

【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 8 月21日
【発行者名】	大和住銀投信投資顧問株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 後藤 正明
【本店の所在の場所】	東京都千代田区霞が関三丁目 2 番 1 号
【事務連絡者氏名】	植松 克彦
【電話番号】	03-6205-0200
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバルC B オープン・高金利通貨コース グローバルC B オープン・円コース グローバルC B オープン（マネープールファンド）
【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2月20日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正箇所および訂正事項】

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

(以下略)

2

為替取引手法の異なる2つの通貨コースとマネープールファンドがあり、各ファンド間でスイッチングが可能です。

- 高金利通貨コース、円コースの2つの通貨コースとマネープールファンドの3つのファンドから構成されています。

(高金利通貨コース)

(以下略)

<G20構成国・地域> (2017年12月末現在)

アルゼンチン、オーストラリア、ブラジル、カナダ、中国、EU(欧州連合)、フランス、ドイツ、インド、インドネシア、イタリア、日本、メキシコ、ロシア、サウジアラビア、南アフリカ、韓国、トルコ、イギリス、米国

(以下略)



注) 高金利通貨コースの3通貨は2017年12月末現在のものであり、今後市況動向等により取引対象通貨の見直しを行う場合があります。

(以下略)

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況 (平成29年12月末現在)

(以下略)

<訂正後>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

(以下略)

2

為替取引手法の異なる2つの通貨コースとマネープールファンドがあり、各ファンド間でスイッチングが可能です。

- 高金利通貨コース、円コースの2つの通貨コースとマネープールファンドの3つのファンドから構成されています。

(高金利通貨コース)

(以下略)

<G20構成国・地域> (2018年6月末現在)
 アルゼンチン、オーストラリア、ブラジル、カナダ、中国、EU(欧州連合)、フランス、ドイツ、インド、
 インドネシア、イタリア、日本、メキシコ、ロシア、サウジアラビア、南アフリカ、韓国、トルコ、
 イギリス、米国

(以下略)



注) 高金利通貨コースの3通貨は2018年6月末現在のものであり、今後市況動向等により取引対象通貨の見直しを行う場合があります。

(以下略)

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成30年6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12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12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6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6月末現在で約100名です。

（以下略）

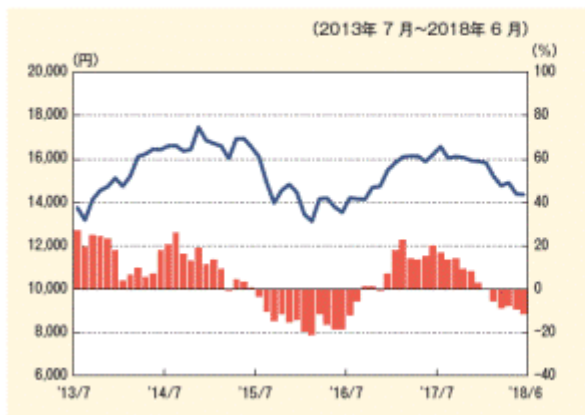
[次へ](#)

3 投資リスク

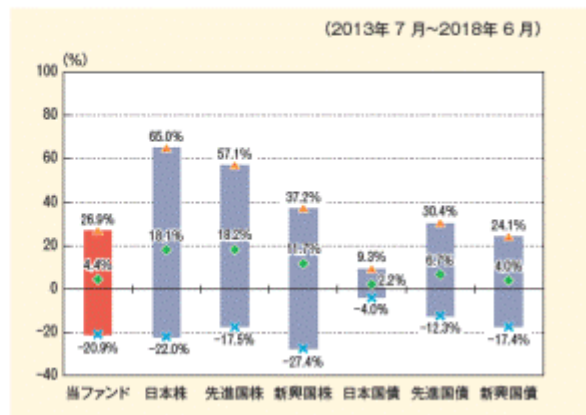
<参考情報>

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

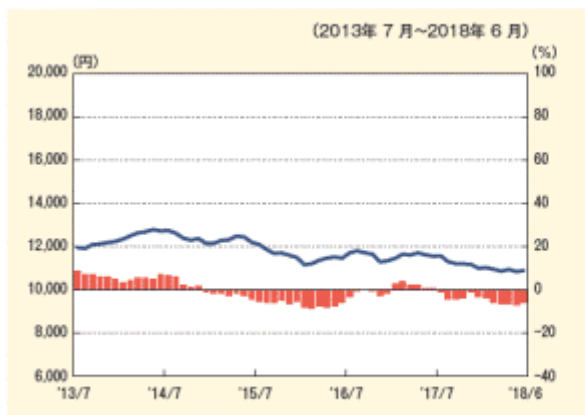
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移
高金利通貨コース



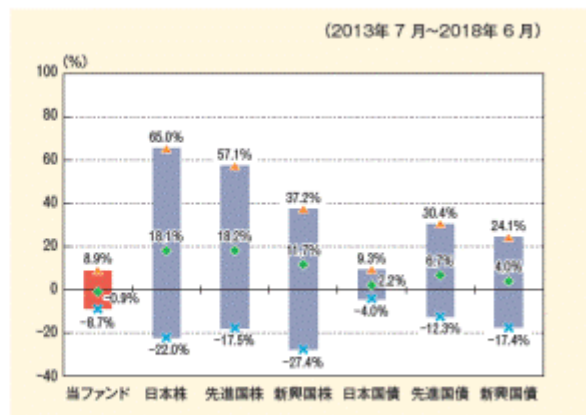
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較
高金利通貨コース



円コース



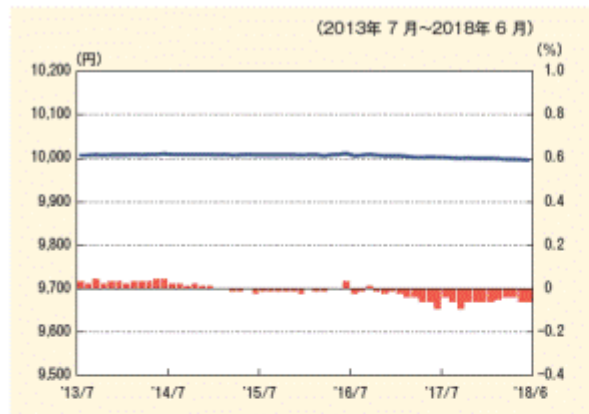
円コース



■ 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 マネーボールファンド

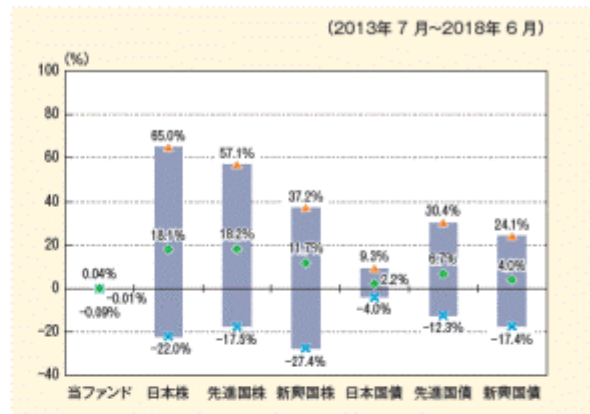


■ 年間騰落率 (右目盛) — 分配金再投資基準価額 (左目盛)

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 マネーボールファンド



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

<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX (配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI 国債	野村證券株式会社
先進国債	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12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6月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

[前へ](#) [次へ](#)

5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

グローバルC Bオープン・高金利通貨コース

(1)投資状況

(平成30年6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	608,827	0.03%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	2,280,919,526	98.64%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		30,740,910	1.33%
純資産総額		2,312,269,263	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6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	Global Convertible Bond Fund INR Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	1,416,726,883	0.6024 853,574,984	0.5919 838,560,642	- -	36.27%
2	Global Convertible Bond Fund AUD Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	1,194,350,434	0.6182 738,460,209	0.6057 723,418,057	- -	31.29%
3	Global Convertible Bond Fund BRL Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	4,605,642,713	0.1611 742,428,202	0.1561 718,940,827	- -	31.09%
4	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 -	598,533	1.0171 608,827	1.0172 608,827	- -	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	98.64%
親投資信託受益証券	0.03%
合計	98.67%

(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6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6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11月30日)	607	-	1.0000	-
第1特定期間末 (平成24年5月21日)	16,403	16,874	0.9966	1.0466
第2特定期間末 (平成24年11月19日)	26,966	28,233	1.0592	1.1192
第3特定期間末 (平成25年5月20日)	29,247	30,593	1.3810	1.4410
第4特定期間末 (平成25年11月19日)	22,467	23,652	1.1963	1.2563
第5特定期間末 (平成26年5月19日)	17,930	18,874	1.2782	1.3382
第6特定期間末 (平成26年11月19日)	15,803	16,573	1.2793	1.3393

第7特定期間末 (平成27年5月19日)	11,654	12,308	1.1907	1.2507
第8特定期間末 (平成27年11月19日)	7,225	7,719	0.9906	1.0506
第9特定期間末 (平成28年5月19日)	5,265	5,651	0.8588	0.9188
第10特定期間末 (平成28年11月21日)	4,367	4,698	0.8399	0.8999
第11特定期間末 (平成29年5月19日)	3,848	4,134	0.8573	0.9173
平成29年6月末日	3,790	-	0.8710	-
平成29年7月末日	3,777	-	0.8804	-
平成29年8月末日	3,551	-	0.8421	-
平成29年9月末日	3,462	-	0.8362	-
平成29年10月末日	3,367	-	0.8240	-
第12特定期間末 (平成29年11月20日)	3,219	3,472	0.7966	0.8566
平成29年11月末日	3,238	-	0.8071	-
平成29年12月末日	3,050	-	0.7946	-
平成30年1月末日	2,935	-	0.7818	-
平成30年2月末日	2,773	-	0.7435	-
平成30年3月末日	2,612	-	0.7156	-
平成30年4月末日	2,582	-	0.7151	-
第13特定期間末 (平成30年5月21日)	2,478	2,657	0.6924	0.7404
平成30年5月末日	2,428	-	0.6836	-
平成30年6月末日	2,312	-	0.6755	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(平成23年11月30日～平成24年5月21日)	0.0500
第2特定期間(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	0.0600
第3特定期間(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	0.0600
第4特定期間(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	0.0600
第5特定期間(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	0.0600
第6特定期間(平成26年5月20日～平成26年11月19日)	0.0600
第7特定期間(平成26年11月20日～平成27年5月19日)	0.0600
第8特定期間(平成27年5月20日～平成27年11月19日)	0.0600
第9特定期間(平成27年11月20日～平成28年5月19日)	0.0600
第10特定期間(平成28年5月20日～平成28年11月21日)	0.0600
第11特定期間(平成28年11月22日～平成29年5月19日)	0.0600
第12特定期間(平成29年5月20日～平成29年11月20日)	0.0600
第13特定期間(平成29年11月21日～平成30年5月21日)	0.0480

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(平成23年11月30日～平成24年5月21日)	4.7%
第2特定期間(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	12.3%
第3特定期間(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	36.0%
第4特定期間(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	9.0%
第5特定期間(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	11.9%
第6特定期間(平成26年5月20日～平成26年11月19日)	4.8%
第7特定期間(平成26年11月20日～平成27年5月19日)	2.2%
第8特定期間(平成27年5月20日～平成27年11月19日)	11.8%
第9特定期間(平成27年11月20日～平成28年5月19日)	7.2%
第10特定期間(平成28年5月20日～平成28年11月21日)	4.8%
第11特定期間(平成28年11月22日～平成29年5月19日)	9.2%
第12特定期間(平成29年5月20日～平成29年11月20日)	0.1%
第13特定期間(平成29年11月21日～平成30年5月21日)	7.1%

(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11月30日～平成24年5月21日)	17,535,522,237	1,075,519,893
第2特定期間(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	12,410,946,989	3,412,489,518
第3特定期間(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	13,175,094,033	17,455,541,825
第4特定期間(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	2,665,969,956	5,063,289,184
第5特定期間(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	1,458,289,223	6,211,691,624

