

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年12月21日

【発行者名】 BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役 島崎 亮平

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
グラントウキョウノースタワー

【事務連絡者氏名】 入山 小枝子

【電話番号】 03-6377-2882

【届出の対象とした募集（売出）  
内国投資信託受益証券に係るファ  
ンドの名称】 BNPパリバ アジア・ボンド・ファンド（為替ヘッジなし）

【届出の対象とした募集（売出）  
内国投資信託受益証券の金額】 1,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

**【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

有価証券報告書の提出に伴い、平成30年6月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に更新するため、また、原届出書の一部に訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

**【訂正の内容】**

下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

**第一部【証券情報】****（7）【申込期間】****<訂正前>**

平成30年6月26日から平成31年6月25日まで

（注）上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**<訂正後>**

2018年6月26日から2019年6月25日まで

（注）上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**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】****（1）【ファンドの目的及び基本的性格】**

ファンドの特色

**<訂正前>**

（略）

**指定投資信託証券の概要**（平成30年3月末現在）

（以下略）

**<訂正後>**

（略）

**指定投資信託証券の概要**（2018年3月末現在）

（以下略）

**（2）【ファンドの沿革】****<訂正前>**

平成24年6月20日 信託契約締結、当ファンドの設定、運用開始

平成27年12月25日 信託期間の延長

**<訂正後>**

2012年6月20日 信託契約締結、当ファンドの設定、運用開始

2015年12月25日 信託期間の延長

**（3）【ファンドの仕組み】**

原届出書の「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（3）ファンドの仕組み c. 委託会社等の概況」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

**<訂正・更新後>**

c. 委託会社等の概況（2018年11月末現在）

資本金 5億円

沿革

1998年11月9日	会社設立
1998年11月30日	証券投資信託委託業の免許取得
1999年2月26日	証券投資顧問業の登録
2000年6月20日	投資一任契約業務の認可取得
2000年8月1日	パリバ投資顧問株式会社の営業の全部を譲り受ける
2000年8月1日	ビー・エヌ・ピー・パリバアセットマネジメント株式会社に社名変更
2010年7月1日	フォルティス・アセットマネジメント株式会社と合併 BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社に社名変更
2017年12月1日	BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社に社名変更

## 大株主の状況

株主名	住所	所有株数	所有比率
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Holding BNPパリバ・アセットマネジメント・ホールディング	フランス共和国、 パリ75009、 ブルヴァーオスマン1	169,000株	100.0%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (1) 投資方針 a. 運用方針」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

## &lt;訂正・更新後&gt;

## a. 運用方針

投資信託証券（投資信託及び外国投資信託の受益権及び受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。））ならびに投資証券及び外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）への投資を通じて、主として日本を除くアジア諸国・地域の国債、政府機関債、社債等に実質的に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

主に投資する投資信託証券として、日本を除くアジア諸国・地域で発行される、様々な通貨建ての国債等、同諸国・地域に所在する企業、もしくは同諸国・地域において主に事業展開を営む企業が発行する社債、及び債券等を原資産とする金融派生商品を主要投資対象とする外国投資証券「パーベスト ボンド・アジア（除く日本）クラシック-MDシェア（Parvest Bond Asia ex-Japan Classic-MD Shares）」（米ドル建て）を選定しております。また、余資運用については、円建ての公社債を主要投資対象として安定した収益の確保と信託財産の成長を目指す国内籍の追加型投資信託証券「BNPパリバ日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」を選定しております。

## (2)【投資対象】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (2) 投資対象」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

## &lt;訂正・更新後&gt;

a. この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

b. 委託会社は、信託金を、主として指定投資信託証券のほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの

3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- なお、3の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができます。
- c. 委託会社は、信託金を、bに掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
- d. bの規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金をcに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### 指定投資信託証券（2018年3月末現在）

外国投資信託証券	
ファンドの名称	パーベスト ボンド・アジア（除く日本）クラシック-MDシェア（Parvest Bond Asia ex-Japan Classic-MD Shares）（米ドル建て）
運用の基本方針	中期的な信託財産の成長を目指します。
主要な投資対象	日本を除くアジア諸国・地域で発行される、様々な通貨建ての国債等、同諸国・地域に所在する企業、もしくは同諸国・地域において主に事業展開を営む企業が発行する社債、及び債券等を原資産とする金融派生商品等
投資顧問会社	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Limited （BNPパリバ・アセットマネジメント UK リミテッド）

国内籍追加型投資信託証券	
ファンドの名称	BNPパリバ日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要な投資対象	円建ての公社債
委託会社	BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社

