0.5540 2018/06/20	2.31%
15	55 日本政策金融 日本	特殊債券 -	100,000,000	100.00 100,007,000	100.00 100,000,900	0.0010 2018/08/09	2.30%
16	48 野村ホールディング 日本	社債券 -	100,000,000	100.17 100,172,000	100.00 100,000,100	0.2450 2018/06/08	2.30%
17	886 政保公営企業 日本	特殊債券 -	40,000,000	101.51 40,606,400	100.09 40,038,080	1.8000 2018/06/19	0.92%

(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	41.82%
社債券	16.20%
地方債証券	6.97%
合計	64.99%

(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5月末現在）
該当事項はありません。

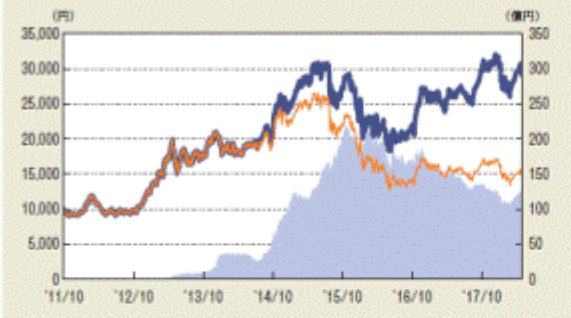
その他投資資産の主要なもの
（平成30年5月末現在）
該当事項はありません。

（参考情報）

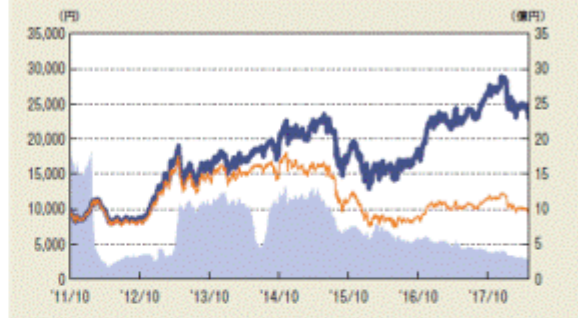
2018年5月31日現在

基準価額・純資産の推移（設定日～2018年5月31日）

米ドルコース



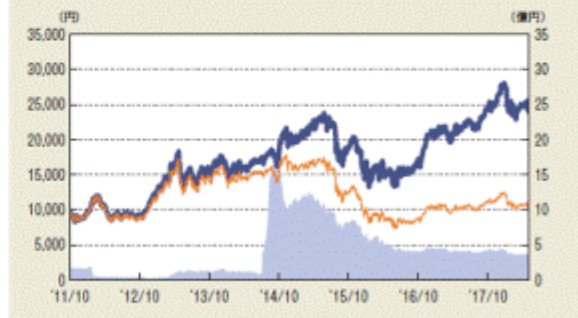
ブラジルリアルコース



豪ドルコース



資源3通貨コース



■ 純資産総額：右目盛
— 基準価額：左目盛
— 分配金再投資基準価額：左目盛

* 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

	米ドルコース	ブラジルリアルコース	豪ドルコース	資源3通貨コース
2018年 5月	200円	100円	150円	100円
2018年 4月	200円	100円	150円	100円
2018年 3月	200円	100円	150円	100円
2018年 2月	200円	100円	150円	100円
2018年 1月	200円	100円	150円	100円
直近1年間累計	2,400円	1,200円	1,800円	1,200円
設定来累計	12,300円	10,650円	11,250円	10,350円

* 分配金は1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

米ドルコース

投資銘柄	投資比率
Japan Stock 225 Fund USD Class	97.6%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.0%

ブラジルリアルコース

投資銘柄	投資比率
Japan Stock 225 Fund BRL Class	97.9%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.1%

豪ドルコース

投資銘柄	投資比率
Japan Stock 225 Fund AUD Class	97.9%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.0%

資源3通貨コース

投資銘柄	投資比率
Japan Stock 225 Fund RCB Class	97.2%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.0%

* 投資比率は全て純資産総額対比

■参考情報(上位10銘柄)

ジャパン・ストック225・ファンド

	投資銘柄	業種	投資比率
1	ファーストリテイリング	小売業	8.0%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.9%
3	ファナック	電気機器	3.9%
4	東京エレクトロン	電気機器	3.5%
5	KDDI	情報・通信業	3.0%
6	京セラ	電気機器	2.2%
7	テルモ	精密機器	2.1%
8	ダイキン工業	機械	2.1%
9	ユニーファミリーマートホールディングス	小売業	1.9%
10	信越化学工業	化学	1.8%

*投資比率はジャパン・ストック225・ファンドの保有現物株(ETFを含む)の時価総額対比

*業種は東証33業種分類

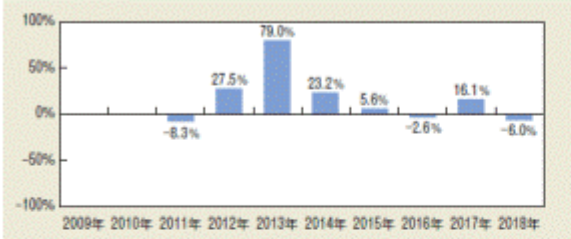
キャッシュ・マネジメント・マザー・ファンド

	投資銘柄	種別	投資比率
1	6政保地方公共6年	特殊債券	15.0%
2	67 政保道路機構	特殊債券	9.0%
3	64 政保道路機構	特殊債券	7.4%
4	66 政保道路機構	特殊債券	4.9%
5	304 北海道電力	社債券	2.3%
6	71 共同発行地方	地方債証券	2.3%
7	20-16 兵庫県公債	地方債証券	2.3%
8	357 中国電力	社債券	2.3%
9	467 関西電力	社債券	2.3%
10	464 名古屋市債	地方債証券	2.3%

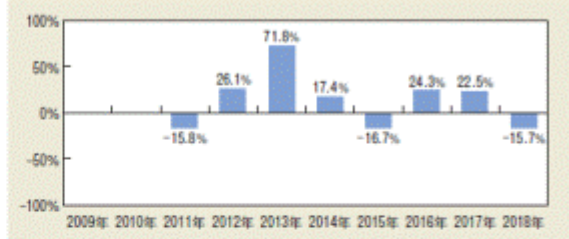
*投資比率はキャッシュ・マネジメント・マザー・ファンドの純資産総額対比

年間収益率の推移

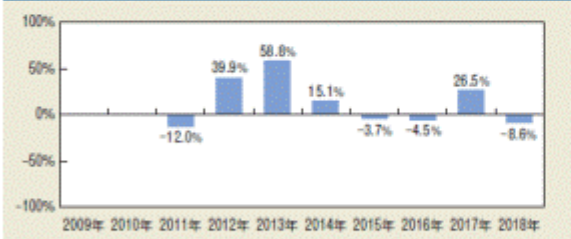
米ドルコース



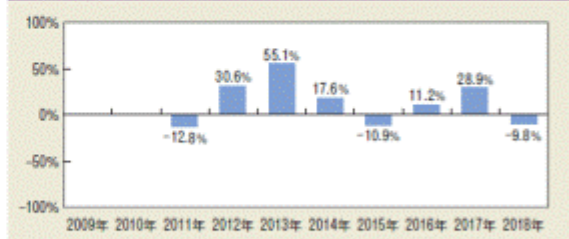
ブラジルリアルコース



豪ドルコース



資源3通貨コース



*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、2011年は当初設定日(2011年10月31日)から年末までの収益率、2018年は5月末までの収益率です。

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

*ファンドには、ベンチマークはありません。

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

[前へ](#)

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

- 1．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。
- 2．当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 3．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成29年10月26日から平成30年4月25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

日本株 2 2 5 ・米ドルコース

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成29年10月25日現在 金額（円）	当期 平成30年 4月25日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	50,087,275
コール・ローン	487,128,542	448,621,579
投資信託受益証券	13,088,387,989	11,462,216,729
親投資信託受益証券	50,103	50,088
未収入金	158,808,141	-
流動資産合計	13,734,374,775	11,960,975,671
資産合計	13,734,374,775	11,960,975,671
負債の部		
流動負債		
未払金	-	14,620,015
未払収益分配金	163,378,533	157,975,922
未払解約金	224,387,791	11,130,452
未払受託者報酬	297,578	247,805
未払委託者報酬	10,713,115	8,921,301
その他未払費用	617,564	564,472
流動負債合計	399,394,581	193,459,967
負債合計	399,394,581	193,459,967
純資産の部		
元本等		
元本	8,168,926,692	7,898,796,115
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,166,053,502	3,868,719,589
（分配準備積立金）	364,562,892	115,267,052
元本等合計	13,334,980,194	11,767,515,704
純資産合計	13,334,980,194	11,767,515,704
負債純資産合計	13,734,374,775	11,960,975,671

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成29年 4月26日 至 平成29年10月25日 金額（円）	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年 4月25日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	211,769,457	231,652,710
受取利息	1,801	1,225
有価証券売買等損益	2,375,372,984	237,856,995
営業収益合計	2,587,144,242	6,203,060

営業費用		
支払利息	132,970	114,105
受託者報酬	1,891,424	1,612,529
委託者報酬	68,093,157	58,052,321
その他費用	617,564	564,933
営業費用合計	70,735,115	60,343,888
営業利益又は営業損失()	2,516,409,127	66,546,948
経常利益又は経常損失()	2,516,409,127	66,546,948
当期純利益又は当期純損失()	2,516,409,127	66,546,948
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()	107,683,087	36,556,723
期首剰余金又は期首欠損金()	4,693,723,847	5,166,053,502
剰余金増加額又は欠損金減少額	358,698,588	536,829,425
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	358,698,588	536,829,425
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,219,789,988	819,820,535
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,219,789,988	819,820,535
分配金	1,075,304,985	911,239,132
期末剰余金又は期末欠損金()	5,166,053,502	3,868,719,589

[次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において、確定分配金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益 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	前期	当期
	平成29年10月25日現在	平成30年4月25日現在
1. 元本状況		
期首元本額	9,873,116,930円	8,168,926,692円
期中追加設定元本額	698,091,883円	1,084,953,069円
期中一部解約元本額	2,402,282,121円	1,355,083,646円
2. 受益権の総数	8,168,926,692口	7,898,796,115口

(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4月26日 至 平成29年10月25日	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日																																																																
<p>分配金の計算過程</p> <p>第65期計算期間末（平成29年5月25日）に、投資信託約款に基づき計算した15,629,730,469円（1万口当たり16,263.22円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い192,209,527円（1万口当たり200円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>35,361,361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>15,593,856,350円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>512,758円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>15,629,730,469円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(16,263.22円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>192,209,527円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(200円)</td> </tr> </table> <p>第66期計算期間末（平成29年6月26日）に、投資信託約款に基づき計算した14,970,872,845円（1万口当たり16,097.89円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い185,997,927円（1万口当たり200円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>32,218,464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>14,938,352,660円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>301,721円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>14,970,872,845円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(16,097.89円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>185,997,927円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(200円)</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	35,361,361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	15,593,856,350円	分配準備積立金	512,758円	分配可能額	15,629,730,469円	（1万口当たり分配可能額）	(16,263.22円)	収益分配金	192,209,527円	（1万口当たり収益分配金）	(200円)	配当等収益 （費用控除後）	32,218,464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	14,938,352,660円	分配準備積立金	301,721円	分配可能額	14,970,872,845円	（1万口当たり分配可能額）	(16,097.89円)	収益分配金	185,997,927円	（1万口当たり収益分配金）	(200円)	<p>分配金の計算過程</p> <p>第71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12,534,372,445円（1万口当たり16,013.23円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い156,550,201円（1万口当たり200円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>37,535,687円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後）</td> <td>108,663,096円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>12,043,534,723円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>344,638,939円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>12,534,372,445円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(16,013.23円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>156,550,201円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(200円)</td> </tr> </table> <p>第72期計算期間末（平成29年12月25日）に、投資信託約款に基づき計算した12,201,280,003円（1万口当たり16,312.72円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い149,592,194円（1万口当たり200円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>37,774,056円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後）</td> <td>335,793,871円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>11,510,987,904円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>316,724,172円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>12,201,280,003円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(16,312.72円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>149,592,194円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(200円)</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	37,535,687円	有価証券売買等損益 （費用控除後）	108,663,096円	収益調整金	12,043,534,723円	分配準備積立金	344,638,939円	分配可能額	12,534,372,445円	（1万口当たり分配可能額）	(16,013.23円)	収益分配金	156,550,201円	（1万口当たり収益分配金）	(200円)	配当等収益 （費用控除後）	37,774,056円	有価証券売買等損益 （費用控除後）	335,793,871円	収益調整金	11,510,987,904円	分配準備積立金	316,724,172円	分配可能額	12,201,280,003円	（1万口当たり分配可能額）	(16,312.72円)	収益分配金	149,592,194円	（1万口当たり収益分配金）	(200円)
配当等収益 （費用控除後）	35,361,361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	15,593,856,350円																																																																
分配準備積立金	512,758円																																																																
分配可能額	15,629,730,469円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(16,263.22円)																																																																
収益分配金	192,209,527円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(200円)																																																																
配当等収益 （費用控除後）	32,218,464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	14,938,352,660円																																																																
分配準備積立金	301,721円																																																																
分配可能額	14,970,872,845円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(16,097.89円)																																																																
収益分配金	185,997,927円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(200円)																																																																
配当等収益 （費用控除後）	37,535,687円																																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後）	108,663,096円																																																																
収益調整金	12,043,534,723円																																																																
分配準備積立金	344,638,939円																																																																
分配可能額	12,534,372,445円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(16,013.23円)																																																																
収益分配金	156,550,201円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(200円)																																																																
配当等収益 （費用控除後）	37,774,056円																																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後）	335,793,871円																																																																
収益調整金	11,510,987,904円																																																																
分配準備積立金	316,724,172円																																																																
分配可能額	12,201,280,003円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(16,312.72円)																																																																
収益分配金	149,592,194円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(200円)																																																																