第6特定期間（平成26年5月20日～平成26年11月19日）	2,637,128,789	4,310,984,250
第7特定期間（平成26年11月20日～平成27年5月19日）	457,185,625	3,023,258,342
第8特定期間（平成27年5月20日～平成27年11月19日）	198,754,497	2,691,799,046
第9特定期間（平成27年11月20日～平成28年5月19日）	154,558,266	1,317,596,262
第10特定期間（平成28年5月20日～平成28年11月21日）	110,427,789	1,041,368,618
第11特定期間（平成28年11月22日～平成29年5月19日）	108,980,278	819,978,218
第12特定期間（平成29年5月20日～平成29年11月20日）	121,406,254	569,309,026
第13特定期間（平成29年11月21日～平成30年5月21日）	75,963,843	537,587,847

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

グローバルC Bオープン・円コース

(1) 投資状況

（平成30年6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	841,994	0.02%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	4,257,141,214	97.62%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		102,741,908	2.36%
純資産総額		4,360,725,116	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6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	Global Convertible Bond Fund JPY Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	6,610,467,724	0.6503 4,298,787,164	0.6440 4,257,141,214	- -	97.62%
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 -	827,757	1.0171 841,994	1.0172 841,994	- -	0.02%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	97.62%
親投資信託受益証券	0.02%
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6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6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11月30日）	840	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成24年5月21日）	32,298	32,744	1.0393	1.0643
第2特定期間末 （平成24年11月19日）	50,248	51,406	1.0838	1.1138
第3特定期間末 （平成25年5月20日）	69,795	71,520	1.1314	1.1614
第4特定期間末 （平成25年11月19日）	57,667	59,369	1.0969	1.1269
第5特定期間末 （平成26年5月19日）	47,434	48,800	1.1149	1.1449

第6特定期間末 (平成26年11月19日)	34,654	35,752	1.0515	1.0815
第7特定期間末 (平成27年5月19日)	24,444	25,259	1.0292	1.0592
第8特定期間末 (平成27年11月19日)	16,535	17,134	0.9313	0.9613
第9特定期間末 (平成28年5月19日)	12,621	13,081	0.8853	0.9153
第10特定期間末 (平成28年11月21日)	10,188	10,570	0.8489	0.8789
第11特定期間末 (平成29年5月19日)	8,743	9,077	0.8419	0.8719
平成29年6月末日	8,319	-	0.8321	-
平成29年7月末日	7,667	-	0.8283	-
平成29年8月末日	7,242	-	0.8035	-
平成29年9月末日	6,887	-	0.7923	-
平成29年10月末日	6,620	-	0.7872	-
第12特定期間末 (平成29年11月20日)	6,343	6,614	0.7764	0.8064
平成29年11月末日	6,332	-	0.7798	-
平成29年12月末日	5,856	-	0.7627	-
平成30年1月末日	5,712	-	0.7596	-
平成30年2月末日	5,473	-	0.7515	-
平成30年3月末日	5,209	-	0.7421	-
平成30年4月末日	5,043	-	0.7448	-
第13特定期間末 (平成30年5月21日)	4,915	5,077	0.7369	0.7589
平成30年5月末日	4,860	-	0.7351	-
平成30年6月末日	4,360	-	0.7353	-

(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11月30日～平成24年5月21日)	0.0250
第2特定期間(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	0.0300
第3特定期間(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	0.0300
第4特定期間(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	0.0300
第5特定期間(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	0.0300
第6特定期間(平成26年5月20日～平成26年11月19日)	0.0300
第7特定期間(平成26年11月20日～平成27年5月19日)	0.0300
第8特定期間(平成27年5月20日～平成27年11月19日)	0.0300
第9特定期間(平成27年11月20日～平成28年5月19日)	0.0300
第10特定期間(平成28年5月20日～平成28年11月21日)	0.0300
第11特定期間(平成28年11月22日～平成29年5月19日)	0.0300
第12特定期間(平成29年5月20日～平成29年11月20日)	0.0300
第13特定期間(平成29年11月21日～平成30年5月21日)	0.0220

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(平成23年11月30日～平成24年5月21日)	6.4%
第2特定期間(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	7.2%
第3特定期間(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	7.2%
第4特定期間(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	0.4%
第5特定期間(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	4.4%
第6特定期間(平成26年5月20日～平成26年11月19日)	3.0%
第7特定期間(平成26年11月20日～平成27年5月19日)	0.7%
第8特定期間(平成27年5月20日～平成27年11月19日)	6.6%
第9特定期間(平成27年11月20日～平成28年5月19日)	1.7%
第10特定期間(平成28年5月20日～平成28年11月21日)	0.7%
第11特定期間(平成28年11月22日～平成29年5月19日)	2.7%
第12特定期間(平成29年5月20日～平成29年11月20日)	4.2%
第13特定期間(平成29年11月21日～平成30年5月21日)	2.3%

(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11月30日～平成24年5月21日)	32,509,196,361	1,430,942,682
第2特定期間(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	23,691,332,699	8,407,691,102
第3特定期間(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	33,795,805,804	18,470,374,109

第4特定期間(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	5,323,771,311	14,439,292,113
第5特定期間(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	2,481,448,202	12,506,961,189
第6特定期間(平成26年5月20日～平成26年11月19日)	1,991,498,129	11,579,578,603
第7特定期間(平成26年11月20日～平成27年5月19日)	191,122,976	9,397,718,303
第8特定期間(平成27年5月20日～平成27年11月19日)	94,556,004	6,091,524,022
第9特定期間(平成27年11月20日～平成28年5月19日)	402,757,778	3,899,960,325
第10特定期間(平成28年5月20日～平成28年11月21日)	70,246,320	2,325,486,153
第11特定期間(平成28年11月22日～平成29年5月19日)	61,782,498	1,678,534,978
第12特定期間(平成29年5月20日～平成29年11月20日)	59,239,242	2,274,421,412
第13特定期間(平成29年11月21日～平成30年5月21日)	38,885,320	1,537,998,839

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

グローバルC Bオープン(マネーパブルファンド)

(1)投資状況

(平成30年6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	8,822,780	100.00%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		39	0.00%
純資産総額		8,822,741	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6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	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 -	8,673,595	1.0173 8,823,649	1.0172 8,822,780	- -	100.00%

(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
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

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6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6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11月30日)	1	-	1.0000	-
第1計算期間末 (平成24年5月21日)	5	-	1.0003	-
第2計算期間末 (平成24年11月19日)	44	-	1.0005	-
第3計算期間末 (平成25年5月20日)	32	-	1.0006	-
第4計算期間末 (平成25年11月19日)	67	-	1.0008	-
第5計算期間末 (平成26年5月19日)	15	-	1.0009	-
第6計算期間末 (平成26年11月19日)	18	-	1.0009	-
第7計算期間末 (平成27年5月19日)	13	-	1.0009	-
第8計算期間末 (平成27年11月19日)	18	-	1.0008	-

第9計算期間末 (平成28年5月19日)	17	-	1.0009	-
第10計算期間末 (平成28年11月21日)	12	-	1.0006	-
第11計算期間末 (平成29年5月19日)	12	-	1.0001	-
平成29年6月末日	12	-	1.0002	-
平成29年7月末日	12	-	1.0002	-
平成29年8月末日	12	-	1.0001	-
平成29年9月末日	12	-	1.0000	-
平成29年10月末日	12	-	1.0001	-
第12計算期間末 (平成29年11月20日)	12	-	1.0002	-
平成29年11月末日	13	-	1.0000	-
平成29年12月末日	25	-	1.0000	-
平成30年1月末日	14	-	1.0000	-
平成30年2月末日	9	-	0.9999	-
平成30年3月末日	8	-	0.9998	-
平成30年4月末日	9	-	0.9998	-
第13計算期間末 (平成30年5月21日)	8	-	0.9997	-
平成30年5月末日	8	-	0.9997	-
平成30年6月末日	8	-	0.9996	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

期間	収益率
第1期(平成23年11月30日～平成24年5月21日)	0.0%
第2期(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	0.0%
第3期(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	0.0%
第4期(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	0.0%
第5期(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	0.0%
第6期(平成26年5月20日～平成26年11月19日)	0.0%
第7期(平成26年11月20日～平成27年5月19日)	0.0%
第8期(平成27年5月20日～平成27年11月19日)	0.0%
第9期(平成27年11月20日～平成28年5月19日)	0.0%
第10期(平成28年5月20日～平成28年11月21日)	0.0%
第11期(平成28年11月22日～平成29年5月19日)	0.0%
第12期(平成29年5月20日～平成29年11月20日)	0.0%
第13期(平成29年11月21日～平成30年5月21日)	0.0%

(注) 収益率 = (当計算期末分配付基準価額 - 前計算期末分配付基準価額) ÷ 前計算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期(平成23年11月30日～平成24年5月21日)	5,762,539	0
第2期(平成24年5月22日～平成24年11月19日)	46,474,208	7,721,318
第3期(平成24年11月20日～平成25年5月20日)	25,098,343	36,769,329
第4期(平成25年5月21日～平成25年11月19日)	107,880,652	73,345,831
第5期(平成25年11月20日～平成26年5月19日)	31,608,971	83,571,849
第6期(平成26年5月20日～平成26年11月19日)	16,072,533	13,391,017
第7期(平成26年11月20日～平成27年5月19日)	29,808,729	34,728,865
第8期(平成27年5月20日～平成27年11月19日)	18,494,045	13,197,298
第9期(平成27年11月20日～平成28年5月19日)	19,929,975	21,240,634
第10期(平成28年5月20日～平成28年11月21日)	4,242,051	8,988,214
第11期(平成28年11月22日～平成29年5月19日)	3,311,739	3,682,013
第12期(平成29年5月20日～平成29年11月20日)	26,291,744	25,836,711
第13期(平成29年11月21日～平成30年5月21日)	15,321,550	18,948,120

(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6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	302,245,600	6.75%
特殊債券	日本	1,863,266,598	41.62%
社債券	日本	703,595,400	15.72%

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,607,346,360	35.91%
純資産総額	4,476,453,958	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6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	100.01 650,128,700	0.2450 2018/07/30	14.52%
2	67 政保道路機構 日本	特殊債券 -	390,000,000	101.15 394,500,600	100.55 392,173,080	1.6000 2018/10/31	8.76%
3	64 政保道路機構 日本	特殊債券 -	319,000,000	101.59 324,078,480	100.27 319,881,078	1.6000 2018/08/29	7.15%
4	66 政保道路機構 日本	特殊債券 -	210,000,000	100.96 212,018,100	100.37 210,791,490	1.5000 2018/09/28	4.71%
5	304 北海道電力 日本	社債券 -	100,000,000	101.63 101,637,000	101.38 101,389,700	1.7030 2019/04/25	2.26%
6	7 西日本旅客鉄道 日本	社債券 -	100,000,000	101.29 101,294,000	101.15 101,156,000	2.4100 2018/12/25	2.26%
7	71 共同発行地方 日本	地方債証券 -	100,000,000	101.34 101,348,000	100.98 100,989,600	1.5100 2019/02/25	2.26%
8	20-16 兵庫県公債 日本	地方債証券 -	100,000,000	101.13 101,134,000	100.89 100,899,100	1.6000 2019/01/23	2.25%
9	357 中国電力 日本	社債券 -	100,000,000	100.54 100,542,000	100.38 100,386,900	1.6580 2018/09/25	2.24%
10	467 関西電力 日本	社債券 -	100,000,000	100.74 100,743,000	100.36 100,366,700	1.6700 2018/09/20	2.24%
11	464 名古屋市債 日本	地方債証券 -	100,000,000	100.72 100,725,000	100.35 100,356,900	1.6100 2018/09/20	2.24%
12	10 小松製作所 日本	社債券 -	100,000,000	100.27 100,270,000	100.25 100,254,500	0.2750 2019/06/20	2.24%
13	18 政保政策投資C 日本	特殊債券 -	100,000,000	100.25 100,257,000	100.15 100,151,800	0.2400 2019/01/21	2.24%
14	41 鹿島建設 日本	社債券 -	100,000,000	100.16 100,167,000	100.03 100,038,400	0.7100 2018/07/19	2.23%
15	37 三菱UFJリース 日本	社債券 -	100,000,000	100.04 100,048,000	100.00 100,003,200	0.0700 2019/02/21	2.23%
16	55 日本政策金融 日本	特殊債券 -	100,000,000	100.00 100,007,000	100.00 100,000,500	0.0010 2018/08/09	2.23%
17	62 政保道路機構 日本	特殊債券 -	90,000,000	100.18 90,170,100	100.15 90,139,950	1.7000 2018/07/31	2.01%

(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
特殊債券	41.62%
社債券	15.72%
地方債証券	6.75%
合計	64.09%

(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6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6月末現在)