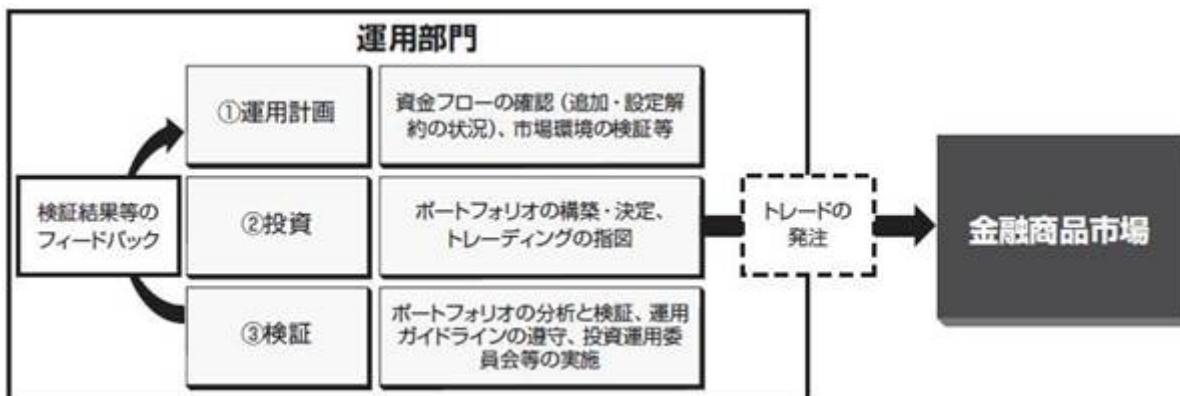
#### （3）【運用体制】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 （3）運用体制」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

##### <訂正・更新後>

##### 委託会社の運用体制

委託会社の運用体制は以下の通りです。



・運用部門及びトレーディング部門（10名程度）

運用部門では、運用の意思決定、取引の執行、市場動向・ポートフォリオ・運用ガイドライン等のモニタリングを行います。トレーディング部門では、運用部門からの指示に基づき、発注業務を行います。

・運用委員会（10名程度）

原則として月1回及び随時に開催し、投資環境や投資行動についての報告を行います。また、投資運用活動に関する協議を行い、関連する重要な情報を委員会で共有し、それによって当社の投資運用に関わる業務を効果的に推進します。

・内部管理委員会（10名程度）

原則として月1回及び随時に開催し、各部署における自主検査の実施状況及び結果の報告、独立した専任部署による投資リスク、オペレーショナル・リスク、コンプライアンス・リスクなどの管理状況の確認を行います。あわせて当社における内部管理態勢、法令等遵守態勢及びリスク管理態勢の整備を確実なものとするために必要な協議と情報共有を迅速かつ効果的に行います。

・法務・コンプライアンス及びリスク管理部門（5名程度）

取引内容の法令遵守状況の確認を行い、必要に応じて指導、勧告を行うとともに内部管理委員会等に報告を行います。また、法令遵守状況の監視及び定期的な確認、法令及びコンプライアンスに関する情報の役職員への提供、研修の実施等を行います。

### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

受託会社または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合等を行っています。また、受託会社等につき、内部統制の整備及び運用状況についての報告書を受取っております。

上記の運用体制等は2018年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 3【投資リスク】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク b. リスクの管理体制及びc. 参考情報」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

### <訂正・更新後>

#### b. リスクの管理体制

委託会社では、当ファンドの主要投資対象である投資信託証券が適切に運用されていることを確認するためにモニターします。

運用部門及びプロダクト部門は、投資信託証券の投資顧問会社に対し、ポートフォリオの内容開示を求めると共に、ポートフォリオの運用内容についての検証等を実施します。

運用部門等におけるリスク管理に加えて、投資リスク管理部門がポートフォリオの市場リスク、信用リスク等の投資リスクを管理します。投資リスク管理部門は、運用部門からは完全に独立した組織として、グループ内のリスク部門に属しております。投資リスク管理部門は、市場リスク、流動性リスク、信用リスク、カウンターパーティーリスク、モデルリスク等の投資リスクの管理と、インベストメント・コンプライアンスに関する業務をカバーしています。

業務部門は日々のトレード、約定、決済等、事務面での監視を実施します。更に、運用委員会により定期的にチェックを行い、投資リスクの管理体制を強化しています。

上記管理体制は、委託会社の組織変更等により今後変更される場合があります。

#### c. 参考情報

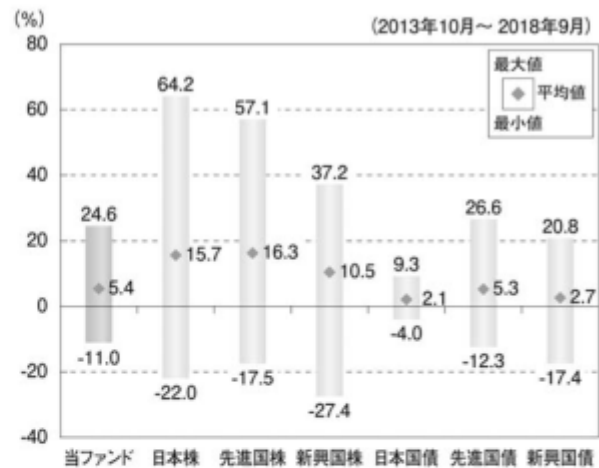
## ■ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