第67期計算期間末（平成29年7月25日）に、投資信託約款に基づき計算した14,274,450,901円（1万口当たり15,921.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い179,307,643円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	21,362,923円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	14,252,227,937円
分配準備積立金	860,041円
分配可能額	14,274,450,901円
（1万口当たり分配可能額）	(15,921.74円)
収益分配金	179,307,643円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

第68期計算期間末（平成29年8月25日）に、投資信託約款に基づき計算した14,020,050,677円（1万口当たり15,744.89円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い178,090,172円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	20,603,436円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	13,998,754,897円
分配準備積立金	692,344円
分配可能額	14,020,050,677円
（1万口当たり分配可能額）	(15,744.89円)
収益分配金	178,090,172円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

第69期計算期間末（平成29年9月25日）に、投資信託約款に基づき計算した13,735,521,958円（1万口当たり15,580.12円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い176,321,183円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	31,047,632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	13,703,679,002円
分配準備積立金	795,324円
分配可能額	13,735,521,958円
（1万口当たり分配可能額）	(15,580.12円)
収益分配金	176,321,183円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

第70期計算期間末（平成29年10月25日）に、投資信託約款に基づき計算した13,091,783,118円（1万口当たり16,026.32円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い163,378,533円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	43,569,178円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	484,275,452円
収益調整金	12,563,841,693円
分配準備積立金	96,795円
分配可能額	13,091,783,118円
（1万口当たり分配可能額）	(16,026.32円)
収益分配金	163,378,533円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

第73期計算期間末（平成30年1月25日）に、投資信託約款に基づき計算した11,863,509,455円（1万口当たり16,267.49円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い145,855,447円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	34,112,708円
有価証券売買等損益 （費用控除後）	78,691,879円
収益調整金	11,226,509,060円
分配準備積立金	524,195,808円
分配可能額	11,863,509,455円
（1万口当たり分配可能額）	(16,267.49円)
収益分配金	145,855,447円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

第74期計算期間末（平成30年2月26日）に、投資信託約款に基づき計算した11,992,429,781円（1万口当たり16,104.55円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い148,932,189円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	27,417,045円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	11,479,251,442円
分配準備積立金	485,761,294円
分配可能額	11,992,429,781円
（1万口当たり分配可能額）	(16,104.55円)
収益分配金	148,932,189円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

第75期計算期間末（平成30年3月26日）に、投資信託約款に基づき計算した12,143,645,422円（1万口当たり15,943.53円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い152,333,179円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	29,620,735円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	11,753,185,307円
分配準備積立金	360,839,380円
分配可能額	12,143,645,422円
（1万口当たり分配可能額）	(15,943.53円)
収益分配金	152,333,179円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

第76期計算期間末（平成30年4月25日）に、投資信託約款に基づき計算した12,474,179,634円（1万口当たり15,792.51円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い157,975,922円（1万口当たり200円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	38,569,240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	12,200,936,660円
分配準備積立金	234,673,734円
分配可能額	12,474,179,634円
（1万口当たり分配可能額）	(15,792.51円)
収益分配金	157,975,922円
（1万口当たり収益分配金）	(200円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25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。なお、当ファンドは投資信託受益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、投資信託受益証券においては、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成30年4月25日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

前期（平成29年10月25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	5
投資信託受益証券	1,141,079,280
合計	1,141,079,285

当期（平成30年4月25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	5
投資信託受益証券	1,289,148,600
合計	1,289,148,595

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成29年10月25日現在）

該当事項はありません。

当期（平成30年4月25日現在）

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期（自平成29年10月26日 至平成30年4月25日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 平成29年10月25日現在	当期 平成30年4月25日現在
1口当たり純資産額 1.6324円 「1口 = 1円 (10,000口 = 16,324円)」	1口当たり純資産額 1.4898円 「1口 = 1円 (10,000口 = 14,898円)」

(4) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	Japan Stock 225 Fund USD Class	12,860,110,770	11,462,216,729	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	49,237	50,088	
合計		2銘柄	12,860,160,007	11,462,266,817	

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成29年10月25日現在 金額（円）	平成30年4月25日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	176,577,967
コール・ローン	778,865,044	1,581,573,089
地方債証券	-	201,904,600
特殊債券	1,890,414,455	1,816,087,869
社債券	803,009,400	501,207,200
未収利息	7,481,218	4,251,854
前払費用	1,589,544	1,453,310
流動資産合計	3,481,359,661	4,283,055,889
資産合計	3,481,359,661	4,283,055,889
負債の部		
流動負債		
未払解約金	78,883,047	6,539,868
その他未払費用	-	9,073
流動負債合計	78,883,047	6,548,941
負債合計	78,883,047	6,548,941
純資産の部		
元本等		
元本	3,343,686,417	4,203,753,327
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	58,790,197	72,753,621
元本等合計	3,402,476,614	4,276,506,948
純資産合計	3,402,476,614	4,276,506,948
負債純資産合計	3,481,359,661	4,283,055,889

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>地方債証券、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、原則として日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、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. 収益及び費用の計上基準	<p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年10月25日現在	平成30年4月25日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	3,687,263,347円	3,343,686,417円
期中追加設定元本額	3,367,738,057円	2,801,322,623円
期中一部解約元本額	3,711,314,987円	1,941,255,713円
元本の内訳		
S M B C ファンドラップ・G-REIT	-	1,033,607円
S M B C ファンドラップ・ヘッジファンド	204,542,257円	245,980,878円
S M B C ファンドラップ・欧州株	66,595,120円	77,197,357円
S M B C ファンドラップ・新興国株	48,552,582円	37,467,236円
S M B C ファンドラップ・コモディティ	18,039,923円	22,637,654円
S M B C ファンドラップ・米国債	80,111,508円	102,972,809円
S M B C ファンドラップ・欧州債	67,808,911円	76,301,845円
S M B C ファンドラップ・新興国債	35,230,015円	45,999,186円
S M B C ファンドラップ・日本グロース株	112,963,378円	134,507,674円
S M B C ファンドラップ・日本中小型株	26,900,521円	31,044,218円
S M B C ファンドラップ・日本債	719,928,148円	907,000,383円
D C 日本国債プラス	-	847,004,751円
エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）	100,813,175円	83,884,741円
エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）	342,736,059円	292,948,224円
エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）	12,912,198円	13,396,323円
エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）	351,160,651円	453,144,113円
エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）	15,548,223円	12,295,266円
エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）	217,554,110円	229,971,874円
エマージング・ボンド・ファンド（マネー・プールファンド）	348,112,896円	252,731,405円
大和住銀 中国株式ファンド（マネー・ポートフォリオ）	156,694,516円	114,047,606円
エマージング好配当株オープン マネー・ポートフォリオ	3,004,544円	3,246,036円
エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）	1,853,800円	2,109,457円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（円コース）	1,585,981円	1,310,927円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（中国・インド・インドネシア通貨コース）	1,561,360円	1,259,347円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（BRICs通貨コース）	2,312,230円	1,442,524円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（世界6地域通貨コース）	9,541,235円	6,792,105円
米国短期社債戦略ファンド2015-12（為替ヘッジあり）	245,556円	245,556円
米国短期社債戦略ファンド2015-12（為替ヘッジなし）	245,556円	245,556円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（マネー・プールファンド）	38,104,068円	38,102,988円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・アジア3通貨コース	28,082,896円	27,182,095円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・円コース	2,309,863円	2,030,738円
アジア・ハイ・インカム・ファンド（マネー・プールファンド）	984,149円	1,019,842円
日本株厳選ファンド・円コース	270,889円	270,889円
日本株厳選ファンド・ブラジルリアルコース	18,658,181円	18,658,181円
日本株厳選ファンド・豪ドルコース	679,887円	679,887円
日本株厳選ファンド・アジア3通貨コース	9,783円	9,783円
株式&通貨 資源ダブルフォーカス（毎月分配型）	9,512,243円	9,512,243円
日本株225・米ドルコース	49,237円	49,237円

日本株 2 2 5 ・ ブラジルリアルコース	393,895円	393,895円
日本株 2 2 5 ・ 豪ドルコース	147,711円	147,711円
日本株 2 2 5 ・ 資源 3 通貨コース	49,237円	49,237円
グローバル C B オープン ・ 高金利通貨コース	598,533円	598,533円
グローバル C B オープン ・ 円コース	827,757円	827,757円
グローバル C B オープン（マネープールファンド）	11,840,342円	8,751,671円
オーストラリア高配当株プレミアム（毎月分配型）	1,057,457円	1,057,457円
スマート・ストラテジー・ファンド（毎月決算型）	12,541,581円	12,541,581円
スマート・ストラテジー・ファンド（年 2 回決算型）	4,566,053円	4,566,053円
ボンド・アンド・カレンシー トータルリターン・ファンド（毎月決算型）	14,309円	14,309円
ボンド・アンド・カレンシー トータルリターン・ファンド（年 2 回決算型）	12,837円	12,837円
カナダ高配当株ツイン（毎月分配型）	66,417,109円	66,417,109円
日本株厳選ファンド・米ドルコース	196,696円	196,696円
日本株厳選ファンド・メキシコペソコース	196,696円	196,696円
日本株厳選ファンド・トルコリラコース	196,696円	196,696円
エマージング・ボンド・ファンド・カナダドルコース（毎月分配型）	383,039円	444,703円
エマージング・ボンド・ファンド・メキシコペソコース（毎月分配型）	5,805,613円	5,076,128円
カナダ高配当株ファンド	984円	984円
短期米ドル社債オープン＜為替ヘッジなし＞（毎月分配型）	98,290円	98,290円
短期米ドル社債ファンド2015-06（為替ヘッジあり）	98,242円	98,242円
短期米ドル社債ファンド2015-06（為替ヘッジなし）	98,242円	98,242円
短期米ドル社債オープン＜為替ヘッジあり＞（毎月分配型）	98,242円	98,242円
米国短期社債戦略ファンド2015-10（為替ヘッジあり）	149,304円	149,304円
米国短期社債戦略ファンド2015-10（為替ヘッジなし）	215,194円	215,194円
米国短期社債戦略ファンド2017-03（為替ヘッジあり）	1,751,754円	1,751,754円
世界リアルアセット・バランス（毎月決算型）	1,451,601円	1,451,601円
世界リアルアセット・バランス（資産成長型）	2,567,864円	2,567,864円
大和住銀マルチ・ストラテジー・ファンド（ヘッジ付）（適格機関投資家限定）	186,695,490円	-
合計	3,343,686,417円	4,203,753,327円
2. 受益権の総数	3,343,686,417口	4,203,753,327口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年10月26日 至 平成30年 4月25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 4月25日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成29年10月25日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
特殊債券	6,854,730
社債券	1,838,200
合計	8,692,930

「計算期間」とは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年7月26日から平成29年10月25日まで）を指しております。

(平成30年4月25日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
地方債証券	168,400
特殊債券	6,003,711
社債券	1,985,800
合計	8,157,911

「計算期間」とは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年7月26日から平成30年4月25日まで）を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成29年10月25日現在)

該当事項はありません。

(平成30年4月25日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成29年10月26日 至 平成30年4月25日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年10月25日現在	平成30年4月25日現在
1口当たり純資産額 1.0176円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,176円)」	1口当たり純資産額 1.0173円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,173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
円	地方債証券	71 共同発行地方	100,000,000	101,258,800	
	地方債証券	464 名古屋市債	100,000,000	100,645,800	
	特殊債券	18 政保政策投資C	100,000,000	100,189,500	
	特殊債券	64 政保道路機構	319,000,000	320,802,669	
	特殊債券	66 政保道路機構	210,000,000	211,356,180	
	特殊債券	67 政保道路機構	390,000,000	393,257,280	
	特殊債券	886 政保公営企業	40,000,000	40,106,040	
	特殊債券	6政保地方公共6年	650,000,000	650,386,100	
	特殊債券	55 日本政策金融	100,000,000	99,990,100	
	社債券	41 鹿島建設	100,000,000	100,158,300	
	社債券	3 セブンアンドアイ	100,000,000	100,294,800	
	社債券	25 ホンダファイナンス	100,000,000	100,068,800	
	社債券	48 野村ホールディング	100,000,000	100,009,800	
	社債券	467 関西電力	100,000,000	100,675,500	
合計		14銘柄	2,509,000,000	2,519,199,669	

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「Japan Stock 225 Fund USD Class」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

この投資信託は、2017年3月31日に計算期間が終了し、米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は作成され、現地において独立監査人による財務書類の監査を受けております。

以下の「貸借対照表」、「損益計算書」、「純資産変動計算書」及び「有価証券明細表」等は、「Japan Stock 225 Fund」の2017年3月31日現在の財務諸表の原文を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

貸借対照表

2017年3月31日現在

(単位：円)

資産の部

有価証券（公正価値）（取得原価 14,543,206,423円）	15,856,883,390
外国為替予約取引に係る評価益	4,543
未収入金：	
受益証券発行	310,787
配当金	97,284,334
未収変動証拠金	467,452,276
その他資産	915,524
資産 合計	16,422,850,854