該当事項はありません。

(参考情報)

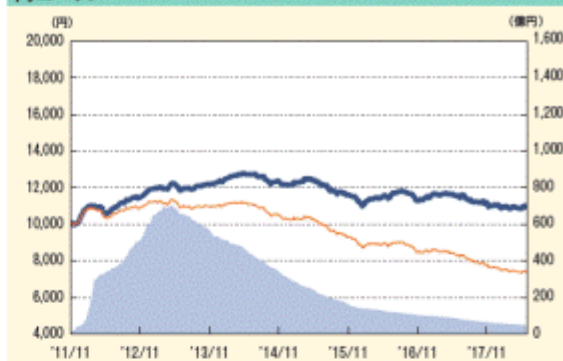
2018年6月29日 現在

基準価額・純資産の推移 (設定日～2018年6月29日)

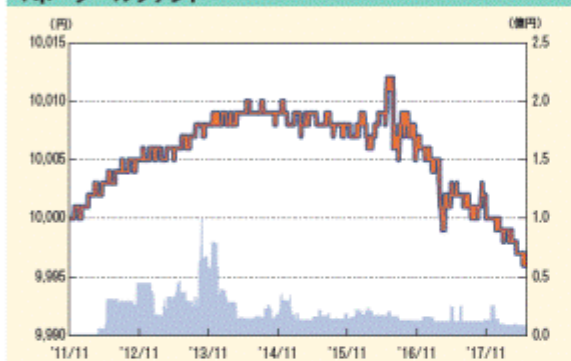
高金利通貨コース



円コース



マネーボールファンド



- 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

	高金利通貨コース	円コース
2018年 6月	70円	30円
2018年 5月	70円	30円
2018年 4月	70円	30円
2018年 3月	70円	30円
2018年 2月	70円	30円
直近1年間累計	1,050円	500円
設定来累計	7,650円	3,800円

* 分配金は1万円当たり、税引前

	マネーボールファンド
2018年 5月	0円
2017年11月	0円
2017年 5月	0円
2016年11月	0円
2016年 5月	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

高金利通貨コース

投資銘柄	投資比率
Global Convertible Bond Fund INR Class	36.3%
Global Convertible Bond Fund AUD Class	31.3%
Global Convertible Bond Fund BRL Class	31.1%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.0%

マネーボールファンド

投資銘柄	投資比率
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	100.0%

*投資比率は全て純資産総額対比

円コース

投資銘柄	投資比率
Global Convertible Bond Fund JPY Class	97.6%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.0%

■ 参考情報（上位10銘柄）

グローバル・コンバーティブル・ボンド・ファンド

	投資銘柄	国名	クーポン	償還日	業種	投資比率
1	AABAR INVESTMENTS PJSC	アラブ首長国	0.500%	2020/3/27	銀行	3.8%
2	ICHOR COAL NV	南アフリカ	5.000%	2019/6/7	エネルギー	3.8%
3	SHIP FINANCE INTL LTD	ノルウェー	5.750%	2021/10/15	エネルギー	3.7%
4	CTRIIP.COM INTL LTD	中国	1.990%	2025/7/1	小売	2.4%
5	HELICAL BAR JERSEY LTD	英国	4.000%	2019/6/17	不動産	2.2%
6	DEUTSCHE WOHNEN SE	ドイツ	0.325%	2024/7/26	不動産	2.1%
7	J SAINSBURY PLC	英国	2.875%	2021/7/30	食品・生活必需品小売り	2.0%
8	TESLA INC	米国	1.250%	2021/3/1	自動車・自動車部品	1.9%
9	FIREEYE INC	米国	1.625%	2035/6/1	ソフトウェア・サービス	1.9%
10	CHINA RAILWAY CONSTRUCT	中国	1.500%	2021/12/21	資本財	1.9%

*投資比率はグローバル・コンバーティブル・ボンド・ファンドの純資産総額対比

*業種は世界産業分類基準（GICS）

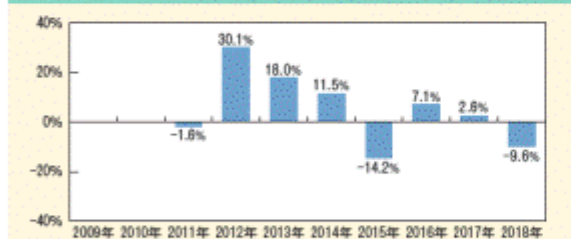
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

	投資銘柄	種別	投資比率
1	6 政保地方公共6年	特殊債券	14.5%
2	67 政保道路機構	特殊債券	8.8%
3	64 政保道路機構	特殊債券	7.1%
4	66 政保道路機構	特殊債券	4.7%
5	304 北海道電力	社債券	2.3%
6	7 西日本旅客鉄道	社債券	2.3%
7	71 共同発行地方	地方債証券	2.3%
8	20-16 兵庫県公債	地方債証券	2.3%
9	357 中国電力	社債券	2.2%
10	467 関西電力	社債券	2.2%

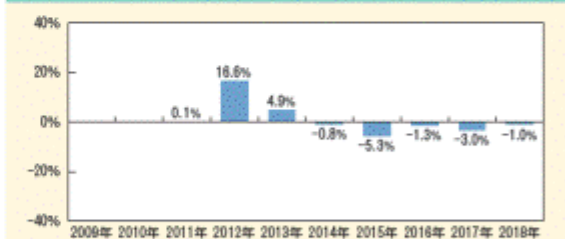
*投資比率はキャッシュ・マネジメント・マザーファンドの純資産総額対比

年間収益率の推移

高金利通貨コース



円コース



マネーボールファンド



*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11月30日）から年末までの収益率、2018年は6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。

グローバルC B オープン・高金利通貨コース

グローバルC B オープン・円コース

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11月21日から平成30年5月21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。

グローバルC B オープン（マネープールファンド）

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. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成29年11月21日から平成30年5月21日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

1 財務諸表

グローバルC Bオープン・高金利通貨コース

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成29年11月20日現在 金額（円）	当期 平成30年5月21日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	94,554,853	65,202,017
投資信託受益証券	3,169,949,320	2,443,905,886
親投資信託受益証券	609,127	608,887
未収入金	1,483,143	4,171,146
流動資産合計	3,266,596,443	2,513,887,936
資産合計	3,266,596,443	2,513,887,936
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	40,414,381	25,058,698
未払解約金	3,517,912	7,730,714
未払受託者報酬	79,735	60,611
未払委託者報酬	3,030,206	2,303,364
その他未払費用	188,283	145,407
流動負債合計	47,230,517	35,298,794
負債合計	47,230,517	35,298,794
純資産の部		
元本等		
元本	4,041,438,130	3,579,814,126
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	822,072,204	1,101,224,984
（分配準備積立金）	1,632,988,196	1,764,948,581
元本等合計	3,219,365,926	2,478,589,142
純資産合計	3,219,365,926	2,478,589,142
負債純資産合計	3,266,596,443	2,513,887,936

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日 金額（円）	当期 自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	539,571,541	557,149,213
受取利息	295	168
有価証券売買等損益	515,294,904	748,053,655
営業収益合計	24,276,932	190,904,274
営業費用		
支払利息	23,861	17,756

受託者報酬	495,691	382,742
委託者報酬	18,838,042	14,545,423
その他費用	188,283	145,650
営業費用合計	19,545,877	15,091,571
営業利益又は営業損失()	4,731,055	205,995,845
経常利益又は経常損失()	4,731,055	205,995,845
当期純利益又は当期純損失()	4,731,055	205,995,845
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()	56,906	61,762
期首剰余金又は期首欠損金()	640,487,638	822,072,204
剰余金増加額又は欠損金減少額	83,942,243	123,983,952
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	83,942,243	123,983,952
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,375,648	17,916,884
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,375,648	17,916,884
分配金	252,825,310	179,285,765
期末剰余金又は期末欠損金()	822,072,204	1,101,224,984

[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11月21日	至 平成30年5月21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。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末及び当計算期末が休日のため、平成29年11月21日から平成30年5月21日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成29年11月20日現在	平成30年5月21日現在
1. 元本状況		
期首元本額	4,489,340,902円	4,041,438,130円
期中追加設定元本額	121,406,254円	75,963,843円
期中一部解約元本額	569,309,026円	537,587,847円
2. 受益権の総数	4,041,438,130口	3,579,814,126口
3. 元本の欠損	822,072,204円	1,101,224,984円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期		当期																															
自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日		自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日																															
分配金の計算過程 第66期計算期間末（平成29年6月19日）に、投資信託約款に基づき計算した3,024,209,326円（1万口当たり6,875.10円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い143,987,827円（1万口当たり100円）を分配しております。		分配金の計算過程 第72期計算期間末（平成29年12月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,962,582,338円（1万口当たり7,539.87円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い139,292,223円（1万口当たり100円）を分配しております。																															
<table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td>85,901,372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>1,407,513,739円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,530,794,215円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>3,024,209,326円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（6,875.10円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>43,987,827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）	85,901,372円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,407,513,739円	分配準備積立金	1,530,794,215円	分配可能額	3,024,209,326円	（1万口当たり分配可能額）	（6,875.10円）	収益分配金	43,987,827円	（1万口当たり収益分配金）	（100円）	<table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td>87,824,898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>1,292,533,232円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,582,224,208円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>2,962,582,338円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（7,539.87円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>39,292,223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）	87,824,898円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,292,533,232円	分配準備積立金	1,582,224,208円	分配可能額	2,962,582,338円	（1万口当たり分配可能額）	（7,539.87円）	収益分配金	39,292,223円	（1万口当たり収益分配金）	（100円）
配当等収益 （費用控除後）	85,901,372円																																
有価証券売買等損益	0円																																
収益調整金	1,407,513,739円																																
分配準備積立金	1,530,794,215円																																
分配可能額	3,024,209,326円																																
（1万口当たり分配可能額）	（6,875.10円）																																
収益分配金	43,987,827円																																
（1万口当たり収益分配金）	（100円）																																
配当等収益 （費用控除後）	87,824,898円																																
有価証券売買等損益	0円																																
収益調整金	1,292,533,232円																																
分配準備積立金	1,582,224,208円																																
分配可能額	2,962,582,338円																																
（1万口当たり分配可能額）	（7,539.87円）																																
収益分配金	39,292,223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19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,994,918,707円（1万口当たり6,978.89円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い142,913,980円（1万口当たり100円）を分配しております。		第73期計算期間末（平成30年1月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,903,942,616円（1万口当たり7,668.80円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い137,866,972円（1万口当たり100円）を分配しております。																															
<table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td>87,449,996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>1,378,234,219円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,529,234,492円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>2,994,918,707円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（6,978.89円）</td></tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	87,449,996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	1,378,234,219円	分配準備積立金	1,529,234,492円	分配可能額	2,994,918,707円	（1万口当たり分配可能額）	（6,978.89円）	<table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td>86,684,491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>1,251,303,412円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,565,954,713円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>2,903,942,616円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（7,668.80円）</td></tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	86,684,491円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,251,303,412円	分配準備積立金	1,565,954,713円	分配可能額	2,903,942,616円	（1万口当たり分配可能額）	（7,668.80円）								
配当等収益 （費用控除後）	87,449,996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	1,378,234,219円																																
分配準備積立金	1,529,234,492円																																
分配可能額	2,994,918,707円																																
（1万口当たり分配可能額）	（6,978.89円）																																
配当等収益 （費用控除後）	86,684,491円																																
有価証券売買等損益	0円																																
収益調整金	1,251,303,412円																																
分配準備積立金	1,565,954,713円																																
分配可能額	2,903,942,616円																																
（1万口当たり分配可能額）	（7,668.80円）																																

収益分配金	42,913,980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21日）に、投資信託約款に基づき計算した3,001,045,074円（1万口当たり7,080.79円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い42,382,883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）	85,544,676円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,372,294,662円
分配準備積立金	1,543,205,736円
分配可能額	3,001,045,074円
（1万口当たり分配可能額）	(7,080.79円)
収益分配金	42,382,883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19日）に、投資信託約款に基づき計算した3,013,704,919円（1万口当たり7,188.22円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い41,925,585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）	86,966,012円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,362,263,469円
分配準備積立金	1,564,475,438円
分配可能額	3,013,704,919円
（1万口当たり分配可能額）	(7,188.22円)
収益分配金	41,925,585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19日）に、投資信託約款に基づき計算した3,007,628,009円（1万口当たり7,299.95円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い41,200,654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）	87,233,039円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,343,435,086円
分配準備積立金	1,576,959,884円
分配可能額	3,007,628,009円
（1万口当たり分配可能額）	(7,299.95円)
収益分配金	41,200,654円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第71期計算期間末（平成29年11月20日）に、投資信託約款に基づき計算した2,997,272,217円（1万口当たり7,416.35円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い40,414,381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）	87,455,173円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,323,869,640円
分配準備積立金	1,585,947,404円
分配可能額	2,997,272,217円
（1万口当たり分配可能額）	(7,416.35円)
収益分配金	40,414,381円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