※上記の5年間の各月末における直近1年間の騰落率及び分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

※「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みなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と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



※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、上記の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、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。

※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。

### 各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

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)

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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)

(注1) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースのものを使用しております。

(注2) 各指数等に関する著作権等の知的財産権は、開発元もしくは公表元に帰属します(東証株価指数(TOPIX): 株式会社東京証券取引所、MSCIコクサイ・インデックス及びMSCIエマージング・マーケット・インデックス: MSCI Inc.、NOMURA-BPI国債: 野村證券株式会社、FTSE世界国債インデックス: FTSE Fixed Income LLC、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド: J.P.Morgan Securities Inc.)。なお、各社は当ファンドの運用に関し一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

#### <訂正前>

(略)

上記の他、指定投資信託証券について、以下の運用報酬がかかります。(平成30年3月末現在)

(以下略)

#### <訂正後>

(略)

上記の他、指定投資信託証券について、以下の運用報酬がかかります。(2018年9月末現在)

(以下略)

### (4)【その他の手数料等】

#### <訂正前>

(略)

上記の費用の他に、「パーベスト ボンド・アジア（除く日本）クラシック-MDシェア」においては、信託財産の保管及び計算等の事務に関する費用（最大年率0.30%）、組入有価証券等の売買時の売買委託手数料、信託財産に関する租税、その他関連する費用等がかかります。また、「BNPパリバ日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」においては、組入有価証券等の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用等がかかります。（平成30年3月末現在）

(以下略)

## &lt;訂正後&gt;

(略)

上記の費用の他に、「パーベスト ボンド・アジア（除く日本）クラシック-MDシェア」においては、信託財産の保管及び計算等の事務に関する費用（最大年率0.30%）、組入有価証券等の売買時の売買委託手数料、信託財産に関する租税、その他関連する費用等がかかります。また、「BNPパリバ日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」においては、組入有価証券等の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用等がかかります。（2018年9月末現在）

(以下略)

## (5)【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

## &lt;訂正・更新後&gt;

課税上は株式投資信託として取扱われます。

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります（2018年9月末現在）。詳しくは、販売会社にお問合わせください。

なお、今後、税法が改正された場合は、以下の内容が変更になることがあります。

## 個人の受益者に対する課税

## 収益分配金について

収益分配金のうち普通分配金は、配当所得として、原則20%（所得税15%、地方税5%）の源泉徴収課税が行われます。

ただし、2037年12月31日までは、復興財源法に基づき所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が併せて徴収されます。各期間の税率は、以下の通りです。

2037年12月31日まで	2038年1月1日以降
20.315%（所得税15.315%、地方税5%）	20%（所得税15%、地方税5%）

## 一部解約金、償還金について

解約価額または償還価額から取得に要した金額（申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した差益（譲渡益）は、譲渡所得として、原則20%（所得税15%、地方税5%）の申告分離課税が適用されます。

ただし、2037年12月31日までは、復興財源法に基づき所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が併せて徴収されます。各期間の税率は、以下の通りです。

2037年12月31日まで	2038年1月1日以降
20.315%（所得税15.315%、地方税5%）	20%（所得税15%、地方税5%）

\* 収益分配金（普通分配金）については、源泉徴収により申告不要制度が適用されますが、確定申告を行い総合課税または申告分離課税を選択することもできます。申告分離課税を選択した場合には、上場株式等及び特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡損との通算を行うことができます。

\* 一部解約金及び償還金については、上場株式等の譲渡所得等の収入金額として取り扱われ、上場株式等の譲渡所得等の損失が生じた場合には、上場株式等に係る配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金、配当金に限ります。）及び譲渡所得等、特定公社債等の利子所得等との損益通算を行うことができます。

## 法人の受益者に対する課税

## 収益分配金について



収益分配金（普通分配金）に対する源泉徴収税率は、原則15%（所得税）となります。ただし、2037年12月31日までは、復興財源法に基づき所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が併せて徴収されます。各期間の税率は、以下の通りです。

2037年12月31日まで	2038年1月1日以降
15.315%（所得税）	15%（所得税）

#### 一部解約金、償還金について

解約価額または償還価額の個別元本超過額に対する源泉徴収税率は、原則15%（所得税）となります。ただし、2037年12月31日までは、復興財源法に基づき所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が併せて徴収されます。各期間の税率は、以下の通りです。