負債の部

外国為替予約取引に係る評価損	222,317,612
カストディアン宛未払金	255,393
未払金：	
買戻金	8,929,736
専門家報酬	8,467,392
投資顧問料	5,605,268
カストディーフィー	1,874,049
管理会社報酬	879,673
名義書換代理人報酬	454,557
為替管理報酬	299,258
負債 合計	249,082,938

純資産

16,173,767,916

Class A - AUD Class	576,941,279
Class B - BRL Class	500,052,507
Class C - USD Class	14,688,488,379
Class E - RCB Class	408,285,751
	16,173,767,916

発行済み受益証券

Class A - AUD Class	751,907,209
Class B - BRL Class	688,749,571
Class C - USD Class	18,713,485,147
Class E - RCB Class	539,797,546

受益証券一口あたりの純資産

Class A - AUD Class	0.7673
Class B - BRL Class	0.7260
Class C - USD Class	0.7849
Class E - RCB Class	0.7564

損益計算書（2017年3月31日に終了した年度）**（単位：円）****収益**

受取配当金（源泉税 42,279,966円控除後）	233,788,694
収益 合計	233,788,694

費用

投資顧問料	24,530,391
カストディーフィー	14,785,545
専門家報酬	6,350,385
管理会社報酬	5,495,543
名義書換代理人報酬	3,327,288
為替管理報酬	1,831,328
受託会社報酬	1,089,825
ファンド登録費用	452,650
その他費用*	9,236,297
費用 合計	67,099,252

純利益

166,689,442

実現及び未実現（損）益:**実現（損）益:**

有価証券	253,090,908
先物取引	478,286,033
外国為替取引及び外国為替予約取引	198,364,431
実現益 合計	929,741,372

未実現（損）益の変動:

有価証券	1,530,896,407
先物取引	(129,434,000)

外国為替取引及び外国為替予約取引

(140,664,629)

未実現益の変動 合計

1,260,797,778

実現及び未実現益 合計

2,190,539,150

運用による純資産の増加額

2,357,228,592

*日本円に係るマイナス金利を含む。

純資産変動計算書（2017年3月31日に終了した年度）**（単位：円）****運用による純資産の増（減）額**

純利益

166,689,442

実現益

929,741,372

未実現益の正味変動額

1,260,797,778

運用による純資産の増加額

2,357,228,592

受益者への分配金

(744,666,978)

ファンドの受益証券の取引による純資産の減少額

(7,956,402,135)

純資産の減少額

(6,343,840,521)

純資産

期首

22,517,608,437

期末

16,173,767,916

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表（2017年3月31日現在）

株数	銘柄名	公正価値
	普通株式 (92.2%)	(単位：円)
	日本 (92.2%)	
	ADVERTISING (1.1%)	
30,000	Dentsu, Inc.	181,200,000
	AEROSPACE/DEFENSE (0.1%)	
30,000	IHI Corp.	10,530,000
30,000	Kawasaki Heavy Industries, Ltd.	10,140,000
		20,670,000
	AGRICULTURE (0.7%)	
30,000	Japan Tobacco, Inc.	108,540,000
	AIRLINES (0.1%)	
30,000	ANA Holdings, Inc.	10,194,000
	AUTO MANUFACTURERS (4.6%)	
30,000	Fuji Heavy Industries, Ltd.	122,490,000
30,000	Hino Motors, Ltd.	40,410,000
60,000	Honda Motor Co., Ltd.	201,060,000
15,000	Isuzu Motors, Ltd.	22,087,500
6,000	Mazda Motor Corp.	9,618,000
30,000	Nissan Motor Co., Ltd.	32,205,000
30,000	Suzuki Motor Corp.	138,660,000
30,000	Toyota Motor Corp.	181,260,000
		747,790,500
	AUTO PARTS & EQUIPMENT (3.1%)	
30,000	Bridgestone Corp.	135,090,000
30,000	Denso Corp.	146,910,000
30,000	JTEKT Corp.	51,870,000
30,000	NGK Insulators, Ltd.	75,600,000

30,000	Sumitomo Electric Industries, Ltd.	55,380,000
15,000	Yokohama Rubber Co., Ltd.	32,685,000
		<hr/> 497,535,000 <hr/>
	BANKS (0.9%)	
30,000	Aozora Bank, Ltd.	12,300,000
30,000	Chiba Bank, Ltd.	21,450,000
30,000	Concordia Financial Group, Ltd.	15,462,000
30,000	Fukuoka Financial Group, Inc.	14,460,000
30,000	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	20,991,000
30,000	Mizuho Financial Group, Inc.	6,120,000
3,000	Resona Holdings, Inc.	1,793,700
30,000	Shinsei Bank, Ltd.	6,150,000
30,000	Shizuoka Bank, Ltd.	27,180,000
3,000	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	12,135,000
3,000	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	11,580,000
		<hr/> 149,621,700 <hr/>
	BEVERAGES (1.5%)	
30,000	Asahi Group Holdings, Ltd.	126,240,000
30,000	Kirin Holdings Co., Ltd.	63,015,000
6,000	Sapporo Holdings, Ltd.	18,060,000
30,000	Takara Holdings, Inc.	36,030,000
		<hr/> 243,345,000 <hr/>
	BUILDING MATERIALS (2.8%)	
30,000	Asahi Glass Co., Ltd.	27,060,000
30,000	Daikin Industries, Ltd.	335,550,000
3,000	Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	2,427,000
30,000	Sumitomo Osaka Cement Co., Ltd.	13,890,000
30,000	Taiheiyō Cement Corp.	11,160,000
15,000	Toto, Ltd.	63,075,000
		<hr/> 453,162,000 <hr/>
	CHEMICALS (5.9%)	
30,000	Asahi Kasei Corp.	32,400,000
30,000	Denka Co., Ltd.	17,340,000
30,000	Kuraray Co., Ltd.	50,640,000
15,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	12,921,000
30,000	Mitsui Chemicals, Inc.	16,500,000
30,000	Nippon Kayaku Co., Ltd.	45,300,000

30,000	Nissan Chemical Industries, Ltd.	97,200,000
30,000	Nitto Denko Corp.	258,060,000
30,000	Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	289,320,000

株数	銘柄名	公正価値
普通株式 (92.2%) (続き)		(単位：円)
日本 (92.2%) (続き)		
CHEMICALS (5.9%) (続き)		
3,000	Showa Denko KK	5,955,000
30,000	Sumitomo Chemical Co., Ltd.	18,660,000
6,000	Teijin, Ltd.	12,594,000
30,000	Tokai Carbon Co., Ltd.	14,550,000
30,000	Tokuyama Corp.	16,140,000
30,000	Toray Industries, Inc.	29,610,000
30,000	Tosoh Corp.	29,340,000
30,000	Ube Industries, Ltd.	7,530,000
		<hr/>
		954,060,000
COMMERCIAL SERVICES (1.9%)		
30,000	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	36,000,000
30,000	Secom Co., Ltd.	239,070,000
30,000	Toppan Printing Co., Ltd.	34,050,000
		<hr/>
		309,120,000
COMPUTERS (2.4%)		
30,000	Fujitsu, Ltd.	20,427,000
30,000	NTT Data Corp.	158,400,000
30,000	TDK Corp.	211,500,000
		<hr/>
		390,327,000
COSMETICS/PERSONAL CARE (1.7%)		
30,000	Kao Corp.	183,120,000
30,000	Shiseido Co., Ltd.	87,900,000
		<hr/>
		271,020,000
DISTRIBUTION/WHOLESALE (2.1%)		

30,000	ITOCHU Corp.	47,400,000
30,000	Marubeni Corp.	20,565,000
30,000	Mitsubishi Corp.	72,165,000
30,000	Mitsui & Co., Ltd.	48,375,000
3,000	Sojitz Corp.	837,000
30,000	Sumitomo Corp.	44,925,000
30,000	Toyota Tsusho Corp.	101,100,000
		<hr/>
		335,367,000
		<hr/>
	DIVERSIFIED FINANCIAL SERVICES (0.8%)	
30,000	Credit Saison Co., Ltd.	59,580,000
30,000	Daiwa Securities Group, Inc.	20,337,000
30,000	Matsui Securities Co., Ltd.	26,130,000
30,000	Nomura Holdings, Inc.	20,757,000
		<hr/>
		126,804,000
		<hr/>
	ELECTRIC (0.1%)	
3,000	Chubu Electric Power Co., Inc.	4,473,000
3,000	Kansai Electric Power Co., Inc.	4,101,000
3,000	Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc.	1,308,000
		<hr/>
		9,882,000
		<hr/>
	ELECTRICAL COMPONENTS & EQUIPMENT (0.6%)	
30,000	Casio Computer Co., Ltd.	46,470,000
30,000	Fujikura, Ltd.	24,030,000
3,000	Furukawa Electric Co., Ltd.	12,000,000
30,000	GS Yuasa Corp.	15,570,000
		<hr/>
		98,070,000
		<hr/>
	ELECTRONICS (4.7%)	
30,000	Alps Electric Co., Ltd.	94,650,000
60,000	Kyocera Corp.	372,120,000
30,000	MINEBEA MITSUMI, Inc.	44,550,000
30,000	NEC Corp.	8,040,000
45,000	Nippon Electric Glass Co., Ltd.	30,285,000
6,000	SCREEN Holdings Co., Ltd.	49,140,000
30,000	Taiyo Yuden Co., Ltd.	42,180,000
30,000	Yaskawa Electric Corp.	67,020,000
30,000	Yokogawa Electric Corp.	52,560,000
		<hr/>
		760,545,000
		<hr/>

ENGINEERING & CONSTRUCTION (1.5%)

30,000	Chiyoda Corp.	21,540,000
30,000	COMSYS Holdings Corp.	59,670,000
30,000	JGC Corp.	58,050,000
30,000	Kajima Corp.	21,780,000

株数

銘柄名

公正価値

普通株式 (92.2%) (続き)

(単位：円)

日本 (92.2%) (続き)

ENGINEERING & CONSTRUCTION (1.5%) (続き)

30,000	Obayashi Corp.	31,230,000
30,000	Shimizu Corp.	29,940,000
30,000	Taisei Corp.	24,330,000
		<u>246,540,000</u>

ENTERTAINMENT (0.0%)

3,000	Toho Co., Ltd.	<u>8,853,000</u>
-------	----------------	------------------

ENVIRONMENTAL CONTROL (0.0%)

6,000	Hitachi Zosen Corp.	<u>3,804,000</u>
-------	---------------------	------------------

FOOD (3.5%)

30,000	Ajinomoto Co., Inc.	65,895,000
30,000	Kikkoman Corp.	99,750,000
3,000	Maruha Nichiro Corp.	10,110,000
6,000	Meiji Holdings Co., Ltd.	55,620,000
30,000	NH Foods, Ltd.	89,670,000
15,000	Nichirei Corp.	41,310,000
30,000	Nippon Suisan Kaisha, Ltd.	16,650,000
30,000	Nisshin Seifun Group, Inc.	49,830,000
30,000	Seven & I Holdings Co., Ltd.	<u>130,860,000</u>
		<u>559,695,000</u>

FOREST PRODUCTS & PAPER (0.3%)

30,000	Hokuetsu Kishu Paper Co., Ltd.	23,280,000
3,000	Nippon Paper Industries Co., Ltd.	6,006,000
30,000	Oji Holdings Corp.	15,630,000
		<hr/>
		44,916,000
	GAS (0.2%)	
30,000	Osaka Gas Co., Ltd.	12,690,000
30,000	Tokyo Gas Co., Ltd.	15,198,000
		<hr/>
		27,888,000
	HAND/MACHINE TOOLS (0.2%)	
30,000	Fuji Electric Co., Ltd.	19,830,000
30,000	Meidensha Corp.	11,850,000
		<hr/>
		31,680,000
	HEALTHCARE-PRODUCTS (2.2%)	
30,000	Olympus Corp.	128,400,000
60,000	Terumo Corp.	231,900,000
		<hr/>
		360,300,000
	HOME BUILDERS (1.0%)	
30,000	Daiwa House Industry Co., Ltd.	95,880,000
6,000	Haseko Corp.	7,224,000
30,000	Sekisui House, Ltd.	54,930,000
		<hr/>
		158,034,000
	HOME FURNISHINGS (1.0%)	
30,000	Panasonic Corp.	37,740,000
30,000	Pioneer Corp.	6,630,000
30,000	Sony Corp.	112,980,000
		<hr/>
		157,350,000
	INSURANCE (1.0%)	
3,000	Dai-ichi Life Holdings, Inc.	5,989,500
9,000	MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	31,860,000
7,500	Sompo Holdings, Inc.	30,592,500
6,000	Sony Financial Holdings, Inc.	10,734,000
6,000	T&D Holdings, Inc.	9,696,000
15,000	Tokio Marine Holdings, Inc.	70,440,000
		<hr/>
		159,312,000

INTERNET (1.2%)

30,000	Rakuten, Inc.	33,450,000
30,000	Trend Micro, Inc.	148,500,000
12,000	Yahoo Japan Corp.	6,168,000
		<hr/>
		188,118,000

IRON/STEEL (0.2%)

6,000	Japan Steel Works, Ltd.	10,764,000
3,000	JFE Holdings, Inc.	5,725,500
3,000	Kobe Steel, Ltd.	3,048,000

株数**銘柄名****公正価値****普通株式 (92.2%) (続き)**

(単位: 円)