収益分配金	37,866,972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19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,919,783,187円（1万口当たり7,801.75円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い26,197,303円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	87,178,157円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,243,945,464円
分配準備積立金	1,588,659,566円
分配可能額	2,919,783,187円
（1万口当たり分配可能額）	(7,801.75円)
収益分配金	26,197,303円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第75期計算期間末（平成30年3月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,912,956,769円（1万口当たり7,978.43円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い25,557,265円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	90,056,003円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,218,653,682円
分配準備積立金	1,604,247,084円
分配可能額	2,912,956,769円
（1万口当たり分配可能額）	(7,978.43円)
収益分配金	25,557,265円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第76期計算期間末（平成30年4月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,952,366,121円（1万口当たり8,164.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い25,313,304円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	92,527,580円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,211,340,141円
分配準備積立金	1,648,498,400円
分配可能額	2,952,366,121円
（1万口当たり分配可能額）	(8,164.31円)
収益分配金	25,313,304円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第77期計算期間末（平成30年5月21日）に、投資信託約款に基づき計算した2,993,595,051円（1万口当たり8,362.43円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い25,058,698円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	95,982,130円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,203,587,772円
分配準備積立金	1,694,025,149円
分配可能額	2,993,595,051円
（1万口当たり分配可能額）	(8,362.43円)
収益分配金	25,058,698円
（1万口当たり収益分配金）	(70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11月21日 至 平成30年5月21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5月21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11月20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	60
投資信託受益証券	193,357,502
合計	193,357,442

当期（平成30年5月21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	-
投資信託受益証券	174,394,735
合計	174,394,735

（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11月20日現在）

該当事項はありません。

当期（平成30年5月21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11月21日 至平成30年5月21日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成29年11月20日現在	当期 平成30年5月21日現在
1口当たり純資産額 0.7966円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,966円）」	1口当たり純資産額 0.6924円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,924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	Global Convertible Bond Fund AUD Class	1,244,520,121	782,678,704	
	投資信託受益証券	Global Convertible Bond Fund BRL Class	4,456,601,426	777,676,948	

投資信託受益証券	Global Convertible Bond Fund INR Class	1,455,361,942	883,550,234	
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	598,533	608,887	
合計	4 銘柄	7,157,082,022	2,444,514,773	

[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11月20日現在 金額（円）	平成30年5月21日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	691,367,421	1,578,482,221
地方債証券	6,002,940	302,753,000
特殊債券	1,888,577,543	1,814,898,693
社債券	802,543,400	602,416,000
未収利息	10,220,760	6,157,041
前払費用	1,590,763	1,987,671
流動資産合計	3,400,302,827	4,306,694,626
資産合計	3,400,302,827	4,306,694,626
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,804,551	6,146,513
その他未払費用	-	1,716
流動負債合計	6,804,551	6,148,229
負債合計	6,804,551	6,148,229
純資産の部		
元本等		
元本	3,334,461,429	4,227,483,512
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	59,036,847	73,062,885
元本等合計	3,393,498,276	4,300,546,397
純資産合計	3,393,498,276	4,300,546,397
負債純資産合計	3,400,302,827	4,306,694,626

[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11月21日 至 平成30年 5月21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	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	平成29年11月20日現在	平成30年 5月21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	3,700,010,033円	3,334,461,429円
期中追加設定元本額	3,430,354,059円	2,764,307,123円
期中一部解約元本額	3,795,902,663円	1,871,285,040円
元本の内訳		
S M B C ファンドラップ・G-REIT	-	944,018円
S M B C ファンドラップ・ヘッジファンド	208,395,494円	247,672,847円
S M B C ファンドラップ・欧州株	67,743,268円	78,171,051円
S M B C ファンドラップ・新興国株	49,668,612円	37,773,954円
S M B C ファンドラップ・コモディティ	18,290,563円	22,721,525円
S M B C ファンドラップ・米国債	81,385,472円	103,583,087円
S M B C ファンドラップ・欧州債	68,823,413円	76,794,952円
S M B C ファンドラップ・新興国債	35,895,350円	46,252,476円
S M B C ファンドラップ・日本グロース株	115,147,053円	135,520,196円
S M B C ファンドラップ・日本中小型株	27,665,572円	31,374,384円
S M B C ファンドラップ・日本債	732,500,345円	910,698,082円
D C 日本国債プラス	-	856,840,525円
エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）	98,347,664円	81,084,143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）	335,837,278円	283,497,029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）	12,775,756円	13,312,269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）	342,622,566円	433,438,218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）	15,096,906円	11,763,562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）	232,209,893円	223,039,949円
エマージング・ボンド・ファンド（マネー・プールファンド）	333,937,948円	258,876,562円
大和住銀 中国株式ファンド（マネー・ポートフォリオ）	140,363,394円	152,804,588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	3,268,121円	3,226,380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）	1,950,701円	2,151,042円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（円コース）	1,574,779円	1,302,826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）	1,531,131円	1,237,465円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（BRICs通貨コース）	2,275,436円	1,421,644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）	9,219,608円	6,078,415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	27,988,536円	27,072,169円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・円コース	2,281,710円	2,014,473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	1,037,539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 2 2 5 ・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（マネーボールファンド）	12,287,550円	8,723,043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）	380,552円	463,230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）	5,795,435円	5,071,265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	3,334,461,429円	4,227,483,512円
2. 受益権の総数	3,334,461,429口	4,227,483,512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11月21日 至 平成30年 5月21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 5月21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11月20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	960
特殊債証券	8,691,642
社債証券	2,304,200
合計	10,994,882

「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11月20日まで）を指しております。

（平成30年5月21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	454,000
特殊債証券	7,192,887
社債証券	2,414,000
合計	10,060,887

「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5月21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11月20日現在）

該当事項はありません。

（平成30年5月21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11月21日 至 平成30年5月21日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成29年11月20日現在	平成30年5月21日現在
1口当たり純資産額 1.0177円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,177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	20-16 兵庫県公債	100,000,000	101,071,400	
	地方債証券	71 共同発行地方	100,000,000	101,152,900	
	地方債証券	464 名古屋市債	100,000,000	100,528,700	
	特殊債証券	18 政保政策投資C	100,000,000	100,171,400	
	特殊債証券	64 政保道路機構	319,000,000	320,428,163	
	特殊債証券	66 政保道路機構	210,000,000	211,132,320	
	特殊債証券	67 政保道路機構	390,000,000	392,804,100	
	特殊債証券	886 政保公営企業	40,000,000	40,054,560	
	特殊債証券	6政保地方公共6年	650,000,000	650,316,550	
	特殊債証券	55 日本政策金融	100,000,000	99,991,600	
	社債証券	41 鹿島建設	100,000,000	100,105,500	
	社債証券	3 セブンアンドアイ	100,000,000	100,155,000	
	社債証券	25 ホンダファイナンス	100,000,000	100,036,800	
	社債証券	48 野村ホールディング	100,000,000	100,000,200	
	社債証券	467 関西電力	100,000,000	100,548,400	
	社債証券	304 北海道電力	100,000,000	101,570,100	
	合計	16銘柄	2,709,000,000	2,720,067,693	

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「Global Convertible Bond Fund AUD Class」、「Global Convertible Bond Fund BRL Class」および「Global Convertible Bond Fund INR 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ます。

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11月30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」および「有価証券明細表」等は、「Global Convertible Bond Fund」の2017年11月30日現在の財務諸表の原文を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

貸借対照表

2017年11月30日現在

(米ドルで表示)

資産の部

有価証券（公正価値）（取得原価 USD 98,700,203）	USD	83,304,355
現金		1,879
外国為替予約取引に係る評価益		744,617
未収入金：		
有価証券売却分		121,071
利息		341,203
資産 合計		84,513,125

負債の部

外国為替予約取引に係る評価損		267,711
受入証拠金		170,000
カストディアン宛未払い金		71
未払金：		
有価証券購入分		119,235
受益証券買戻分		220,470
未払運用報酬		89,923
専門家報酬		71,823
カストディーフィー		28,711
管理会社報酬		13,541
名義書換代理人報酬		6,665
為替管理報酬		3,279
負債 合計		991,429

純資産

	USD	83,521,696
Class A - AUD Class	USD	8,761,951
Class B - BRL Class		9,637,616
Class C - INR Class		9,922,621
Class D - JPY Class		55,199,508
	USD	83,521,696

発行済み受益証券

Class A - AUD Class	1,375,570,116
Class B - BRL Class	3,589,880,263
Class C - INR Class	1,516,500,355
Class D - JPY Class	8,762,687,040

受益証券一口あたりの純資産

Class A - AUD Class	USD	0.0064
Class B - BRL Class	USD	0.0027
Class C - INR Class	USD	0.0065
Class D - JPY Class	USD	0.0063

損益計算書(2017年11月30日に終了した年度)**(米ドルで表示)****収益**

受取利息	USD	3,538,442
受取配当金(源泉税 USD (368)控除後)		241,868
収益 合計		3,780,310

費用

運用報酬	667,789
専門家報酬	205,795
カストディーフィー	83,456
管理会社報酬	39,863
名義書換代理人報酬	18,548
受託会社報酬	13,015
為替管理報酬	10,771
ファンド設立費用	5,045
その他費用	8,872
費用 合計	1,053,154

純利益**2,727,156****実現及び未実現(損)益:****実現損:**

有価証券	(1,706,422)
外国為替取引及び外国為替予約取引	(485,496)
実現損 合計	(2,191,918)

未実現益の変動:

有価証券	3,217,668
外国為替取引及び外国為替予約取引	1,665,237

未実現益の変動 合計		4,882,905
実現及び未実現益 合計		2,690,987
運用による純資産の増額	USD	5,418,143
純資産変動計算書（2017年11月30日に終了した年度）		（米ドルで表示）
運用による純資産の増（減）額		
純益	USD	2,727,156
実現損		(2,191,918)
未実現益の変動額		4,882,905
運用による純資産の増額		5,418,143
受益者への分配額		(17,777,769)
ファンドの受益証券の取引による純資産の減額		(30,115,476)
純資産の減額		(42,475,102)
純資産		
期首		125,996,798
期末	USD	83,521,696

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](#)

有価証券明細表（2017年11月30日現在）

額面	銘柄名	公正価値
	固定利付証券 (93.2%)	(USD)
	オーストラリア (3.0%)	
	転換社債券 (3.0%)	
	Paladin Energy, Ltd.	
USD 5,951,000	7.00% due 03/31/20	2,487,518
	転換社債券 計	2,487,518
	オーストラリア 計 (取得原価USD 5,841,223)	2,487,518
	オーストリア (3.2%)	
	転換社債券 (3.2%)	
	Steinhoff Finance Holding GmbH	
EUR 1,700,000	1.25% due 10/21/23	1,710,277
EUR 700,000	4.00% due 01/30/21	944,192
	転換社債券 計	2,654,469
	オーストリア 計 (取得原価USD 2,894,627)	2,654,469
	ベルギー (0.2%)	
	転換社債券 (0.2%)	
	Ablynx NV	
EUR 100,000	3.25% due 05/27/20	185,410
	転換社債券 計	185,410
	ベルギー 計 (取得原価USD 165,116)	185,410

中国 (8.4%)**轉換社債券 (8.4%)**

		China Railway Construction Corp. Ltd.	
CNY	6,000,000	1.50% due 12/21/21	872,222
		China Yangtze Power International BVI 1 Ltd.	
USD	650,000	0.00% due 11/09/21	698,181
		CRRC Corp. Ltd.	
USD	750,000	0.00% due 02/05/21	776,625
		Ctrip.com International, Ltd.	
USD	1,300,000	1.99% due 07/01/25	1,479,562
		Harvest International Co.	
HKD	7,000,000	0.00% due 11/21/22	895,144
		Kunlun Energy Co. Ltd.	
CNH	3,000,000	1.63% due 07/25/19	481,967
		Semiconductor Manufacturing International Corp.	
USD	250,000	0.00% due 07/07/22	319,375
		Shanghai Port Group BVI Holding Co. Ltd.	
USD	858,000	0.00% due 08/09/21	858,429
		Strategic International Group, Ltd.	
EUR	200,000	0.00% due 07/21/22	284,375
		Zhejiang Expressway Co. Ltd.	
EUR	300,000	0.00% due 04/21/22	356,990
		轉換社債券 計	7,022,870
		中国 計 (取得原価USD 7,221,805)	7,022,870