日本 (92.2%) (続き)**IRON/STEEL (0.2%) (続き)**

3,000	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp.	7,695,000
3,000	Nisshin Steel Co., Ltd.	4,392,000
		<hr/>
		31,624,500

LEISURE TIME (1.2%)

15,000	Tokyo Dome Corp.	15,510,000
30,000	Yamaha Corp.	91,950,000
30,000	Yamaha Motor Co., Ltd.	80,430,000
		<hr/>
		187,890,000

MACHINERY-CONSTRUCTION & MINING (1.5%)

30,000	Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	83,250,000
30,000	Hitachi, Ltd.	18,075,000
30,000	Komatsu, Ltd.	87,045,000
30,000	Mitsubishi Electric Corp.	47,910,000
		<hr/>
		236,280,000

MACHINERY-DIVERSIFIED (5.3%)

30,000	Amada Holdings Co., Ltd.	38,130,000
6,000	Ebara Corp.	21,810,000

30,000	FANUC Corp.	684,600,000
30,000	Kubota Corp.	50,130,000
30,000	Mitsubishi Heavy Industries, Ltd.	13,398,000
30,000	OKUMA Corp.	34,980,000
30,000	Sumitomo Heavy Industries, Ltd.	23,280,000
		866,328,000
	MEDIA (0.0%)	
3,000	SKY Perfect JSAT Holdings, Inc.	1,410,000
	METAL FABRICATE/HARDWARE (0.5%)	
30,000	NSK, Ltd.	47,760,000
30,000	NTN Corp.	16,620,000
30,000	Toho Zinc Co., Ltd.	16,380,000
		80,760,000
	MINING (0.7%)	
30,000	Dowa Holdings Co., Ltd.	24,060,000
30,000	Furukawa Co., Ltd.	6,150,000
3,000	Mitsubishi Materials Corp.	10,110,000
30,000	Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	11,370,000
30,000	Nippon Light Metal Holdings Co., Ltd.	7,350,000
30,000	Pacific Metals Co., Ltd.	11,640,000
30,000	Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	47,505,000
		118,185,000
	MISCELLANEOUS MANUFACTURERS (1.3%)	
30,000	Fujifilm Holdings Corp.	130,440,000
30,000	Konica Minolta, Inc.	29,880,000
30,000	Nikon Corp.	48,420,000
		208,740,000
	OFFICE/BUSINESS EQUIPMENT (1.1%)	
45,000	Canon, Inc.	156,195,000
30,000	Ricoh Co., Ltd.	27,480,000
		183,675,000
	OIL & GAS (0.4%)	
12,000	Inpex Corp.	13,134,000
30,000	JX Holdings, Inc.	16,401,000

30,000	Showa Shell Sekiyu KK	33,810,000
		<u>63,345,000</u>
	PACKAGING & CONTAINERS (0.3%)	
30,000	Toyo Seikan Group Holdings, Ltd.	54,240,000
		<u>54,240,000</u>
	PHARMACEUTICALS (7.2%)	
150,000	Astellas Pharma, Inc.	219,900,000
30,000	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	114,750,000
30,000	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	75,210,000
30,000	Eisai Co., Ltd.	172,920,000
30,000	Kyowa Hakko Kirin Co., Ltd.	52,860,000
30,000	Otsuka Holdings Co., Ltd.	150,660,000
30,000	Shionogi & Co., Ltd.	172,440,000
30,000	Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	55,140,000

株数	銘柄名	公正価値
----	-----	------

普通株式 (92.2%) (続き)

(単位：円)

日本 (92.2%) (続き)

PHARMACEUTICALS (7.2%) (続き)

30,000	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	156,870,000
		<u>1,170,750,000</u>
	REAL ESTATE (1.6%)	
30,000	Mitsubishi Estate Co., Ltd.	60,900,000
30,000	Mitsui Fudosan Co., Ltd.	71,220,000
30,000	Sumitomo Realty & Development Co., Ltd.	86,580,000
15,000	Tokyo Tatemono Co., Ltd.	22,020,000
30,000	Tokyu Fudosan Holdings Corp.	18,120,000
		<u>258,840,000</u>

RETAIL (9.0%)

30,000	Aeon Co., Ltd.	48,750,000
30,000	Citizen Watch Co., Ltd.	21,420,000
30,000	FamilyMart UNY Holdings Co., Ltd.	199,200,000

30,000	Fast Retailing Co., Ltd.	1,047,600,000
30,000	Isetan Mitsukoshi Holdings, Ltd.	36,660,000
15,000	J Front Retailing Co., Ltd.	24,750,000
30,000	Marui Group Co., Ltd.	45,390,000
30,000	Takashimaya Co., Ltd.	29,220,000
		1,452,990,000
	SEMICONDUCTORS (3.1%)	
60,000	Advantest Corp.	124,800,000
3,000	Sumco Corp.	5,562,000
30,000	Tokyo Electron, Ltd.	364,650,000
		495,012,000
	SHIPBUILDING (0.0%)	
30,000	Mitsui Engineering & Shipbuilding Co., Ltd.	5,160,000
	SOFTWARE (1.0%)	
9,000	DeNA Co., Ltd.	20,331,000
30,000	Konami Holdings Corp.	141,750,000
		162,081,000
	STORAGE/WAREHOUSING (0.3%)	
30,000	Mitsubishi Logistics Corp.	46,020,000
	TELECOMMUNICATIONS (8.1%)	
180,000	KDDI Corp.	525,960,000
6,000	Nippon Telegraph & Telephone Corp.	28,512,000
30,000	Nisshinbo Holdings, Inc.	33,390,000
3,000	NTT DoCoMo, Inc.	7,777,500
3,000	Oki Electric Industry Co., Ltd.	4,806,000
90,000	SoftBank Group Corp.	707,580,000
		1,308,025,500
	TEXTILES (0.0%)	
30,000	Toyobo Co., Ltd.	5,790,000
30,000	Unitika, Ltd.	2,790,000
		8,580,000
	TRANSPORTATION (2.2%)	

3,000	Central Japan Railway Co.	54,420,000
3,000	East Japan Railway Co.	29,082,000
30,000	Kawasaki Kisen Kaisha, Ltd.	8,880,000
30,000	Keio Corp.	26,460,000
15,000	Keisei Electric Railway Co., Ltd.	38,745,000
30,000	Mitsui OSK Lines, Ltd.	10,500,000
30,000	Nippon Express Co., Ltd.	17,160,000
30,000	Nippon Yusen KK	7,050,000
15,000	Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	32,490,000
30,000	Tobu Railway Co., Ltd.	16,920,000
30,000	Tokyu Corp.	23,640,000
3,000	West Japan Railway Co.	21,723,000
30,000	Yamato Holdings Co., Ltd.	69,975,000
		<hr/>
		357,045,000
		<hr/>
	日本 計 (取得原価13,597,047,233円)	14,910,724,200
		<hr/>
	普通株式 計 (取得原価13,597,047,233円)	14,910,724,200
		<hr/>

	額面	銘柄名	純資産比率(%)	公正価値
		短期投資 (5.8%)		(単位:円)
		ケイマン諸島 (0.0%)		
		定期預金 (0.0%)		
		Brown Brothers Harriman & Co.		
USD	0*	0.41% due 04/03/17		1
				<hr/>
				1
				<hr/>
		ケイマン諸島 計 (取得原価1円)		1
		日本 (5.8%)		
		定期預金 (5.8%)		
		Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
JPY	946,159,189	(0.27)%^ due 04/03/17		946,159,189
				<hr/>
				946,159,189
				<hr/>

日本 計 (取得原価946,159,189円)		946,159,189
短期投資 計 (取得原価946,159,190円)		946,159,190
投資 計 (取得原価14,543,206,423円)	98.0%	15,856,883,390
	2.0	
現金及びその他資産(負債控除後)		316,884,526
純資産	100.0%	16,173,767,916

*0.5米ドル以下

^マイナス金利

2017年3月31日現在、491,452,276円の現金が以下の先物取引の証拠金としてブローカーに差し入れられている。

先物取引 2017年3月31日現在

売買	銘柄	満期日	契約数	評価(損)
	Nikkei 225			/
Long	Index	06/2017	80	(24,000,000)

ファンドレベルの外国為替予約取引 2017年3月31日現在

買	取引先	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損) 益計
USD	Citibank NA	1,188	04/10/2017	JPY	131,800	/	522	/
USD	Citibank NA	9,155	04/10/2017	JPY	1,015,974		4,021	-
								4,543

Class A - AUD Class の外国為替予約取引 2017年3月31日現在

買	取引先	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損) 益計
						/	/	/
AUD	Citibank NA	6,810,832	04/28/2017	JPY	592,438,910	-	(14,307,217)	(14,307,217)

Class B - BRL Class の外国為替予約取引 2017年3月31日現在

買	取引先	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損) 益計
						/	/	/
BRL	Citibank NA	13,680,698	04/28/2017	JPY	498,735,113	-	(21,839,588)	(21,839,588)

Class C - USD Class の外国為替予約取引 2017年3月31日現在

買	取引先	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価（損）	評価（損）益計
						/	/	/
USD	Citibank NA	133,291,343	04/28/2017	JPY	15,004,571,785	-	(166,345,238)	(166,345,238)

Class E - RCB Class の外国為替予約取引 2017年3月31日現在

買	取引先	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価（損）	評価（損）益計
							/	/
AUD	Citibank NA	1,576,182	04/28/2017	JPY	137,215,359	/	- - (3,422,647)	(3,422,647)
BRL	Citibank NA	3,737,470	04/28/2017	JPY	136,460,928	-	(6,177,808)	(6,177,808)
ZAR	Citibank NA	15,292,912	04/28/2017	JPY	136,611,803	-	(10,225,114)	(10,225,114)
							/	/
						/	- (19,825,569)	(19,825,569)

用語:

AUD - オーストラリアドル

BRL - ブラジルリアル

JPY - 日本円

RCB - BRL、AUD、ZAR を含む資源国通貨のバスケット

USD - 米ドル

ZAR - 南アフリカランド

デリバティブ取引の価値

以下の表は本ファンドのデリバティブ取引の要約である。

	取引先	デリバティブ 資産の価値	デリバティブ 負債の価値	担保 受取	担保 差入	純額*
店頭デリバティブ						
外国為替予約取引	Citibank NA	/ 4,543	/ (222,317,612)	/ -	/ -	/ (222,313,069)
合計		/ 4,543	/ (222,317,612)	/ -	/ -	/ (222,313,069)

*純額は、デフォルトが発生した場合に取引先から（または取引先に）生じる受取り（または支払い）の額をあらわしている。純額は、同一の法人格に対する同一の契約に基づく取引に関して損益を通算することが認められている。

添付の注記は、本財務諸表の不可欠の部分である。

[前へ](#) [次へ](#)

財務諸表に関する注記（抜粋）

2017年3月31日現在

重要な会計方針

以下は、本ファンドが米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（「米国GAAP」）に準拠して、その財務諸表を作成するにあたって継続して適用している重要な会計方針の要約である。米国GAAPに準拠した財務諸表を作成するにあたって、経営陣は、財務諸表の報告額及び開示事項に影響する予想及び仮定を設定する必要がある。このような予想と実績は異なる可能性がある。

(A) 受益証券の純資産額の決定

本ファンドの純資産額（以下、純資産額）は、毎営業日（ニューヨーク証券取引所及びニューヨークの銀行が業務を行っている日）及び受託会社が決定するその他の時点（以下、それぞれの「計算日」）において算出される。本ファンドの純資産額は、管理会社報酬、弁護士報酬、監査報酬並びにその他の専門家報酬及び費用等を含む、全ての資産及び負債を考慮して計算される。

本ファンドの各クラスに関する純資産額は、日本円で計算される。日本円で表示される一口当たりの純資産額は、通常毎営業日に算出され、一口当たりの純資産の数値は小数点以下第4位までとなるよう調整される。

(B) 有価証券の評価

純資産額を計算する目的上、市場の公表価格が容易に入手できる有価証券及びその他の資産は、公正価値で計上される。公正価値は通常、引け値に基づき報告された売却価格、または売却価格が報告されない場合には、相場報告システムもしくはは主要なマーケット・メーカーまたは価格提供サービスから取得する価格を基に決定される。

市場の公表価格が容易に入手できない有価証券及びその他の資産は、運用会社からの助言に基づきブラウン・ブラザーズ・ハリマン社（アドミニストレーター）が誠実に決定した公正価値で評価する。

最新の市場データまたは信頼性の高い市場データ（売買情報、ビッドアスク情報、ブローカー価格など）がない状況では、市場の公表価格は容易に入手できないとみなされる。こうした状況には、関連市場の終了後に本ファンドの有価証券やその他の資産の価値に重大な影響を及ぼすような事象が発生する場合も含まれる。さらに、非常の事態により証券取引所もしくは有価証券取引市場が終日開かれず、他の市場価格も入手できないような場合も、市場の公表価格は容易に入手できないとみなされる。

アドミニストレーターは、本ファンドの有価証券やその他の資産の価値に重大な影響を及ぼす可能性がある重要事象の監視、及びそうした重要事象が有価証券やその他の資産の価値に影響し、資産の再評価が必要かどうかの判断の責任を負う。

本ファンドが公正価値を用いて純資産額を決定する際、有価証券がその主要な取引市場の公表価格で算出されるのではなく、運用会社またはその指示により行動する者が公正価値を正確に反映していると考え他の方法により算出される価額で評価される場合がある。公正価値の評価には、有価証券の価値に関する主観的な判断を要することがある。

本ファンドの方針は、算出した本ファンドの純資産額が価格決定時点の有価証券の価値を適正に反映することを目指している。しかし、運用会社またはその指示により行動する者が決定した公正価値が、価格決定時点で当該有価証券を売却した場合に本ファンドが得る価格を正確に反映することは保証できない（例えば、強制処分または清算処分の場合など）。本ファンドが用いる価格は有価証券を売却した場合に実現されるであろう価値とは異なる場合があり、そうした相違は財務諸表に重大な影響を及ぼし得る。

< 公正価値測定 >

米国GAAPに基づく公正価値測定及び開示事項に関する当局の指針に従い、本ファンドは、公正価値の測定に用いられる評価技法に関するインプットに優先順位を付けており、それに基づき、その投資の公正価値を開示している。分類において、優先順位が最も高いのは、活発な市場で同一資産または負債における未調整の公表価格に基づく評価（レベル1）で、優先順位が最も低いのは、その評価にとって重大な、観察不可能なインプットに基づく評価（レベル3）である。当該指針は、公正価値の分類に次の3レベルを設定している。

- ・レベル1： 活発な市場における同一の資産または負債に係る（未調整の）公表価格に基づき測定した公正価値。
- ・レベル2： 資産または負債に係る直接的に（例えば、価格）または間接的に（例えば、価格から派生）観察可能なインプットのうち、レベル1に含まれる公表価格以外のインプットに基づき測定した公正価値。
- ・レベル3： 観察可能な市場データに基づかない資産または負債に係るインプット（観察不可能なインプット）に基づき評価技法により測定した公正価値。

インプットは、様々な評価技法を適用する際に用いられ、また、リスクに対する仮定を含む、市場参加者が評価を決定するにあたって用いる様々な仮定を幅広く参照している。インプットには、価格情報、特定および広範な信用データ、流動性に関する統計値、及びその他の要素などが含まれる場合がある。

公正価値の分類内での金融商品のレベルは、公正価値測定において極めて重要なインプットの最低水準に基づいている。しかし、何をもちて「観察可能」と判定するのには、運用会社による重要な判断が必要となる。運用会社は、容易に入手でき、定期的に配布または更新され、信頼性が高く検証可能で、独占的なものではなく、関連する市場に積極的に関与している独立した情報源によって提供されている市場データを観察可能なデータとみなしている。ある金融商品に関する分類は、その価格決定の透明性に基づくもので、当該商品に対する運用会社の認識したリスクとは必ずしも一致しない。

投資

公正価値が活発な市場の公表価格に基づいているためレベル1に分類される有価証券には、上場株式及び上場投資信託証券（ETFs）が含まれている。本ファンドがそのような商品を大量に保有し、売却すると取引価格に影響を与え得ると合理的に判断できる状況においても、当該商品の公表価格は調整されない。

活発でない市場で取引されているものの、市場の公表価格、ディーラーの呼び値、または観察可能なインプットに基づくその他の価格情報源に基づいて評価されている投資はレベル2に分類される。これらには、投資適格債券及びソブリン債が含まれている。レベル2の投資は、活発な市場で取引されていない、または譲渡制限の対象となっているポジションを含むため、その評価は一般的に入手可能な市場情報に基づいた非流動性または非譲渡性を反映するように調整される。

デリバティブ取引

本ファンドは、ヘッジ目的で、予想ヘッジを含むデリバティブ取引を利用する場合がある。ヘッジ取引は、本ファンドが、デリバティブ取引を用いて、他の保有有価証券に関連するリスクを相殺する一つの戦略である。ヘッジ取引は損失を減少させることができるが、一方で市場が本ファンドの想定と異なる方向に動く、あるいはデリバティブ取引のコストがヘッジ取引による利益を上回ると、収益を減少させたり、損失を生じさせる場合がある。

また、ヘッジ取引には、デリバティブ取引の価値の変動が、想定したほどにヘッジ対象有価証券の価値の変動に連動しないリスクがある。その場合、ヘッジ対象の保有有価証券の損失は減少せず、増加するかもしれない。

本ファンドのヘッジ戦略がリスクを減らす、もしくは、ヘッジ取引自体が利用可能である、あるいは、コストに見合う効果が得られるという保証はない。本ファンドにはヘッジ取引を用いる義務はなく、ヘッジ取引を用いない選択もできる。本ファンドがデリバティブ取引に投資すると、投資元本金額を超える損失を被る場合がある。また、適切なデリバティブ取引があらゆる環境で利用できるとは限らず、本ファンドが他のリスクへのエクスポージャーを減らすために効果があると思われる場合でも、その取引を利用できるという保証はない。

デリバティブ取引は、証券取引所、または店頭取引で当事者間の交渉により取引されることがある。先物取引や上場オプション取引などの取引所上場デリバティブ取引は、活発に取引されているとみなされるか否かに応じて、通常では公正価値のレベル1またはレベル2に分類される。

外国為替予約取引並びにスワップを含む店頭デリバティブ取引については、取引相手先、ディーラーまたはブローカーから受領する価格等、観察可能なインプットを入手でき、それらが信頼できるとみなされた場合には、それらを用いて評価する。モデルが使われているような場合は、店頭デリバティブ取引の価値は、商品の契約条件や固有リスク、さらには観察可能なインプットの入手可能性や信頼性に依存する。そのようなインプットとしては、参照する有価証券の市場価格、イールドカーブ、クレジットカーブ、ボラティリティ指標、期限前償還率及びそれぞれのインプットの相関関係などが挙げられる。

一般的な外国為替予約取引及びスワップのような店頭デリバティブ取引では、インプットは通常、市場データで確認できるため、レベル2に分類される。

インプットが観察不可能な店頭デリバティブ取引は、レベル3に分類される。こうした店頭デリバティブ取引の評価は、レベル1またはレベル2のインプットを一部で利用していても、公正価値の決定に重要とみなされる観察不可能なその他のインプットが含まれるからである。

各測定日にレベル1及びレベル2のインプットは観測可能なインプットを反映して更新されるが、その結果としての損益は、観察不可能なインプットが重要であることを理由としてレベル3に反映される。

次の表は、2017年3月31日現在の貸借対照表に計上された金融商品を、項目別及び公正価値をレベル別に表示したものである。*

	(未調整)		重要な	
	活発な市場における同	重要なその他の	観察不可能	
	一の投資に係る公表価	観察可能な	な	
	格を反映したインプット	インプット	インプット	2017年3月31日
資産	(Level 1)	(Level 2)	(Level 3)	時点での公正価値

普通株式

/

Advertising	/	181,200,000	/	-	-	/	181,200,000
Aerospace/Defense		20,670,000		-	-		20,670,000
Agriculture		108,540,000		-	-		108,540,000
Airlines		10,194,000		-	-		10,194,000
Auto Manufacturers		747,790,500		-	-		747,790,500
Auto Parts & Equipment		497,535,000		-	-		497,535,000
Banks		149,621,700		-	-		149,621,700
Beverages		243,345,000		-	-		243,345,000
Building Materials		453,162,000		-	-		453,162,000
Chemicals		954,060,000		-	-		954,060,000
Commercial Services		309,120,000		-	-		309,120,000
Computers		390,327,000		-	-		390,327,000
Cosmetics/Personal Care		271,020,000		-	-		271,020,000
Distribution/Wholesale		335,367,000		-	-		335,367,000
Diversified Financial Services		126,804,000		-	-		126,804,000
Electric		9,882,000		-	-		9,882,000
Electrical Components & Equipment		98,070,000		-	-		98,070,000
Electronics		760,545,000		-	-		760,545,000
Engineering & Construction		246,540,000		-	-		246,540,000
Entertainment		8,853,000		-	-		8,853,000
Environmental Control		3,804,000		-	-		3,804,000

Food	559,695,000	-	-	559,695,000
Forest Products & Paper	44,916,000	-	-	44,916,000
Gas	27,888,000	-	-	27,888,000
Hand/Machine Tools	31,680,000	-	-	31,680,000
Healthcare-Products	360,300,000	-	-	360,300,000
Home Builders	158,034,000	-	-	158,034,000
Home Furnishings	157,350,000	-	-	157,350,000
Insurance	159,312,000	-	-	159,312,000
Internet	188,118,000	-	-	188,118,000
Iron/Steel	31,624,500	-	-	31,624,500
Leisure Time	187,890,000	-	-	187,890,000
Machinery-Construction & Mining	236,280,000	-	-	236,280,000
Machinery-Diversified	866,328,000	-	-	866,328,000
Media	1,410,000	-	-	1,410,000
Metal Fabricate/Hardware	80,760,000	-	-	80,760,000
Mining	118,185,000	-	-	118,185,000
Miscellaneous Manufacturers	208,740,000	-	-	208,740,000
Office/Business Equipment	183,675,000	-	-	183,675,000
Oil & Gas	63,345,000	-	-	63,345,000
Packaging & Containers	54,240,000	-	-	54,240,000
Pharmaceuticals	1,170,750,000	-	-	1,170,750,000
Real Estate	258,840,000	-	-	258,840,000

Retail	1,452,990,000	-	-	1,452,990,000
Semiconductors	495,012,000	-	-	495,012,000
Shipbuilding	5,160,000	-	-	5,160,000
Software	162,081,000	-	-	162,081,000
Storage/Warehousing	46,020,000	-	-	46,020,000
Telecommunications	1,308,025,500	-	-	1,308,025,500
Textiles	8,580,000	-	-	8,580,000
Transportation	357,045,000	-	-	357,045,000
短期投資				
Time Deposits	946,159,190	-	-	946,159,190
投資 計	/ 15,856,883,390	/ -	/ -	/ 15,856,883,390

金融デリバティブ取引**資産**

為替予約取引	/	-	/	4,543	/	-	/	4,543
--------	---	---	---	-------	---	---	---	-------

負債

先物	(24,000,000)	-	-	(24,000,000)
----	--------------	---	---	--------------

為替予約取引	-	(222,317,612)	-	(222,317,612)
--------	---	---------------	---	---------------

* 分類についての詳細情報は、有価証券明細表を参照。

**先物取引や外国為替予約取引などの金融デリバティブ取引は、未実現損益で評価している。

2017年3月31日に終了した期間において、レベル1、レベル2及びレベル3間の異動はなかった。本ファンドでは、各レベル間の資産の移動を年末に計上する。2017年3月31日現在、レベル3で評価された有価証券はない。

(C) 有価証券の取引及び収益

有価証券取引は、財務報告の目的上、約定日基準で計上される。有価証券の売却に係る実現損益は、個別原価法で算出される。有価証券のプレミアム及びディスカウントは、実効利回りベースで償却/発生する。配当金は配当落ち日に計上されるが、配当落ちが経過してしまった外国の有価証券から生じる配当金は、本ファンドが相当な注意を払い配当落ち日の情報入手次第、計上される。収益は外国税が控除された純額で計上される。受取利息は発生主義で計上される。割引による増価及びプレミアムの償却を調整した受取利息は、発生主義で計上される。収益は、返戻が不確実な外国税がある場合、同税額を控除した実額で計上される。その他収益には、定期預金の利息収益等が含まれる。回収が見込まれないク - ボン収入は計上しない。

(D) 分配方針

本ファンドは、受益者決議または受託会社の裁量によって、分配金（現金または現物による）の支払いを公表し実行する。本ファンドは、受益者に対して毎月分配することを目指す。

本ファンドは、当該月の分配日直前の営業日、または受託会社が単独の裁量で決定するその他の日（「基準日」）に当該分配を公表し、通常毎月20日（休業日の場合には翌営業日）または受託会社が単独の裁量で決定するその他の日（「分配日」）に分配を行うことを目指す。

当クラスの受益証券保有者は分配金を再投資し、各分配日に発行された受益証券を受け取るものとする。

2017年3月31日に終了した期間に係る分配及び再投資額は以下の通りであった。

受益者への分配金	金額
Class A-AUD Class	/ 28,580,430
Class B-BRL Class	91,420,547
Class C-USD Class	581,298,939
Class E-RCB Class	43,367,062
分配金合計	/ 744,666,978

(E) 現金及び外国通貨

本ファンドの機能通貨及び報告通貨は日本円である。外国の有価証券、通貨並びにその他の資産及び負債の公正価値は、毎営業日の最新の為替レートに基づいて本ファンドの機能通貨に換算される。

為替レートの変動の結果としての保有通貨並びにその他の資産及び負債の公正価値の変動は、外国通貨の未実現損益として計上される。有価証券の実現損益、未実現損益、並びに収益及び費用は、各取引日及び報告日のレートでそれぞれ換算される。

有価証券及びデリバティブ取引への投資に関する外国通貨の為替レートの変動による影響は、損益計算書上で当該有価証券の市場価格及び評価の変動の影響と区分されず、実現及び未実現損益に含めて計上される。

(F) 外国為替予約取引

本ファンドは、予定される有価証券の購入または売却の決済に伴い、本ファンドが保有する有価証券の一部または全部に係る通貨エクスポージャーをヘッジするため、もしくは投資戦略の一環として、外国為替予約取引を締結することができる。

外国為替予約取引は、二当事者間で将来の特定日に設定された価格で通貨の売買を行う契約である。外国為替予約取引の公正価値は、外国為替相場の変動により上下する。外国為替予約取引は価格提供会社から入手したレートで毎日値洗いされ、価格の変動は未実現損益として計上される。

実現損益は取引開始時における価値と取引終了時における価値との差額に相当し、通貨の引き渡しまたは受領により計上される。これらの契約には、貸借対照表に計上された未実現損益を超える市場リスクが含まれることがある。また、本ファンドは、取引相手先が契約の条件を履行できなくなる場合や、為替の変動がベース通貨に不利となる場合にリスクにさらされる可能性がある。