フランス (2.8%)**轉換社債券 (2.8%)**

		Archer Obligations S.A.	
EUR	300,000	0.00% due 03/31/23	384,533
		Carrefour S.A.	
USD	400,000	0.00% due 06/14/23	367,200
		Cie Generale des Etablissements Michelin	
USD	400,000	0.00% due 01/10/22	431,800
		Elis S.A.	
EUR	257,985	0.00% due 10/06/23	324,510
		Genfit	
EUR	221,023	3.50% due 10/16/22	262,914

額面	銘柄名	公正価値
	固定利付証券 (93.2%) (続き)	(USD)
	フランス (2.8%) (続き)	
	転換社債券 (2.8%) (続き)	
	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	
USD	470,000 0.00% due 02/16/21	580,920
	転換社債券 計	2,351,877
	フランス 計 (取得原価USD 2,340,648)	2,351,877
	ドイツ (3.3%)	
	転換社債券 (3.3%)	
	Deutsche Wohnen SE	
EUR	1,000,000 0.33% due 07/26/24	1,270,449
	Fresenius SE & Co. KGaA	
EUR	900,000 0.00% due 01/31/24	1,070,432

		Symrise AG		
EUR	300,000	0.24% due 06/20/24		405,280
		転換社債券 計		2,746,161
		ドイツ 計 (取得原価USD 2,679,212)		2,746,161
		香港 (3.2%)		
		転換社債券 (3.2%)		
		Bagan Capital, Ltd.		
USD	937,000	0.00% due 09/23/21		995,094
		Baosteel Hong Kong Investment Co. Ltd.		
USD	350,000	0.00% due 12/01/18		369,469
		China Overseas Finance Investment Cayman V, Ltd.		
USD	1,000,000	0.00% due 01/05/23		1,048,500
		PB Issuer No 4 Ltd.		
USD	300,000	3.25% due 07/03/21		298,350
		転換社債券 計		2,711,413
		香港 計 (取得原価USD 2,656,212)		2,711,413
		インド (1.5%)		
		転換社債券 (1.5%)		
		Jaiprakash Power Ventures, Ltd.		
USD	10,250,000	7.00% due 02/13/49 ^(a)		1,273,050
		転換社債券 計		1,273,050
		インド 計 (取得原価USD 11,339,052)		1,273,050
		イタリア (0.4%)		

転換社債券 (0.4%)

		Snam SpA		
EUR	300,000	0.00% due 03/20/22		375,769

転換社債券 計**375,769****イタリア 計 (取得原価USD 369,130)****375,769****日本 (10.8%)****転換社債券 (9.7%)**

		AEON Financial Service Co. Ltd.		
JPY	20,000,000	0.00% due 09/13/19		195,791
		ANA Holdings, Inc.		
JPY	90,000,000	0.00% due 09/19/24		856,530
		Ezaki Glico Co. Ltd.		
JPY	20,000,000	0.00% due 01/30/24		189,446
		Gunma Bank, Ltd.		
USD	300,000	0.00% due 10/11/19		312,375
		Kansai Paint Co. Ltd.		
JPY	100,000,000	0.00% due 06/17/22		993,030
		Kyushu Electric Power Co., Inc.		
JPY	100,000,000	0.00% due 03/31/22		946,115
		Mitsubishi Chemical Holdings Corp.		
JPY	120,000,000	0.00% due 03/29/24		1,229,168
		Mitsui OSK Lines, Ltd.		
USD	500,000	0.00% due 04/24/20		482,938
		SBI Holdings, Inc.		
JPY	20,000,000	0.00% due 09/14/22		221,393

額面 銘柄名**公正価値**

固定利付証券 (93.2%) (続き)		(USD)
日本 (10.8%) (続き)		
転換社債券 (9.7%) (続き)		
Sony Corp.		
JPY 80,000,000	0.00% due 09/30/22	893,615
Terumo Corp.		
JPY 80,000,000	0.00% due 12/06/21	1,013,181
Yamaguchi Financial Group, Inc.		
USD 700,000	0.83% due 03/26/20 ^(b)	734,300
転換社債券 計		8,067,882
社債券 (1.1%)		
Kawasaki Kisen Kaisha, Ltd.		
100,000,000	0.00% due 09/26/18	925,785
社債券 計		925,785
日本 計 (取得原価USD 8,767,412)		8,993,667
ルクセンブルグ(0.6%)		
社債券 (0.6%)		
Oryx S.A.		
USD 500,000	2.92% due 09/11/18 ^(b)	500,800
社債券 計		500,800
ルクセンブルグ 計 (取得原価USD 492,911)		500,800
マレーシア (2.1%)		
転換社債券 (2.1%)		

		Cahaya Capital, Ltd.	
USD	1,115,000	0.00% due 09/18/21	1,109,565
		Indah Capital, Ltd.	
SGD	850,000	0.00% due 10/24/18	651,698
		転換社債券 計	1,761,263
		マレーシア 計 (取得原価USD 1,744,546)	1,761,263
		オランダ (2.6%)	
		転換社債券 (2.6%)	
		Ichor Coal NV	
EUR	4,100,000	5.00% due 06/07/19	2,130,223
		転換社債券 計	2,130,223
		オランダ 計 (取得原価USD 5,802,191)	2,130,223
		ノルウェー (4.8%)	
		転換社債券 (4.8%)	
		Marine Harvest ASA	
EUR	500,000	0.13% due 11/05/20	698,031
		Ship Finance International, Ltd.	
USD	3,100,000	5.75% due 10/15/21	3,307,313
		転換社債券 計	4,005,344
		ノルウェー 計 (取得原価USD 3,828,746)	4,005,344
		フィリピン (1.0%)	
		転換社債券 (1.0%)	
		AYC Finance, Ltd.	
USD	750,000	0.50% due 05/02/19	822,187

転換社債券 計	822,187
----------------	----------------

フィリピン (取得原価USD 825,938)	822,187
-------------------------	---------

シンガポール (2.9%)

転換社債券 (2.9%)

CapitalLand, Ltd.

SGD	2,000,000	1.85% due 06/19/20	1,469,191
-----	-----------	--------------------	-----------

Suntec Real Estate Investment Trust

SGD	500,000	1.75% due 09/05/21	381,403
-----	---------	--------------------	---------

SGD	750,000	1.75% due 11/30/24	555,050
-----	---------	--------------------	---------

転換社債券 計	2,405,644
----------------	------------------

シンガポール 計 (取得原価USD 2,489,494)	2,405,644
------------------------------	-----------

額面	銘柄名	公正価値
----	-----	------

固定利付証券 (93.2%) (続き)	(USD)
---------------------	-------

南アフリカ (0.3%)

転換社債券 (0.3%)

Remgro Jersey GBP, Ltd.

GBP	200,000	2.63% due 03/22/21	263,244
-----	---------	--------------------	---------

転換社債券 計	263,244
----------------	----------------

南アフリカ 計 (取得原価USD 265,442)	263,244
---------------------------	---------

スペイン (0.6%)

転換社債券 (0.6%)

	Telefonica Participaciones SAU		
EUR	400,000	0.00% due 03/09/21	475,185
	転換社債券 計		475,185
	スペイン 計 (取得原価USD 471,331)		475,185
	スウェーデン (0.4%)		
	転換社債券 (0.4%)		
	Recipharm AB		
SEK	3,000,000	2.75% due 10/06/21	344,315
	転換社債券 計		344,315
	スウェーデン 計 (取得原価USD 358,942)		344,315
	台湾 (3.1%)		
	転換社債券 (3.1%)		
	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.		
USD	400,000	0.00% due 11/06/22	406,000
	TPK Holding Co., Ltd.		
USD	500,000	0.00% due 04/08/20	516,562
	United Microelectronics Corp.		
USD	1,000,000	0.00% due 05/18/20	1,112,500
	Zhen Ding Technology Holding, Ltd.		
USD	500,000	0.00% due 06/26/19	523,250
	転換社債券 計		2,558,312
	台湾 計 (取得原価USD 2,558,875)		2,558,312
	アラブ首長国連邦 (6.2%)		

転換社債券 (6.2%)

	Aabar Investments PJSC		
EUR 3,800,000	0.50% due 03/27/20		4,158,544

	DP World, Ltd.		
USD 1,000,000	1.75% due 06/19/24		1,047,500

転換社債券 計**5,206,044****アラブ首長国連邦 計 (取得原価USD 4,386,086)****5,206,044****イギリス (12.5%)****転換社債券 (12.5%)**

	BP Capital Markets PLC		
GBP 500,000	1.00% due 04/28/23		807,114

	Helical Bar Jersey, Ltd.		
GBP 2,000,000	4.00% due 06/17/19		2,705,946

	Intu Jersey 2, Ltd.		
GBP 300,000	2.88% due 11/01/22		379,699

	J Sainsbury PLC		
GBP 3,000,000	2.88% due 12/29/49 ^(c) , ^(d) , ^(e)		4,097,160

	Premier Oil Finance Jersey, Ltd.		
USD 2,400,000	2.50% due 05/31/22		2,439,048

転換社債券 計**10,428,967****イギリス 計 (取得原価USD 9,810,216)****10,428,967****アメリカ (19.3%)****転換社債券 (18.9%)**

	BioMarin Pharmaceutical, Inc.		
USD 400,000	0.60% due 08/01/24		390,500

		Blackhawk Network Holdings, Inc.	
USD	650,000	1.50% due 01/15/22	675,594

		DISH Network Corp.	
USD	2,800,000	3.38% due 08/15/26	3,134,250

額面	銘柄名	公正価値
----	-----	------

	固定利付証券 (93.2%) (続き)	(USD)
--	----------------------------	---------

	アメリカ (19.3%) (続き)	
--	--------------------------	--

	転換社債券 (18.9%) (続き)	
--	---------------------------	--

		Dycom Industries, Inc.	
USD	300,000	0.75% due 09/15/21	388,125

		Finisar Corp.	
USD	300,000	0.50% due 12/15/33 ^(c)	303,375

		FireEye, Inc.	
USD	2,000,000	1.63% due 06/01/35 ^(c)	1,861,250

		Herbalife, Ltd.	
USD	750,000	2.00% due 08/15/19	763,125

		Nuance Communications, Inc.	
USD	450,000	1.00% due 12/15/35 ^(c)	424,687

		NuVasive, Inc.	
USD	450,000	2.25% due 03/15/21	523,969

		ON Semiconductor Corp.	
USD	1,350,000	1.00% due 12/01/20	1,675,687

		Pattern Energy Group, Inc.	
USD	500,000	4.00% due 07/15/20	513,437

		Proofpoint, Inc.	
--	--	------------------	--

USD	200,000	0.75% due 06/15/20	253,375
		salesforce.com, Inc.	
USD	250,000	0.25% due 04/01/18	391,563
		ServiceNow, Inc.	
USD	200,000	0.00% due 11/01/18	334,500
		Starwood Property Trust, Inc.	
USD	800,000	4.38% due 04/01/23 ^(c)	818,000
		Tesla, Inc.	
USD	1,900,000	2.38% due 03/15/22	2,208,750
		Viavi Solutions, Inc.	
USD	650,000	0.63% due 08/15/33 ^(c)	684,125
		Wright Medical Group, Inc.	
USD	400,000	2.00% due 02/15/20	422,500
		転換社債券 計	15,766,812
		アメリカ 計 (取得原価USD 15,561,759)	15,766,812
		固定利付証券 計 (取得原価USD 92,870,914)	77,470,544

株数 優先株式 (0.4%)
アメリカ (0.4%)

		Crown Castle International Corp.	
USD	340	6.88% due 08/01/20	393,309
		アメリカ 計 (取得原価USD 367,540)	393,309
		優先株式 計 (取得原価USD 367,540)	393,309

契約数 ドイツ (0.1%)
買建オプション (0.1%)

75		Call - Euro Stoxx 50 Index	
		Exercise price \$3,550, Expiration date 12/15/2017	43,193
		買建オプション 計 (取得原価USD 82,100)	43,193

ドイツ 計 (取得原価USD 82,100)

43,193

額面 短期投資 (6.4%)**フランス (1.3%)****定期預金 (1.3%)**

BNP Paribas

EUR 570,822

570,822

(0.57)% due 12/01/17

680,620

SGD 522,719

0.35% due 12/01/17

388,061

定期預金 計**1,068,681****フランス 計 (取得原価USD 1,055,714)****1,068,681****ケイマン諸島 (0.0%)****定期預金 (0.0%)**

Brown Brothers Harriman & Co.

HKD 303,000

303,000

0.07% due 12/01/17

38,796

額面 銘柄名 純資産比率(%) 公正価値

(USD)

ケイマン諸島 (0.0%) (続き)**定期預金 (0.0%) (続き)**

ZAR

4

5.30% due 12/01/17

0*

定期預金 計**38,796****ケイマン諸島 計 (取得原価USD 38,793)****38,796****日本 (0.0%)****定期預金 (0.0%)**

Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.

JPY

3,076,224 3,076,

(0.23)% due 12/01/17

27,490

定期預金 計**27,490**

日本 計 (取得原価USD 27,490)			27,490
スウェーデン (0.3%)			
定期預金 (0.3%)			
Skandinaviska Enskilda Banken AB			
SEK	321,696	(0.92)% due 12/01/17	38,601
GBP	152,841	0.16% due 12/01/17	206,893
スウェーデン 計 (取得原価USD 240,804)			245,494
イギリス (4.8%)			
定期預金 (4.8%)			
Barclays Bank PLC			
USD	4,016,848	0.60% due 12/01/17	4,016,848
定期預金 計			4,016,848
イギリス 計 (取得原価USD 4,016,848)			4,016,848
短期投資 計 (取得原価USD 5,379,649)			5,397,309
投資 計 (取得原価USD 98,700,203)		99.7	83,304,355
現金及びその他資産(負債控除後)		0.3	217,341
純資産		100.0%	83,521,696

- (a) この証券はデフォルトしている。
(b) 変動利付き証券：2017年11月30日現在
(c) コーラブル証券
(d) 可変利付き証券：2017年11月30日現在
(e) 永久債
** 残高1ドル未満

ファンドレベル:外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
EUR	Citibank N.A.	380,000	12/14/2017	USD	450,686	2,679	-	2,679
JPY	Citibank N.A.	5,000,000	12/14/2017	USD	44,176	527	-	527
SGD	Citibank N.A.	5,000,000	12/14/2017	USD	3,687,441	24,729	-	24,729
SGD	Citibank N.A.	3,000,000	12/14/2017	USD	2,211,644	15,658	-	15,658

USD	Barclays Bank Plc	131,415	12/14/2017	JPY	14,200,000	4,460	-	4,460
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	407,919	12/14/2017	EUR	350,000	-	(9,655)	(9,655)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	942,771	12/14/2017	EUR	800,000	-	(11,681)	(11,681)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	180,675	12/14/2017	GBP	136,000	-	(3,480)	(3,480)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	237,133	12/14/2017	EUR	200,000	-	(1,480)	(1,480)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	2,948,173	12/14/2017	EUR	2,500,000	-	(34,491)	(34,491)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	329,817	12/14/2017	GBP	250,000	-	(8,704)	(8,704)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	400,688	12/14/2017	JPY	45,000,000	-	(1,633)	(1,633)
USD	Citibank N.A.	5,805,035	12/14/2017	JPY	650,000,000	-	(6,262)	(6,262)
USD	JPMorgan Chase Bank N.A.	9,304,397	12/14/2017	SGD	12,481,000	38,078	-	38,078
USD	Morgan Stanley	7,821,803	12/14/2017	GBP	5,913,000	-	(184,892)	(184,892)
USD	Morgan Stanley	978,017	12/14/2017	JPY	110,000,000	-	(5,433)	(5,433)
USD	State Street Corp.	11,739,158	12/14/2017	EUR	9,727,000	134,211	-	134,211
USD	State Street Corp.	400,115	12/14/2017	SEK	3,250,000	9,875	-	9,875
						230,217	(267,711)	(37,494)

Class A- AUD Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
AUD	Citibank N.A.	11,587,814	12/15/2017	USD	8,743,725	52,590	-	52,590

Class B- BRL Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
BRL	Citibank N.A.	31,459,148	12/15/2017	USD	9,575,925	37,732	-	37,732

Class C- INR Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
INR	Citibank N.A.	644,441,109	12/15/2017	USD	9,891,640	89,422	-	89,422

Class D- JPY Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価（損）	評価（損）益
						(USD)	(USD)	(USD)
JPY	Citibank N.A.	6,171,558,232	12/15/2017	USD	54,845,660	334,656	-	334,656

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。

取引相手方	デリバティブ	デリバティブ	担保受取*	担保差入	純額**
	資産の価値 (USD)	負債の価値 (USD)			
店頭デリバティブ					
外国為替予約取引					
Barclays Bank Plc	4,460	-	-	-	4,460
Brown Brothers Harriman & Co.	-	(71,124)	-	-	(71,124)
Citibank N.A.	557,993	(6,262)	(170,000)	-	381,731
JPMorgan Chase Bank N.A.	38,078	-	-	-	38,078
Morgan Stanley	-	(190,325)	-	-	(190,325)
マスター・ネットिंग契約に					
基づくデリバティブ取引 計					
	600,531	(267,711)	(170,000)	-	162,820
State Street Corp.	144,086	-			
マスター・ネットिंग契約に					
基づかないデリバティブ取引 計					
	144,086	-			
デリバティブ取引 計					
	744,617	(267,711)			

*実際の担保は上記の表に開示されたものよりも多い場合がある。

**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。

通貨:

AUD - オーストラリアドル

BRL - ブラジルリアル

EUR - ユーロ

GBP - イギリスポンド

HKD - 香港ドル

INR - インドルピー

JPY - 日本円

SEK - スウェーデンクローネ

SGD - シンガポールドル

USD - 米ドル

ZAR - 南アフリカランド

[前へ](#) [次へ](#)

財務諸表に関する注記（抜粋）

2017年11月30日現在

重要な会計方針

本ファンドの財務諸表は、2016年12月1日からファンドの計算期間末日である2017年11月30日までの期間を反映したもので、計算期間末日は11月の最終営業日（営業日とは、ニューヨーク証券取引所ならびにニューヨークの銀行が通常の業務を行っている日）である。

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）において計算される。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み、本ファンドの資産及び負債の全額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、本ファンドの機能通貨である米ドルに換算される。日本円で表示される一口当たりの純資産額は、通常毎営業日に計算され、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、直近に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。

国内外の固定利付証券及び非上場デリバティブ取引は、通常、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得られる価格に基づいて評価される。独立した価格提供サービスから得られる価格は、マーケット・メーカーが提供する情報、または類似した性質を持つ投資もしくは有価証券に関する利回りのデータから取得した市場価値の推計値を利用している。特定の遅延引渡基準で購入した固定利付証券は、決済日に決済されるまで毎日値洗いされる。満期までの残存期間が60日以内の短期投資は、公正価値に近似する償却原価で評価される。上場オプション、先物取引及び先物オプションは、関連する取引所が決定する清算価格で評価される。

スワップは、可能な限り第三者機関から提供される価格またはマーケット・メーカーによる価格に基づき日々時価評価され、価格に変動があった場合には損益計算書上に未実現損益として計上される。市場価格が容易に入手できないまたは信頼性がないと見なされる場合には、スワップ契約は運用会社の定める指針に従い、別の有価証券あるいは指数を参照して評価することがある。市場価格が容易に入手できず、上記の評価方法を用いて評価できない場合、当該スワップの価値は、運用会社の提供する助言を基に、受託会社が誠実に決定する。計算期間の期首における受取額または支払額は、貸借対照表の該当項目に計上される。これらの前払金は、スワップの解約時または満期日に損益計算書に実現損益として計上される。スワップ解約時の受取清算金または支払清算金は、損益計算書に実現損益として計上される。本ファンドで発生する定期的な受取りまたは支払いは、損益計算書の実現損益に含まれる。スワップ契約には、貸借対照表上で認識できる以上の信用リスク、市場リスクまたドキュメンテーション・リスクといったリスクが場合に依りて存在する。これらには、スワップ市場に

流動性がないリスク、契約の取引相手方が債務を履行しないあるいは契約条件の解釈が相違するリスク、金利が不利に変動するリスクが含まれる。

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、運用会社の提供する助言を基に受託会社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、ビットアスク情報、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。

ブラウン・ブラザーズ・ハリマン社（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評価されるのではなく、運用会社の提供する助言、あるい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られる方法により算出される価額に基づき受託会社により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、受託会社と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対す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、公正価値測定にとって極めて重要なインプットの最も低いレベルに基づいている。しかし、何をもち「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、上場株式及び金融市場証券が含まれている。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しない。

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、政府債、地方債、社債、転換社債型新株予約権付社債及び優先証券が含まれる。レベル2の有価証券は、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。

レベル3に分類される金融資産は、取引頻度が低いため、観察不可能なインプットしか有しないことが顕著である。レベル3の金融資産には、プライベートエクイティーや一部の社債が含まれる。

内在的な評価価格の不確実性から、財務諸表に記載されている価値と、当該資産を売却することで得られる金額は大きく乖離する可能性がある。

<デリバティブ取引>

本ファンドは、ヘッジ目的で、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によって予想された方向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、または損失を生じさせる場合がある。

また、ヘッジ取引は、デリバティブ取引の価値の変動が、予想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、ヘッジされている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。

外国為替予約取引及び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、商品の契約条件や特定の固有リスク、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一部の店頭デリバティブ取引は、インプットが通常は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も含んでいるからである。

次の表は、2017年11月30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)				
資産	活発な市場における同一の 投資に係る公表価格を 反映したインプット (Level 1) (USD)	重要なその他 の観察可能な インプット (Level 2) (USD)	重要な観察 不可能な インプット (Level 3) (USD)	2017年11月30日 時点での公正価値 (USD)
転換社債				
Australia	-	2,487,518	-	2,487,518
Austria	-	2,654,469	-	2,654,469
Belgium	-	185,410	-	185,410
China	-	7,022,870	-	7,022,870
France	-	2,351,877	-	2,351,877
Germany	-	2,746,161	-	2,746,161
Hong Kong	-	2,711,413	-	2,711,413
India	-	1,273,050	-	1,273,050
Italy	-	375,769	-	375,769
Japan	-	8,067,882	-	8,067,882
Malaysia	-	1,761,263	-	1,761,263
Netherlands	-	2,130,223	-	2,130,223
Norway	-	4,005,344	-	4,005,344
Philippines	-	822,187	-	822,187
Singapore	-	2,405,644	-	2,405,644
South Africa	-	263,244	-	263,244
Spain	-	475,185	-	475,185
Sweden	-	344,315	-	344,315
Taiwan	-	2,558,312	-	2,558,312
United Arab Emirates	-	5,206,044	-	5,206,044

United Kingdom	-	10,428,967	-	10,428,967
United States	-	15,766,812	-	15,766,812
社債券				
Japan	-	925,785	-	925,785
Luxembourg	-	500,800	-	500,800
優先株式				
United States	-	393,309	-	393,309
買建オプション				
Germany	43,193	-	-	43,193
短期投資				
Time Deposits	5,397,309	-	-	5,397,309
投資 計	5,440,502	77,863,853	-	83,304,355

金融デリバティブ取引****資産**

外国為替予約取引	-	744,617	-	744,617
----------	---	---------	---	---------

負債

外国為替予約取引	-	(267,711)	-	(267,711)
----------	---	-----------	---	-----------

*分類についての詳細情報は、有価証券明細表を参照。

**外国為替予約取引のような金融デリバティブ商品は、未実現損益で評価している。

2017年11月30日に終了した期間において、1,273,050米ドルで評価された証券がレベル3からレベル2に異動した。

以下の表は、2017年11月30日に終了した年度におけるレベル3に分類された投資の異動を表している。

有価証券	2016年11月30		未実現(損)益 の変動(USD)	2017年11 月30日現 在の		レベル3から レベル2への異動 (USD)	残高 (USD)
	日現在の 残高(USD)	実現(損)益 (USD)		購入(USD)	売却(USD)		
転換社債	4,048,750 ¹	-	(2,775,700)	-	- ²	(1,273,050)	-
有価証券							
券 計	4,048,750	-	(2,775,700)	-	-	(1,273,050)	-