また、本ファンドは、投資家向けに為替リスクをヘッジする目的で、外国為替予約取引を締結できる権限を付与されている。特定クラスの外国為替予約取引から生じた損益は、その特定クラスに配賦される。2017年3月31日現在締結されている外国為替予約取引は、有価証券明細表に記載されている。

(G) 定期預金

本ファンドは余剰資金を、受託会社の判断により、ブラウン・ブラザーズ・ハリマン社（カストディアン）を通じ、一つ以上の適格預金取扱機関の翌日物定期預金として運用する。これは本ファンドの有価証券明細表上では短期投資として分類されている。運用する通貨の需要が低い場合には、本ファンドは資金預入のために手数料を支払う可能性があり、それによって本ファンドに支払利息が生じることがある。

(H) 先物取引

本ファンドは、先物取引を締結することができる。本ファンドは、証券市場または金利及び通貨価値の変動に対するエクスポージャーを管理するために、先物取引を利用する。また、本ファンドはヘッジ目的ではなく、外貨への直接投資として、先物取引またはオプションを売建てまたは買建てをする場合がある。

先物取引の利用に伴う主たるリスクには、本ファンドが保有する有価証券の市場価値の変動と先物取引の価格の変動との間の不完全な相関性、市場が非流動的である可能性、及び取引相手先が契約条件を履行できない可能性が挙げられる。先物取引は、市場で示された毎日の清算価格で評価される。

本ファンドは、先物取引の締結に際して、先物ブローカーまたは取引所の定める当初証拠金額要件に従い、現金または米国政府 / 政府機関債を先物ブローカーに預け入れることが義務づけられている。先物取引は毎日値洗いされ、価格の変動により適宜未払金あるいは未収金（「変動証拠金」）が本ファンドに計上される。損益は認識されるが、当該契約が期限を迎えるか決済されるまで実現損益とはみなされない。先物取引には、貸借対照表に開示された変動証拠金を超える損失リスクが様々な度合いで含まれている。2017年3月31日時点の先物取引は、有価証券明細表に記載されている。

(I) デリバティブ商品

会計基準編纂書ASC 815-10-50は、デリバティブ取引及びヘッジ取引の開示を義務づけている。具体的には、a) デリバティブ取引をどのように、また何故利用しているか、b) デリバティブ取引と関連するヘッジ取引をどのように計上しているか、c) デリバティブ取引と関連するヘッジ取引が財政状態、パフォーマンス及びキャッシュフローにどのような影響を及ぼすか、を開示することが要求されている。

本ファンドは、いかなるデリバティブ取引もASC 第 815号に基づくヘッジ取引として指定していない。

本ファンドは、外国為替予約取引やインデックス先物取引を含む様々なデリバティブ取引を行っている。一般的に、運用会社は、金利や為替レートの変動リスクを含む、全体的なエクスポージャーのヘッジのためにデリバティブ取引を行う。本ファンドは、運用会社が投資やその他のデリバティブが、その他の投資と比べて不適正な価格となっており、収益機会があると判断した場合にデリバティブ取引を行うことがある。これらデリバティブ取引の公正価値は、貸借対照表に独立掲載され、各種デリバティブ取引の公正価値の変動は、実現損益や未実現損益の変動として損益計算書に反映される。本年度中の、本ファンドにおけるデリバティブ取引は、外国為替予約取引とインデックス先物のみであった。

以下は、リスク・エクスポージャーで分類したファンドのデリバティブ取引の公正価値の要約である。

2017年3月31日時点の貸借対照表におけるデリバティブ取引の公正価値

ASC第815号に基づくヘッジ取引として指定されていないデリバティブ取引

該当項目

株価リスク*

外国為替リスク**

デリバティブ資産

外国為替予約取引に係る評価益	/	-	/	4,543
----------------	---	---	---	-------

デリバティブ負債

先物取引に係る評価損	/	(24,000,000)	/	-
外国為替予約取引に係る評価損	/	-	/	(222,317,612)

*有価証券明細表に記載されているデリバティブ取引の公正価値は、先物取引に係る累積評価損益を含む。変動証拠金は期末時点の残高が貸借対照表に記載されている。

** 外国為替予約取引のグロス価値は、外国為替予約取引に係る評価損益として貸借対照表に記載されている。

デリバティブ取引が損益計算書（2017年3月31日に終了した年度）に与えた影響

ASC第815号に基づくヘッジ取引として指定されていないデリバティブ取引

該当箇所	株価リスク	外国為替リスク
運用の成果として認識されたデリバティブに係る実現（損）益		
外国為替予約取引に係る実現益	/	/ 198,524,214
先物取引に係る実現益	/ 478,286,033	/ -
	-	-
運用の成果として認識されたデリバティブに係る未実現（損）益の変動		
外国為替予約取引に係る未実現損の変動	/	/ (140,664,629)
先物取引に係る未実現損の変動	/ (129,434,000)	/ -
	-	-

2017年3月31日に終了した年度における外国為替予約取引の未決済の平均想定元本はおよそ次の通り：

Fund level*	/	1,696,769
Class A-AUD Class	/	644,111,313
Class B-BRL Class	/	580,717,891
Class C-USD Class	/	17,347,616,157
Class E-RCB Class	/	447,269,008

* すべてのクラスで組み入れられている外国為替予約取引。当該年度におけるファンドレベルでの外国為替予約取引の保有期間は6ヵ月であった。

2017年3月31日に終了した年度における先物取引の未決済の平均想定元本は、約3,837,421,692円であった。

ファンドは、特定の取引相手方と、随時締結される店頭デリバティブ取引及び外国為替取引を規定する国際スワップ・デリバティブ協会（ISDA）マスター契約等（以下「マスター契約」という。）のマスター・ネットティング契約の当事者である。当該マスター契約には、特に当事者の一般的義務、表明、合意、担保要求、債務不履行事由及び期限前終了に関する条項が含まれる場合がある。

担保要求はファンドにおける各取引相手方のネット・ポジションに基づいて決定される。担保となりうるのは、現金、米国債や米国政府関連機関が発行する債券、本ファンドと当該取引相手方が同意するその他の有価証券である。特定の取引相手方に関して、マスター契約の条件に従って本ファンドに差し入れられた担保は、本ファンドの保管会社が分別保管し、売却または再担保が可能な額に関しては本ファンドの有価証券明細表に表示される。本ファンドが差し入れた担保は、本ファンドの保管会社により分別保管され、本ファンドの有価証券明細表および貸借対照表において識別される。現金担保がある場合は、貸借対照表に開示される。

本ファンドに対して適用される取引終了事由は、一定期間に亘り本ファンドの純資産が規定された閾値を下回る場合に発生しうる。取引相手方に対して適用される取引終了事由は、取引相手方の信用格付が規定された水準を下回る場合に発生しうる。いずれの場合も、発生時に、他方の当事者は期限前終了を選択することが可能であり、当事者による合理的決定に基づいて、未決済デリバティブおよび外国為替取引のすべての決済（期限前終了によって生じた損失および費用の支払いを含む）が行われる。単一または複数の本ファンドの取引相手方による期限前終了の決定が、本ファンドの将来のデリバティブ取引に影響を与える可能性がある。

2017年3月31日現在保有しているすべての先物取引は、認可を受けた取引所に上場されたものである。

[前へ](#) [次へ](#)

日本株 2 2 5 ・ ブラジルリアルコース

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成29年10月25日現在 金額（円）	当期 平成30年 4 月25日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	993,406
コール・ローン	11,852,281	8,897,735
投資信託受益証券	393,850,070	295,959,808
親投資信託受益証券	400,827	400,709
未収入金	6,098,939	6,198,036
流動資産合計	412,202,117	312,449,694
資産合計	412,202,117	312,449,694
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,360,872	2,987,627
未払解約金	28,140,136	6,325,027
未払受託者報酬	9,233	6,787
未払委託者報酬	332,633	244,673
その他未払費用	22,790	18,154
流動負債合計	31,865,664	9,582,268
負債合計	31,865,664	9,582,268
純資産の部		
元本等		
元本	336,087,202	298,762,753
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,249,251	4,104,673
（分配準備積立金）	2,688,189	11,419,543
元本等合計	380,336,453	302,867,426
純資産合計	380,336,453	302,867,426
負債純資産合計	412,202,117	312,449,694

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成29年 4 月26日 至 平成29年10月25日 金額（円）	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年 4 月25日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	26,161,898	15,728,402
受取利息	39	24
有価証券売買等損益	48,384,255	31,885,686
営業収益合計	74,546,192	16,157,260
営業費用		

支払利息	3,442	2,597
受託者報酬	60,189	47,881
委託者報酬	2,168,811	1,725,682
その他費用	22,790	18,159
営業費用合計	2,255,232	1,794,319
営業利益又は営業損失（ ）	72,290,960	17,951,579
経常利益又は経常損失（ ）	72,290,960	17,951,579
当期純利益又は当期純損失（ ）	72,290,960	17,951,579
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（ ）	5,422,135	223,132
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,705,238	44,249,251
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,306,309	5,049,653
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,306,309	5,049,653
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,714,958	8,392,862
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,714,958	8,392,862
分配金	24,916,163	19,072,922
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,249,251	4,104,673

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において、確定分配金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益 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	前期	当期
	平成29年10月25日現在	平成30年4月25日現在
1. 元本状況		
期首元本額	457,652,352円	336,087,202円
期中追加設定元本額	82,582,042円	33,679,900円
期中一部解約元本額	204,147,192円	71,004,349円
2. 受益権の総数	336,087,202口	298,762,753口

(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4月26日 至 平成29年10月25日	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日																																																															
<p>分配金の計算過程</p> <p>第65期計算期間末（平成29年5月25日）に、投資信託約款に基づき計算した419,752,350円（1万口当たり8,508.16円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,933,527円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>5,073,775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>410,337,817円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>4,340,758円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>419,752,350円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,508.16円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>4,933,527円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第66期計算期間末（平成29年6月26日）に、投資信託約款に基づき計算した358,526,513円（1万口当たり8,510.07円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,212,969円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>4,291,357円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>350,430,010円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>3,805,146円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>358,526,513円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,510.07円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>4,212,969円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第67期計算期間末（平成29年7月25日）に、投資信託約款に基づき計算した357,093,932円（1万口当たり8,518.72円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,191,873円（1万口当たり100円）を分配しております。</p>	配当等収益（費用控除後）	5,073,775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	410,337,817円	分配準備積立金	4,340,758円	分配可能額	419,752,350円	（1万口当たり分配可能額）	(8,508.16円)	収益分配金	4,933,527円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	配当等収益（費用控除後）	4,291,357円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	350,430,010円	分配準備積立金	3,805,146円	分配可能額	358,526,513円	（1万口当たり分配可能額）	(8,510.07円)	収益分配金	4,212,969円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	<p>分配金の計算過程</p> <p>第71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275,159,480円（1万口当たり8,493.41円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,239,681円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,955,692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>269,689,949円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>2,513,839円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>275,159,480円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,493.41円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>3,239,681円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第72期計算期間末（平成29年12月25日）に、投資信託約款に基づき計算した285,843,726円（1万口当たり8,466.72円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,376,085円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,473,540円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>281,166,712円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>2,203,474円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>285,843,726円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,466.72円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>3,376,085円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第73期計算期間末（平成30年1月25日）に、投資信託約款に基づき計算した290,356,170円（1万口当たり8,903.59円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,261,111円（1万口当たり100円）を分配しております。</p>	配当等収益（費用控除後）	2,955,692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	269,689,949円	分配準備積立金	2,513,839円	分配可能額	275,159,480円	（1万口当たり分配可能額）	(8,493.41円)	収益分配金	3,239,681円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	配当等収益（費用控除後）	2,473,540円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	281,166,712円	分配準備積立金	2,203,474円	分配可能額	285,843,726円	（1万口当たり分配可能額）	(8,466.72円)	収益分配金	3,376,085円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)
配当等収益（費用控除後）	5,073,775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	410,337,817円																																																																
分配準備積立金	4,340,758円																																																																
分配可能額	419,752,350円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,508.16円)																																																																
収益分配金	4,933,527円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	4,291,357円																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																
収益調整金	350,430,010円																																																																
分配準備積立金	3,805,146円																																																																
分配可能額	358,526,513円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,510.07円)																																																																
収益分配金	4,212,969円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	2,955,692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	269,689,949円																																																																
分配準備積立金	2,513,839円																																																																
分配可能額	275,159,480円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,493.41円)																																																																
収益分配金	3,239,681円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	2,473,540円																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																
収益調整金	281,166,712円																																																																
分配準備積立金	2,203,474円																																																																
分配可能額	285,843,726円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,466.72円)																																																																
収益分配金	3,376,085円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																

配当等収益 （費用控除後）	4,552,194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	348,700,202円
分配準備積立金	3,841,536円
分配可能額	357,093,932円
（1万口当たり分配可能額）	(8,518.72円)
収益分配金	4,191,873円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第68期計算期間末（平成29年8月25日）に、投資信託約款に基づき計算した354,369,961円（1万口当たり8,505.72円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,166,253円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	3,623,345円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	346,618,705円
分配準備積立金	4,127,911円
分配可能額	354,369,961円
（1万口当たり分配可能額）	(8,505.72円)
収益分配金	4,166,253円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第69期計算期間末（平成29年9月25日）に、投資信託約款に基づき計算した344,386,059円（1万口当たり8,501.95円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,050,669円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	3,897,969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	337,010,728円
分配準備積立金	3,477,362円
分配可能額	344,386,059円
（1万口当たり分配可能額）	(8,501.95円)
収益分配金	4,050,669円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第70期計算期間末（平成29年10月25日）に、投資信託約款に基づき計算した285,691,283円（1万口当たり8,500.51円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,360,872円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	3,306,942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	279,642,222円
分配準備積立金	2,742,119円
分配可能額	285,691,283円
（1万口当たり分配可能額）	(8,500.51円)
収益分配金	3,360,872円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