レベル3証券は、ブローカーの引き合いに基づいて評価された社債券である。

¹ レベル3に分類されたゼロ評価証券を含む。

² 公正価値ゼロの有価証券を含む。

(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、個別原価法で計上されている。分配金は配当落ち日に計上される。受取利息は、割引による増価及びプレミアムの償却を調整し、発生主義で計上される。収益は外国税控除後の純額で計上される。回収が見込めない証券のクーポン収入は計上されない。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／増価される。

(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14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。

各クラスの受益証券保有者は月ごとの分配金を再投資し、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11月30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	USD	1,741,097
Class B-BRL Class		5,466,572
Class C-INR Class		2,523,050
Class D-JPY Class		8,047,050
分配金合計	USD	17,777,769

(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米ドルである。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せず、実現及び未実現損益に含めて計上している。

(F) 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（以下、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。

(G) 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。

本ファンドはまた、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11月30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。

(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、先物取引を、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、先物またはそのオプションを売買する場合がある。

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、市場で示された日々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、現金または米国債/米国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11月30日時点で本ファンドは、いかなる先物取引も行っていない。

(I) レポ取引契約

本ファンドはレポ取引契約を締結することができる。一般的なレポ取引契約の条件の下では、売り主が定められた価格で定められた時期に買戻し、本ファンドが売渡すという義務を負うことを条件に、本ファンドは対象となる債務証券(担保)を保有する。レポ取引契約に係る原証券はすべて、本ファンドのカストディアンまたは三者間レポ取引契約で指定されたサブ・カストディアンにより保管される。担保の市場価格は、利息を含むレポ債務の総額と同等以上でなければならない。レポ取引契約に基づいて購入された有価証券は、貸借対照表の資産額に反映される。得られた利息は、損益計算書上の受取利息の一部として計上される。担保の需要が高まった場合には、本ファンドは担保を保有する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。2017年11月30日現在、本ファンドはレポ取引契約を一切締結していない。

(J) リバース・レポ取引契約

本ファンドはリバース・レポ取引契約を締結することができる。リバース・レポ取引契約では、本ファンドは契約の取引相手方である金融機関に現金と引換に有価証券を引き渡し、同時に定められた価格で定められた時期に同一または実質的に同一の有価証券を買戻す契約を締結する。本ファンドは、取引相手方に引き渡した有価証券について、元本と契約期間中に発生した利息（もしあれば）を受領する権利を有する。引き渡される有価証券と引換に受取る現金および本ファンドから取引相手方に支払われる予定の経過利息は、貸借対照表の負債に計上される。本ファンドから取引相手方に支払われる利息は損益計算書に支払利息の一部として計上される。当該有価証券への需要が高まった場合には、本ファンドは取引相手方より当該有価証券を使用するための手数料を受取る可能性があり、それによって本ファンドに受取利息が生じることがある。2017年11月30日現在、本ファンドはリバース・レポ取引契約を一切締結していない。

(K) オプション契約

本ファンドは、本ファンドが保有する、あるいは投資する可能性のある有価証券および金融派生商品に係るコール・オプションおよびプット・オプションを売建てることことができる。プット・オプションの売建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを増加させる傾向がある。コール・オプションの売建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを減少させる傾向がある。本ファンドがコール・オプションまたはプット・オプションを売建てる際、受取りプレミアムに相当する金額が負債として計上され、売建オプションの現在価値を反映するよう時価評価される。これらの負債は、貸借対照表に売建オプションとして計上される。オプションの売建により受取ったプレミアムは、満期日に実現益として扱われる。オプションの売建により受取ったプレミアムは、行使または清算時に受取金に追加されるか、原資産である先物、スワップ、有価証券または通貨取引に係る支払額と相殺され、実現損益が決定される。売建オプションの中にはプレミアムが将来の一定期日に決まるものもある。オプションの売手としての本ファンドは、原資産の売却(コール)あるいは購入(プット)についていかなる支配力も有していないため、売建オプションの原資産の価格が不利に変動することによる市場リスクを負う。場合によっては、市場の流動性が低いため、権利行使がなされず、ファンドが反対売買を行うことができないというリスクも存在する。

本ファンドは、プット・オプションまたはコール・オプションを買建てることことができる。コール・オプションの買建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを増加させる傾向がある。プット・オプションの買建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを減少させる傾向がある。本ファンドが支払うプレミアムは、貸借対照表に投資として計上され、オプションの現在価値を反映するよう時価評価される。オプションの買建により支払うプレミアムは、満期日に実現損として扱われる。買建オプションの中にはプレミアムが将来の一定期日に決まるものもある。オプション・プレミアムは定められた期間のインプライド・ボラティリティによって計算される。プット・オプションおよびコール・オプションの買建に伴うリスクは、プレミアムの支払額に限定される。オプションの買建により支払うプレミアムは、行使または清算時に支払金に追加されるか、原資産の取引から得た収入と相殺され、原資産の売却時に実現損益が決定される。2017年11月30日現在の買建オプションは有価証券明細表に記載している。

(L) デリバティブ取引

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、業績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、外国為替予約取引及びオプション取引を主にトレーディング目的で行っており、主として外国為替リスクを負っている。これらデリバティブ取引の公正価値は、貸借対照表に記載されるとともに、公正価値の変動は損益計算書の外国為替予約取引及びオプション取引に関する実現損益または未実現損益の変動額として計上される。

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11月30日時点の貸借対照表におけるデリバティブ取引の影響

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

該当項目	株式*	外国為替リスク**	合計
	(USD)	(USD)	(USD)
デリバティブ資産			
買建オプション、時価	43,193	-	43,193

外国為替予約取引に係る評価益	-	744,617	744,617
	43,193	744,617	787,810

デリバティブ負債

外国為替予約取引に係る評価損	-	(267,711)	(267,711)
----------------	---	-----------	-----------

*グロス評価額は投資（公正価値）として貸借対照表に記載されている。

**グロス評価額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。

2017年11月30日に終了した期間の損益計算書におけるデリバティブ取引の影響

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

該当項目	株式 (USD)	外国為替リスク (USD)	合計 (USD)
運用の結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損*	-	(534,578)	(534,578)
運用の結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			
買建オプションに係る未実現損の変動**	(38,907)	-	(38,907)
外国為替予約取引に係る未実現益の変動***	-	1,651,309	1,651,309
	(38,907)	1,651,309	1,612,402

*外国為替取引及び外国為替先物取引に係る実現損として損益計算書の科目に記載されている。

**有価証券の未実現益の変動として損益計算書の科目に記載されている。

***外国為替取引及び外国為替先物取引に係る未実現益の変動として損益計算書の科目に記載されている。

2017年11月30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月次平均想定元本はおよそ次の通り：

ファンドレベル*	USD	43,222,238
Class A-AUD Class	USD	11,160,234
Class B-BRL Class	USD	11,658,029
Class C-INR Class	USD	11,744,496
Class D-JPY Class	USD	75,688,254

*全クラスに対して所有している外国為替予約取引

2017年11月30日に終了した期間において、買建オプションを保有した2か月間における月次平均元本残高は82,100米ドルで、対応する月次平均枚数は75であった。

本ファンドは、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およ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・ネットリング契約（以下「マスター・ネットリング契約」という。）の当事者である。当該マスター・ネットリング契約には、当事者の一般的義務、表明、合意、担保要求、債務不履行事由および期限前終了に関する条項等が含まれる場合がある。

担保要求はファンドの各取引先とのネット・ポジションに基づいて決定される。担保は、現金または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・ネットリング契約の条項に従ってファンドに提供された担保がある場合は、ファンドの保管会社によって分別保有され、売却または再担保が可能な額に関してはファンドの有価証券明細表に表示される。ファンドが提供した担保がある場合は、ファンドの保管会社により分別保管され、ファンドの有価証券明細表において識別される。現金の担保がある場合は、当該金額は貸借対照表で開示される。

ファンド側の取引終了事由は、一定期間に亘りファンドの純資産が規定の基準以下に減少する場合に発生しうる。取引相手方側の取引終了事由は、取引相手方の信用格付が規定のレベルを下回る場合に発生しうる。いずれの場合も、発生時に、他方当事者は期限前終了を選択し、同当事者による合理的な決定に基づいて、全ての未決済デリバティブ契約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）をすることができる。単一または複数のファンドの取引相手方による期限前終了の決定が、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。

(M) カストディアン宛未払い金

貸借対照表に計上されているカストディアン宛未払い金は、外国通貨あるいは現金に係る債務を含んでいる。

[前へ](#) [次へ](#)

グローバルCBオープン・円コース

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成29年11月20日現在 金額（円）	当期 平成30年5月21日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	234,093,446	146,760,044
投資信託受益証券	6,200,407,101	4,800,032,567
親投資信託受益証券	842,408	842,077
未収入金	18,942,521	23,926,054
流動資産合計	6,454,285,476	4,971,560,742
資産合計	6,454,285,476	4,971,560,742
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	40,851,361	20,013,476
未払解約金	63,832,542	30,793,932
未払受託者報酬	155,793	118,964
未払委託者報酬	5,920,346	4,521,016
その他未払費用	390,376	284,882
流動負債合計	111,150,418	55,732,270
負債合計	111,150,418	55,732,270
純資産の部		
元本等		
元本	8,170,272,333	6,671,158,814
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,827,137,275	1,755,330,342
（分配準備積立金）	848,370,326	821,087,214
元本等合計	6,343,135,058	4,915,828,472
純資産合計	6,343,135,058	4,915,828,472
負債純資産合計	6,454,285,476	4,971,560,742

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日 金額（円）	当期 自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	408,658,390	333,619,867
受取利息	940	564
有価証券売買等損益	694,507,653	437,523,493
営業収益合計	285,848,323	103,903,062
営業費用		
支払利息	71,012	54,183

受託者報酬	1,027,510	749,597
委託者報酬	39,047,418	28,486,384
その他費用	390,376	285,739
営業費用合計	40,536,316	29,575,903
営業利益又は営業損失()	326,384,639	133,478,965
経常利益又は経常損失()	326,384,639	133,478,965
当期純利益又は当期純損失()	326,384,639	133,478,965
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()	7,417,434	4,438,148
期首剰余金又は期首欠損金()	1,641,502,295	1,827,137,275
剰余金増加額又は欠損金減少額	415,462,114	371,508,004
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	415,462,114	371,508,004
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,863,373	9,345,772
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,863,373	9,345,772
分配金	271,266,516	161,314,482
期末剰余金又は期末欠損金()	1,827,137,275	1,755,330,342

[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11月21日	至 平成30年5月21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。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末及び当計算期末が休日のため、平成29年11月21日から平成30年5月21日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成29年11月20日現在	平成30年5月21日現在
1. 元本状況		
期首元本額	10,385,454,503円	8,170,272,333円
期中追加設定元本額	59,239,242円	38,885,320円
期中一部解約元本額	2,274,421,412円	1,537,998,839円
2. 受益権の総数	8,170,272,333口	6,671,158,814口
3. 元本の欠損	1,827,137,275円	1,755,330,342円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期		当期	
自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日		自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日	
分配金の計算過程 第66期計算期間末（平成29年6月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,966,591,271円（1万口当たり1,946.56円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い150,514,409円（1万口当たり50円）を分配しております。		分配金の計算過程 第72期計算期間末（平成29年12月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,618,534,349円（1万口当たり2,055.20円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い139,376,539円（1万口当たり50円）を分配しております。	
配当等収益 （費用控除後）	67,599,284円	配当等収益 （費用控除後）	54,450,492円
有価証券売買等損益	0円	有価証券売買等損益	0円
収益調整金	952,226,563円	収益調整金	747,209,926円
分配準備積立金	946,765,424円	分配準備積立金	816,873,931円
分配可能額	1,966,591,271円	分配可能額	1,618,534,349円
（1万口当たり分配可能額）	(1,946.56円)	（1万口当たり分配可能額）	(2,055.20円)
収益分配金	50,514,409円	収益分配金	39,376,539円
（1万口当たり収益分配金）	(50円)	（1万口当たり収益分配金）	(50円)
第67期計算期間末（平成29年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,855,625,376円（1万口当たり1,963.77円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い147,246,477円（1万口当たり50円）を分配しております。		第73期計算期間末（平成30年1月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,569,874,507円（1万口当たり2,074.01円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い137,846,418円（1万口当たり50円）を分配しております。	
配当等収益 （費用控除後）	63,506,411円	配当等収益 （費用控除後）	52,079,331円
有価証券売買等損益	0円	有価証券売買等損益	0円
収益調整金	891,490,874円	収益調整金	719,001,059円
分配準備積立金	900,628,091円	分配準備積立金	798,794,117円
分配可能額	1,855,625,376円	分配可能額	1,569,874,507円

（1万口当たり分配可能額）	(1,963.77円)
収益分配金	47,246,477円
（1万口当たり収益分配金）	(50円)

第68期計算期間末（平成29年8月21日）に、投資信託約款に基づき計算した1,814,093,609円（1万口当たり1,980.85円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い145,790,830円（1万口当たり50円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	61,429,563円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	864,869,135円
分配準備積立金	887,794,911円
分配可能額	1,814,093,609円
（1万口当たり分配可能額）	(1,980.85円)
収益分配金	45,790,830円
（1万口当たり収益分配金）	(50円)

第69期計算期間末（平成29年9月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,764,737,414円（1万口当たり1,999.13円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い144,137,624円（1万口当たり50円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	60,276,753円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	834,758,137円
分配準備積立金	869,702,524円
分配可能額	1,764,737,414円
（1万口当たり分配可能額）	(1,999.13円)
収益分配金	44,137,624円
（1万口当たり収益分配金）	(50円)

第70期計算期間末（平成29年10月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,723,904,342円（1万口当たり2,017.40円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い142,725,815円（1万口当たり50円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	58,340,741円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	808,934,692円
分配準備積立金	856,628,909円
分配可能額	1,723,904,342円
（1万口当たり分配可能額）	(2,017.40円)
収益分配金	42,725,815円
（1万口当たり収益分配金）	(50円)

第71期計算期間末（平成29年11月20日）に、投資信託約款に基づき計算した1,663,515,211円（1万口当たり2,036.06円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い140,851,361円（1万口当たり50円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	56,092,872円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	774,293,524円
分配準備積立金	833,128,815円
分配可能額	1,663,515,211円
（1万口当たり分配可能額）	(2,036.06円)
収益分配金	40,851,361円
（1万口当たり収益分配金）	(50円)

（1万口当たり分配可能額）	(2,074.01円)
収益分配金	37,846,418円
（1万口当たり収益分配金）	(50円)

第74期計算期間末（平成30年2月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,541,059,637円（1万口当たり2,092.62円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い22,092,794円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	50,526,578円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	700,368,921円
分配準備積立金	790,164,138円
分配可能額	1,541,059,637円
（1万口当たり分配可能額）	(2,092.62円)
収益分配金	22,092,794円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第75期計算期間末（平成30年3月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,512,674,610円（1万口当たり2,133.29円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い21,272,429円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	50,111,138円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	674,874,496円
分配準備積立金	787,688,976円
分配可能額	1,512,674,610円
（1万口当たり分配可能額）	(2,133.29円)
収益分配金	21,272,429円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第76期計算期間末（平成30年4月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,500,844,514円（1万口当たり2,173.79円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い20,712,826円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	48,675,781円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	657,647,595円
分配準備積立金	794,521,138円
分配可能額	1,500,844,514円
（1万口当たり分配可能額）	(2,173.79円)
収益分配金	20,712,826円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第77期計算期間末（平成30年5月21日）に、投資信託約款に基づき計算した1,477,070,418円（1万口当たり2,214.11円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い20,013,476円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	46,914,368円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	635,969,728円
分配準備積立金	794,186,322円
分配可能額	1,477,070,418円
（1万口当たり分配可能額）	(2,214.11円)
収益分配金	20,013,476円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期
	自 平成29年11月21日 至 平成30年 5月21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 5月21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11月20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	83
投資信託受益証券	102,326,399
合計	102,326,316

当期（平成30年 5月21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	-
投資信託受益証券	96,641,044
合計	96,641,044

（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11月20日現在）

該当事項はありません。

当期（平成30年 5月21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11月21日 至 平成30年 5月21日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成29年11月20日現在	当期 平成30年 5月21日現在
1口当たり純資産額 0.7764円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,764円）」	1口当たり純資産額 0.7369円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,369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	Global Convertible Bond Fund JPY Class	7,397,183,800	4,800,032,567	
	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	827,757	842,077	
合計		2銘柄	7,398,011,557	4,800,874,644	

< 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、「Global Convertible Bond Fund JPY 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「グローバルC Bオープン・高金利通貨コース」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

(1) 貸借対照表

区分	第12期 平成29年11月20日現在 金額（円）	第13期 平成30年5月21日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	12,505,039	8,873,951
流動資産合計	12,505,039	8,873,951
資産合計	12,505,039	8,873,951
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	432	304
流動負債合計	432	304
負債合計	432	304
純資産の部		
元本等		
元本	12,502,450	8,875,880
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,157	2,233
（分配準備積立金）	87,188	65,149
元本等合計	12,504,607	8,873,647
純資産合計	12,504,607	8,873,647
負債純資産合計	12,505,039	8,873,951

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	第12期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日 金額（円）	第13期 自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日 金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	2,408	4,439
営業収益合計	2,408	4,439
営業費用		
その他費用	432	304
営業費用合計	432	304
営業利益又は営業損失（ ）	1,976	4,743
経常利益又は経常損失（ ）	1,976	4,743
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,976	4,743
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（ ）	1,790	2,108
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,335	2,157
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,011	-

当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,011	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,375	1,755
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,375	1,621
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	134
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,157	2,233

[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	第13期	
	自 平成29年11月21日	至 平成30年5月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。	
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、前計算期末及び当計算期末が休日のため、平成29年11月21日から平成30年5月21日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	平成29年11月20日現在	平成30年5月21日現在
1. 元本状況		
期首元本額	12,047,417円	12,502,450円
期中追加設定元本額	26,291,744円	15,321,550円
期中一部解約元本額	25,836,711円	18,948,120円
2. 受益権の総数	12,502,450口	8,875,880口
3. 元本の欠損	-	2,233円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期	第13期
自 平成29年5月20日	自 平成29年11月21日
至 平成29年11月20日	至 平成30年5月21日
分配金の計算過程 該当事項はありません。	分配金の計算過程 該当事項はありません。

(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	第13期	
	自 平成29年11月21日	至 平成30年5月21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、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。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	第13期	
	平成30年5月21日現在	
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
------------	---

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第12期（平成29年11月20日現在）

種類	当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	409
合計	409

第13期（平成30年5月21日現在）

種類	当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	2,330
合計	2,330

（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

第12期（平成29年11月20日現在）

該当事項はありません。

第13期（平成30年5月21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）

第13期（自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第12期 平成29年11月20日現在	第13期 平成30年5月21日現在
1口当たり純資産額 1.0002円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,002円）」	1口当たり純資産額 0.9997円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,997円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド	8,723,043	8,873,951	
	合計	1銘柄	8,723,043	8,873,951	

<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」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの状況は、前記「グローバルCBオープン・高金利通貨コース」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6月末現在)

グローバルC B オープン・高金利通貨コース

資産総額	2,325,300,677 円
負債総額	13,031,414 円
純資産総額(-)	2,312,269,263 円
発行済数量	3,423,131,717 口
1 単位当り純資産額(/)	0.6755 円

グローバルC B オープン・円コース

資産総額	4,402,879,351 円
負債総額	42,154,235 円
純資産総額(-)	4,360,725,116 円
発行済数量	5,930,502,958 口
1 単位当り純資産額(/)	0.7353 円

グローバルC B オープン(マネーボールファンド)

資産総額	8,847,780 円
負債総額	25,039 円
純資産総額(-)	8,822,741 円
発行済数量	8,825,864 口
1 単位当り純資産額(/)	0.9996 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	4,505,078,238 円
負債総額	28,624,280 円
純資産総額(-)	4,476,453,958 円
発行済数量	4,400,615,833 口
1 単位当り純資産額(/)	1.0172 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6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。

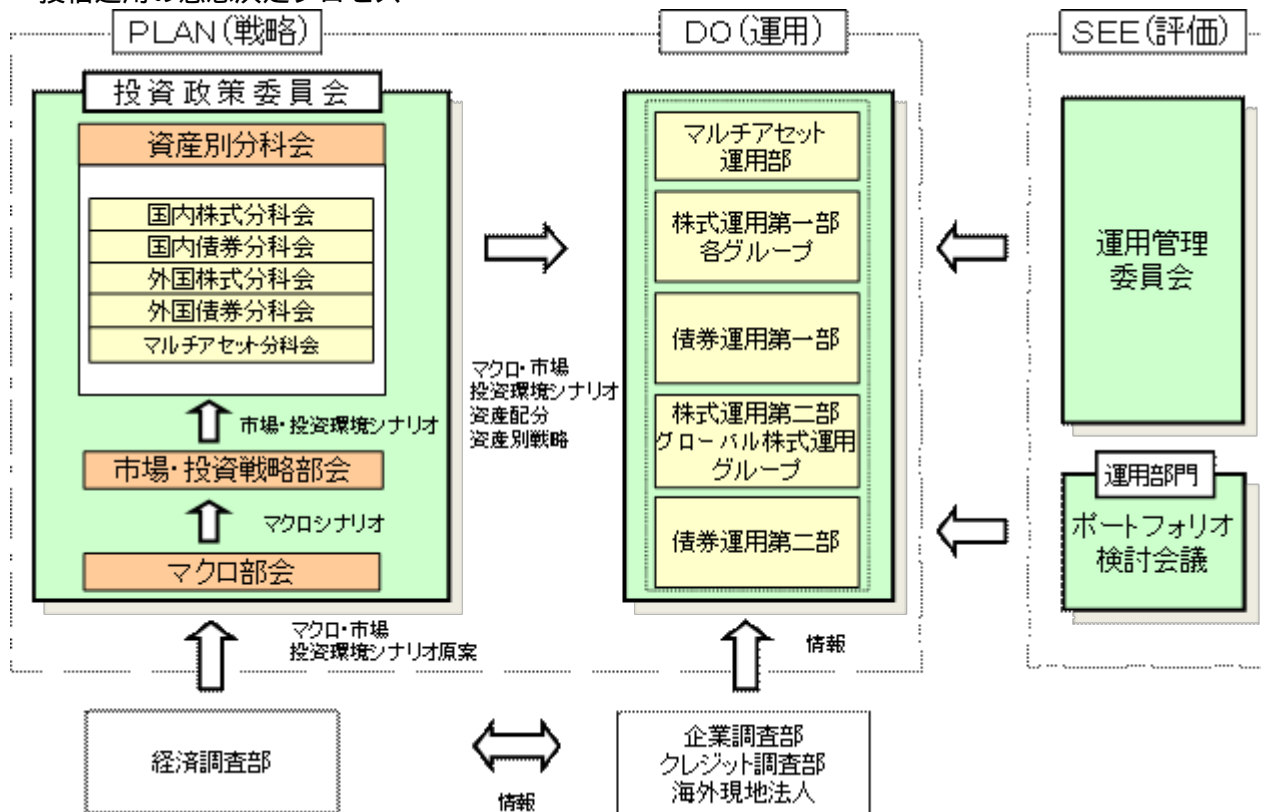
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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6月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、407本であり、その純資産総額は、約3,387,391百万円です（なお、親投資信託129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	24	66,678百万円
追加型株式投資信託	303	3,028,826百万円
単位型公社債投資信託	80	291,885百万円
合計	407	3,387,391百万円

[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	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

[前へ](#) [次へ](#)

注記事項

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。）を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>				
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table><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30年3月末現在	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

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

- ・ 資本金：51,000百万円（平成30年3月末現在）
- ・ 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- ・ 再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成30年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。
高木証券株式会社	11,069	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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	

以上

独立監査人の監査報告書

平成30年6月29日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルC Bオープン・高金利通貨コースの平成29年11月21日から平成30年5月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルC Bオープン・高金利通貨コースの平成30年5月21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29日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルC Bオープン・円コースの平成29年11月21日から平成30年5月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルC Bオープン・円コースの平成30年5月21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29日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルC Bオープン（マネープールファンド）の平成29年11月21日から平成30年5月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルC Bオープン（マネープールファンド）の平成30年5月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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 公認会計士 飯田 浩 司 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 梅津 広 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、「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。