配当等収益 （費用控除後）	2,632,822円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填 後）	14,874,481円
収益調整金	271,602,302円
分配準備積立金	1,246,565円
分配可能額	290,356,170円
（1万口当たり分配可能額）	(8,903.59円)
収益分配金	3,261,111円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第74期計算期間末（平成30年2月26日）に、投資信託約款に基づき計算した279,181,177円（1万口当たり8,875.32円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,145,591円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,255,544円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	262,064,703円
分配準備積立金	14,860,930円
分配可能額	279,181,177円
（1万口当たり分配可能額）	(8,875.32円)
収益分配金	3,145,591円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第75期計算期間末（平成30年3月26日）に、投資信託約款に基づき計算した271,017,656円（1万口当たり8,848.61円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,062,827円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,244,509円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	255,214,532円
分配準備積立金	13,558,615円
分配可能額	271,017,656円
（1万口当たり分配可能額）	(8,848.61円)
収益分配金	3,062,827円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第76期計算期間末（平成30年4月25日）に、投資信託約款に基づき計算した263,381,176円（1万口当たり8,815.73円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い12,987,627円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,005,140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	248,974,006円
分配準備積立金	12,402,030円
分配可能額	263,381,176円
（1万口当たり分配可能額）	(8,815.73円)
収益分配金	2,987,627円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25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。なお、当ファンドは投資信託受益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、投資信託受益証券においては、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 平成30年4月25日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

前期（平成29年10月25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	39
投資信託受益証券	18,029,646
合計	18,029,685

当期（平成30年4月25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	39
投資信託受益証券	20,994,689
合計	20,994,650

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成29年10月25日現在）

該当事項はありません。

当期（平成30年4月25日現在）

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期（自平成29年10月26日 至 平成30年4月25日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 平成29年10月25日現在	当期 平成30年4月25日現在
1口当たり純資産額 1.1317円 「1口 = 1円 (10,000口 = 11,317円)」	1口当たり純資産額 1.0137円 「1口 = 1円 (10,000口 = 10,137円)」

(4) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	Japan Stock 225 Fund BRL Class	401,682,693	295,959,808	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	393,895	400,709	
合計		2銘柄	402,076,588	296,360,517	

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「Japan Stock 225 Fund BRL Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「日本株225・米ドルコース」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

日本株 2 2 5 ・ 豪ドルコース

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成29年10月25日現在 金額（円）	当期 平成30年 4 月25日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,633,196
コール・ローン	19,520,064	32,541,797
投資信託受益証券	522,995,538	512,050,643
親投資信託受益証券	150,310	150,266
未収入金	492,104	6,003,976
流動資産合計	543,158,016	554,379,878
資産合計	543,158,016	554,379,878
負債の部		
流動負債		
未払金	1,013,516	4,791,313
未払収益分配金	6,610,682	7,362,571
未払解約金	534,856	10,248,911
未払受託者報酬	11,936	11,106
未払委託者報酬	429,869	400,141
その他未払費用	29,761	26,085
流動負債合計	8,630,620	22,840,127
負債合計	8,630,620	22,840,127
純資産の部		
元本等		
元本	440,712,178	490,838,113
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	93,815,218	40,701,638
（分配準備積立金）	22,820,387	28,306,618
元本等合計	534,527,396	531,539,751
純資産合計	534,527,396	531,539,751
負債純資産合計	543,158,016	554,379,878

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成29年 4 月26日 至 平成29年10月25日 金額（円）	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年 4 月25日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	12,256,979	10,074,716
受取利息	62	83
有価証券売買等損益	111,409,468	20,571,982
営業収益合計	123,666,509	10,497,183

営業費用		
支払利息	6,248	5,055
受託者報酬	78,500	68,628
委託者報酬	2,827,572	2,472,635
その他費用	29,761	26,101
営業費用合計	2,942,081	2,572,419
営業利益又は営業損失()	120,724,428	13,069,602
経常利益又は経常損失()	120,724,428	13,069,602
当期純利益又は当期純損失()	120,724,428	13,069,602
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()	2,959,572	958,768
期首剰余金又は期首欠損金()	34,057,535	93,815,218
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,031,178	16,372,922
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,031,178	16,372,922
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,002,152	15,690,024
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	23,002,152	15,690,024
分配金	46,036,199	39,768,108
期末剰余金又は期末欠損金()	93,815,218	40,701,638

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において、確定分配金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益 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	前期	当期
	平成29年10月25日現在	平成30年4月25日現在
1. 元本状況		
期首元本額	536,992,092円	440,712,178円
期中追加設定元本額	107,027,956円	136,489,815円
期中一部解約元本額	203,307,870円	86,363,880円
2. 受益権の総数	440,712,178口	490,838,113口

(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4月26日 至 平成29年10月25日	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日																																																															
<p>分配金の計算過程</p> <p>第65期計算期間末（平成29年5月25日）に、投資信託約款に基づき計算した586,109,431円（1万口当たり9,776.70円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い18,992,446円（1万口当たり150円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,183,526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>583,919,313円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>6,592円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>586,109,431円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(9,776.70円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>8,992,446円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(150円)</td></tr> </table> <p>第66期計算期間末（平成29年6月26日）に、投資信託約款に基づき計算した517,079,932円（1万口当たり9,666.42円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い18,023,855円（1万口当たり150円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,127,267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>514,925,116円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>27,549円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>517,079,932円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(9,666.42円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>8,023,855円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(150円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	2,183,526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	583,919,313円	分配準備積立金	6,592円	分配可能額	586,109,431円	（1万口当たり分配可能額）	(9,776.70円)	収益分配金	8,992,446円	（1万口当たり収益分配金）	(150円)	配当等収益（費用控除後）	2,127,267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	514,925,116円	分配準備積立金	27,549円	分配可能額	517,079,932円	（1万口当たり分配可能額）	(9,666.42円)	収益分配金	8,023,855円	（1万口当たり収益分配金）	(150円)	<p>分配金の計算過程</p> <p>第71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424,087,670円（1万口当たり9,721.94円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,543,254円（1万口当たり150円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>1,216,140円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>401,087,651円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>21,783,879円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>424,087,670円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(9,721.94円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>6,543,254円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(150円)</td></tr> </table> <p>第72期計算期間末（平成29年12月25日）に、投資信託約款に基づき計算した419,035,943円（1万口当たり9,978.83円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,298,873円（1万口当たり150円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>1,615,343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>15,468,636円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>386,584,290円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>15,367,674円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>419,035,943円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(9,978.83円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>6,298,873円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(150円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	1,216,140円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	401,087,651円	分配準備積立金	21,783,879円	分配可能額	424,087,670円	（1万口当たり分配可能額）	(9,721.94円)	収益分配金	6,543,254円	（1万口当たり収益分配金）	(150円)	配当等収益（費用控除後）	1,615,343円	有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	15,468,636円	収益調整金	386,584,290円	分配準備積立金	15,367,674円	分配可能額	419,035,943円	（1万口当たり分配可能額）	(9,978.83円)	収益分配金	6,298,873円	（1万口当たり収益分配金）	(150円)
配当等収益（費用控除後）	2,183,526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	583,919,313円																																																																
分配準備積立金	6,592円																																																																
分配可能額	586,109,431円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(9,776.70円)																																																																
収益分配金	8,992,446円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(150円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	2,127,267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	514,925,116円																																																																
分配準備積立金	27,549円																																																																
分配可能額	517,079,932円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(9,666.42円)																																																																
収益分配金	8,023,855円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(150円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	1,216,140円																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																
収益調整金	401,087,651円																																																																
分配準備積立金	21,783,879円																																																																
分配可能額	424,087,670円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(9,721.94円)																																																																
収益分配金	6,543,254円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(150円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	1,615,343円																																																																
有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	15,468,636円																																																																
収益調整金	386,584,290円																																																																
分配準備積立金	15,367,674円																																																																
分配可能額	419,035,943円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(9,978.83円)																																																																
収益分配金	6,298,873円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(150円)																																																																

第67期計算期間末（平成29年7月25日）に、投資信託約款に基づき計算した502,270,486円（1万口当たり9,556.22円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,883,926円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,091,530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	500,164,286円
分配準備積立金	14,670円
分配可能額	502,270,486円
（1万口当たり分配可能額）	(9,556.22円)
収益分配金	7,883,926円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

第68期計算期間末（平成29年8月25日）に、投資信託約款に基づき計算した464,486,522円（1万口当たり9,436.85円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,383,074円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,507,292円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	462,975,669円
分配準備積立金	3,561円
分配可能額	464,486,522円
（1万口当たり分配可能額）	(9,436.85円)
収益分配金	7,383,074円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

第69期計算期間末（平成29年9月25日）に、投資信託約款に基づき計算した444,081,414円（1万口当たり9,326.55円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,142,216円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,889,406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	442,159,046円
分配準備積立金	32,962円
分配可能額	444,081,414円
（1万口当たり分配可能額）	(9,326.55円)
収益分配金	7,142,216円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

第70期計算期間末（平成29年10月25日）に、投資信託約款に基づき計算した433,840,245円（1万口当たり9,844.07円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,610,682円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,722,065円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	27,692,691円
収益調整金	404,409,176円
分配準備積立金	16,313円
分配可能額	433,840,245円
（1万口当たり分配可能額）	(9,844.07円)
収益分配金	6,610,682円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

第73期計算期間末（平成30年1月25日）に、投資信託約款に基づき計算した443,955,548円（1万口当たり10,497.27円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,343,871円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,590,575円
有価証券売買等損益 （費用控除後）	26,677,436円
収益調整金	389,580,910円
分配準備積立金	26,106,627円
分配可能額	443,955,548円
（1万口当たり分配可能額）	(10,497.27円)
収益分配金	6,343,871円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

第74期計算期間末（平成30年2月26日）に、投資信託約款に基づき計算した446,625,784円（1万口当たり10,374.93円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,457,284円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,175,542円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	399,630,614円
分配準備積立金	45,819,628円
分配可能額	446,625,784円
（1万口当たり分配可能額）	(10,374.93円)
収益分配金	6,457,284円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

第75期計算期間末（平成30年3月26日）に、投資信託約款に基づき計算した462,268,029円（1万口当たり10,254.01円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,762,255円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,309,969円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	420,576,562円
分配準備積立金	40,381,498円
分配可能額	462,268,029円
（1万口当たり分配可能額）	(10,254.01円)
収益分配金	6,762,255円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

第76期計算期間末（平成30年4月25日）に、投資信託約款に基づき計算した497,728,535円（1万口当たり10,140.38円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,362,571円（1万口当たり150円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,750,803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	462,059,346円
分配準備積立金	33,918,386円
分配可能額	497,728,535円
（1万口当たり分配可能額）	(10,140.38円)
収益分配金	7,362,571円
（1万口当たり収益分配金）	(150円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25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。なお、当ファンドは投資信託受益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、投資信託受益証券においては、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 平成30年4月25日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成29年10月25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	15
投資信託受益証券	33,399,352
合計	33,399,367

当期（平成30年4月25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	15
投資信託受益証券	48,539,457
合計	48,539,442

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成29年10月25日現在）

該当事項はありません。

当期（平成30年4月25日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成29年10月26日 至 平成30年4月25日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成29年10月25日現在	当期 平成30年4月25日現在
1口当たり純資産額 1.2129円 「1口 = 1円（10,000口 = 12,129円）」	1口当たり純資産額 1.0829円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,829円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	Japan Stock 225 Fund AUD Class	590,396,222	512,050,643	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	147,711	150,266	

合計 2 銘柄	590,543,933	512,200,909
---------	-------------	-------------

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「Japan Stock 225 Fund AUD Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「日本株225・米ドルコース」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

日本株 2 2 5 ・ 資源 3 通貨 コース

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成29年10月25日現在 金額（円）	当期 平成30年 4 月25日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,399,398
コール・ローン	15,642,199	12,534,124
投資信託受益証券	407,106,402	350,791,473
親投資信託受益証券	50,103	50,088
未収入金	3,831,567	-
流動資産合計	426,630,271	364,775,083
資産合計	426,630,271	364,775,083
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,748,056	3,381,287
未払解約金	5,913,225	-
未払受託者報酬	9,051	7,969
未払委託者報酬	326,164	287,165
その他未払費用	20,630	20,305
流動負債合計	10,017,126	3,696,726
負債合計	10,017,126	3,696,726
純資産の部		
元本等		
元本	374,805,606	338,128,784
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	41,807,539	22,949,573
（分配準備積立金）	14,391	656,492
元本等合計	416,613,145	361,078,357
純資産合計	416,613,145	361,078,357
負債純資産合計	426,630,271	364,775,083

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成29年 4 月26日 至 平成29年10月25日 金額（円）	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年 4 月25日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	16,685,691	13,899,965
受取利息	54	38
有価証券売買等損益	58,473,137	3,332,470
営業収益合計	75,158,882	10,567,533
営業費用		

支払利息	3,591	4,014
受託者報酬	54,465	53,484
委託者報酬	1,962,289	1,927,181
その他費用	20,630	20,315
営業費用合計	2,040,975	2,004,994
営業利益又は営業損失（ ）	73,117,907	8,562,539
経常利益又は経常損失（ ）	73,117,907	8,562,539
当期純利益又は当期純損失（ ）	73,117,907	8,562,539
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,264,427	79,137
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,882,675	41,807,539
剰余金増加額又は欠損金減少額	965,175	5,931,717
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	965,175	5,931,717
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,050,930	12,171,375
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,050,930	12,171,375
分配金	23,077,511	21,101,710
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	41,807,539	22,949,573

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において、確定分配金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益 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	前期	当期
	平成29年10月25日現在	平成30年4月25日現在
1. 元本状況		
期首元本額	410,169,076円	374,805,606円
期中追加設定元本額	16,589,148円	48,390,677円
期中一部解約元本額	51,952,618円	85,067,499円
2. 受益権の総数	374,805,606口	338,128,784口

(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4月26日 至 平成29年10月25日	自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25日																																																															
<p>分配金の計算過程</p> <p>第65期計算期間末（平成29年5月25日）に、投資信託約款に基づき計算した359,683,914円（1万口当たり8,993.57円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,999,345円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>3,017,653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>356,654,527円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>11,734円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>359,683,914円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,993.57円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>3,999,345円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第66期計算期間末（平成29年6月26日）に、投資信託約款に基づき計算した346,660,971円（1万口当たり8,966.69円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,866,098円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,825,540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>343,806,619円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>28,812円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>346,660,971円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,966.69円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>3,866,098円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	3,017,653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	356,654,527円	分配準備積立金	11,734円	分配可能額	359,683,914円	（1万口当たり分配可能額）	(8,993.57円)	収益分配金	3,999,345円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	配当等収益（費用控除後）	2,825,540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	343,806,619円	分配準備積立金	28,812円	分配可能額	346,660,971円	（1万口当たり分配可能額）	(8,966.69円)	収益分配金	3,866,098円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	<p>分配金の計算過程</p> <p>第71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334,263,248円（1万口当たり8,789.53円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,802,972円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,171,951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>332,077,356円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>13,941円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>334,263,248円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,789.53円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>3,802,972円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第72期計算期間末（平成29年12月25日）に、投資信託約款に基づき計算した313,051,766円（1万口当たり8,750.72円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,577,440円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,182,609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>310,781,411円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>87,746円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>313,051,766円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,750.72円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>3,577,440円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	2,171,951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	332,077,356円	分配準備積立金	13,941円	分配可能額	334,263,248円	（1万口当たり分配可能額）	(8,789.53円)	収益分配金	3,802,972円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	配当等収益（費用控除後）	2,182,609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	310,781,411円	分配準備積立金	87,746円	分配可能額	313,051,766円	（1万口当たり分配可能額）	(8,750.72円)	収益分配金	3,577,440円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)
配当等収益（費用控除後）	3,017,653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	356,654,527円																																																																
分配準備積立金	11,734円																																																																
分配可能額	359,683,914円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,993.57円)																																																																
収益分配金	3,999,345円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	2,825,540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	343,806,619円																																																																
分配準備積立金	28,812円																																																																
分配可能額	346,660,971円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,966.69円)																																																																
収益分配金	3,866,098円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	2,171,951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	332,077,356円																																																																
分配準備積立金	13,941円																																																																
分配可能額	334,263,248円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,789.53円)																																																																
収益分配金	3,802,972円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																
配当等収益（費用控除後）	2,182,609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	310,781,411円																																																																
分配準備積立金	87,746円																																																																
分配可能額	313,051,766円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(8,750.72円)																																																																
収益分配金	3,577,440円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																																

第67期計算期間末（平成29年7月25日）に、投資信託約款に基づき計算した346,129,428円（1万口当たり8,941.21円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,871,170円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,884,534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	343,174,598円
分配準備積立金	70,296円
分配可能額	346,129,428円
（1万口当たり分配可能額）	(8,941.21円)
収益分配金	3,871,170円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第68期計算期間末（平成29年8月25日）に、投資信託約款に基づき計算した341,039,684円（1万口当たり8,908.23円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,828,367円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,564,907円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	338,462,251円
分配準備積立金	12,526円
分配可能額	341,039,684円
（1万口当たり分配可能額）	(8,908.23円)
収益分配金	3,828,367円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第69期計算期間末（平成29年9月25日）に、投資信託約款に基づき計算した333,927,979円（1万口当たり8,870.51円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,764,475円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,344,438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	331,571,341円
分配準備積立金	12,200円
分配可能額	333,927,979円
（1万口当たり分配可能額）	(8,870.51円)
収益分配金	3,764,475円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第70期計算期間末（平成29年10月25日）に、投資信託約款に基づき計算した331,042,952円（1万口当たり8,832.39円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,748,056円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,316,152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	328,704,766円
分配準備積立金	22,034円
分配可能額	331,042,952円
（1万口当たり分配可能額）	(8,832.39円)
収益分配金	3,748,056円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第73期計算期間末（平成30年1月25日）に、投資信託約款に基づき計算した308,510,969円（1万口当たり8,898.46円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,467,015円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,525,655円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	6,047,403円
収益調整金	299,922,308円
分配準備積立金	15,603円
分配可能額	308,510,969円
（1万口当たり分配可能額）	(8,898.46円)
収益分配金	3,467,015円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第74期計算期間末（平成30年2月26日）に、投資信託約款に基づき計算した304,781,381円（1万口当たり8,864.14円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,438,362円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,237,181円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	297,680,945円
分配準備積立金	4,863,255円
分配可能額	304,781,381円
（1万口当たり分配可能額）	(8,864.14円)
収益分配金	3,438,362円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第75期計算期間末（平成30年3月26日）に、投資信託約款に基づき計算した302,838,776円（1万口当たり8,817.21円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,434,634円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,822,250円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	297,370,239円
分配準備積立金	3,646,287円
分配可能額	302,838,776円
（1万口当たり分配可能額）	(8,817.21円)
収益分配金	3,434,634円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第76期計算期間末（平成30年4月25日）に、投資信託約款に基づき計算した296,795,062円（1万口当たり8,777.57円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い13,381,287円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,040,756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	292,757,283円
分配準備積立金	1,997,023円
分配可能額	296,795,062円
（1万口当たり分配可能額）	(8,777.57円)
収益分配金	3,381,287円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成29年10月26日 至 平成30年4月25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。なお、当ファンドは投資信託受益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、投資信託受益証券においては、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成30年4月25日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成29年10月25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	5
投資信託受益証券	21,735,118
合計	21,735,123

当期（平成30年4月25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	5
投資信託受益証券	28,314,495
合計	28,314,490

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成29年10月25日現在）

該当事項はありません。

当期（平成30年4月25日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成29年10月26日 至 平成30年4月25日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成29年10月25日現在	当期 平成30年4月25日現在
1口当たり純資産額 1.1115円 「1口 = 1円（10,000口 = 11,115円）」	1口当たり純資産額 1.0679円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,679円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	Japan Stock 225 Fund RCB Class	409,755,255	350,791,473	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	49,237	50,088	

合計 2 銘柄	409,804,492	350,841,561	
---------	-------------	-------------	--

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「Japan Stock 225 Fund RCB Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「日本株225・米ドルコース」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成30年5月末現在)

日本株225・米ドルコース

資産総額	11,640,780,647 円
負債総額	90,873,579 円
純資産総額(-)	11,549,907,068 円
発行済数量	7,961,462,307 口
1単位当り純資産額(/)	1.4507 円

日本株225・ブラジルリアルコース

資産総額	272,181,916 円
負債総額	1,090,764 円
純資産総額(-)	271,091,152 円
発行済数量	293,500,484 口
1単位当り純資産額(/)	0.9236 円

日本株225・豪ドルコース

資産総額	523,534,223 円
負債総額	7,447,189 円
純資産総額(-)	516,087,034 円
発行済数量	491,364,374 口
1単位当り純資産額(/)	1.0503 円

日本株225・資源3通貨コース

資産総額	349,641,100 円
負債総額	1,037,149 円
純資産総額(-)	348,603,951 円
発行済数量	343,137,881 口
1単位当り純資産額(/)	1.0159 円

(参考) キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

資産総額	4,341,689,120 円
負債総額	2,897,986 円
純資産総額(-)	4,338,791,134 円
発行済数量	4,265,063,593 口
1単位当り純資産額(/)	1.0173 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5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。

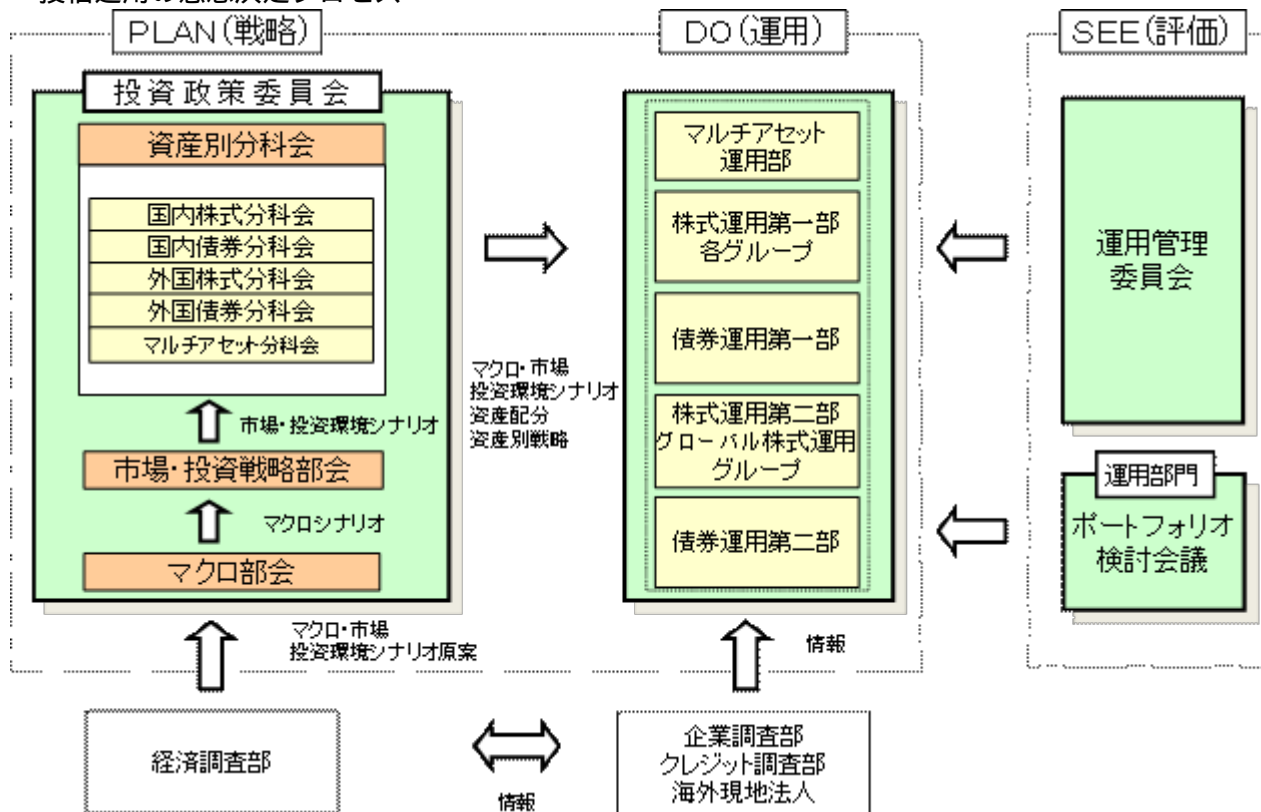
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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5月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、413本であり、その純資産総額は、約3,425,228百万円です（なお、親投資信託131本は、ファンド数及び純資産総額からは除いております。）。

種類	ファンド数	純資産総額
単位型株式投資信託	26	68,492百万円
追加型株式投資信託	305	3,061,723百万円
単位型公社債投資信託	82	295,011百万円
合計	413	3,425,228百万円

[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)
資産の部			
流動資産			
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
固定資産			
有形固定資産			
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
無形固定資産			
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
投資その他の資産			
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	其他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	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。

- (2) 訴訟事件その他重要事項

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

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

[前へ](#)

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

(1) 受託会社

名称	資本金の額（百万円） 平成29年9月末現在	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

< 参考：再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）の概要 >

- ・ 資本金：51,000百万円（平成29年9月末現在）
- ・ 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- ・ 再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成29年9月末現在	事業の内容
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券（注）	48,323	
高木証券株式会社	11,069	
楽天証券株式会社	7,495	
内藤証券株式会社	3,002	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
FFG証券株式会社	3,000	

(注) 株式会社SBI証券の資本金の額は、平成29年12月末現在です。

以上

独立監査人の監査報告書

平成30年6月1日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株225・米ドルコースの平成29年10月26日から平成30年4月25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、日本株225・米ドルコースの平成30年4月25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1日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株225・ブラジルリアルコースの平成29年10月26日から平成30年4月25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、日本株225・ブラジルリアルコースの平成30年4月25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1日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株225・豪ドルコースの平成29年10月26日から平成30年4月25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、日本株225・豪ドルコースの平成30年4月25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。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年6月1日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株225・資源3通貨コースの平成29年10月26日から平成30年4月25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、日本株225・資源3通貨コースの平成30年4月25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。

[前へ](#) [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。