2037年12月31日まで	2038年1月1日以降
15.315%（所得税）	15%（所得税）

\* 源泉徴収された所得税は、所有期間に応じて法人税額から控除される場合があります。

#### < 個別元本について >

追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合などにより算出方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせください。

#### < 収益分配金の課税について >

追加型株式投資信託における収益分配金には、課税扱いになる「普通分配金」と非課税扱いになる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

#### < 外国の税法に関する開示 >

##### 外国の税法

外国の税法は、新しい報告体制を課し、金融機関が受け、又は行う、特定の支払いに対して源泉徴収がされる場合があります。当投資信託は金融機関に分類されます。

外国の税法に基づき、関係する税務当局へ投資家の特定の情報を報告する必要がある場合があります。開示される情報は、投資家及びその直接又は間接的な受益者、実質的な所有者、被支配関係にある者の本人確認情報を含みますが、これに限られません。従って、上記のような情報の報告義務を投資信託委託会社が遵守するため、投資家は自己及びその直接又は間接的な受益者、実質的な所有者、被支配関係にある者についての情報に関する投資信託委託会社からの合理的な要求を遵守するよう求められることとなります。投資家がそのような要求を遵守しない場合、当投資信託からの支払いに関して当該投資家について源泉徴収又は控除がされることがあります。また、投資信託の一部解約、強制的な売却をされることもあります。

**外国の税法の遵守のため、以下の通り各納税者に通知します。**(A)ここに記載された税金に関する説明は、各納税者に課される外国の租税に関する罰則を回避する目的で書かれたものではなく、また、そのために利用することはできません。(B)このような税金の記載はここに記載された取引や事項を促進又は勧誘することを支援するために書かれています。(C)納税者は独立した税務アドバイザーから当該納税者の個別の状況に基づいたアドバイスを受けるべきです。

配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

NISA（少額投資非課税制度）及びジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）の適用が可能です。NISA及びジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定の金額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得等が一定の期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方です。詳しくは、販売会社にお問合わせください。



税金の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認していただくことをお勧めいたします。

## 5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

## &lt;訂正・更新後&gt;

## (1)【投資状況】（平成30年9月末現在）

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	ルクセンブルク	451,132,038	98.72
投資信託受益証券	日本	9,942	0.00
小計		451,141,980	98.72
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,827,171	1.28
合計（純資産総額）		456,969,151	100.00

\*投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (2)【投資資産】（平成30年9月末現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## (主要銘柄の明細)

順位	地域	銘柄名	種類	株数/口数	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	ルクセンブルク	Parvest Bond Asia ex-Japan Classic-MD Shares	投資証券	47,452.894	9,488.77	450,269,762	9,506.94	451,132,038	98.72
2	日本	BNPパリバ日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	投資信託受益証券	9,992	0.9950	9,942	0.9950	9,942	0.00

\*投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

## (種類別投資比率)

国内/外国	資産の種類	投資比率(%)
外国	投資証券	98.72
国内	投資信託受益証券	0.00
	合計	98.72

\*投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

## &lt;参考情報&gt;

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の投資資産は、以下の通りです。

## (主要銘柄の明細)

Parvest Bond Asia ex-Japan（パーベスト ボンド・アジア（除く日本））（平成30年9月27日現在）

順位	種類	国/地域	銘柄名	クーポン(%)	償還日	投資比率(%)
1	国債証券	インド	INDIA GOVERNMENT BOND	7.59	2026/01/11	4.09
2	国債証券	タイ	THAILAND GOVERNMENT BOND	4.875	2029/06/22	3.69
3	社債券	中国	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD	4.625	2023/03/14	2.98
4	投資証券	ルクセンブルク	PARVEST BOND RMB XCA	-	-	2.87
5	社債券	中国	MINMETALS BOUNTEOUS FIN	4.2	2026/07/27	2.83
6	社債券	イスラエル	ISRAEL ELECTRIC CORP LTD	7.75	2027/12/15	2.51
7	社債券	中国	PROVEN HONOUR CAPITAL	4.125	2025/05/19	2.48
8	社債券	中国	CHINA SCE GRP HLDGS LTD	5.875	2022/03/10	2.38
9	社債券	インドネシア	GAJAH TUNGGAL TBK PT	8.375	2022/08/10	2.30

10	社債券	カザフスタン	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	4.75	2027/04/19	2.25
----	-----	--------	-------------------------	------	------------	------

\*投資比率は、ファンドの資産合計に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

BNPパリバ日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定) (平成30年9月27日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	日本	国債証券	第728回国庫短期証券	500,000	100.03	500,177	100.03	500,177		2018/12/20	58.89

\*投資比率は、ファンドの資産合計に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(種類別投資比率)

BNPパリバ日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定) (平成30年9月27日現在)

国内/外国	資産の種類	投資比率(%)
国内	国債証券	58.89
	合計	58.89

\*投資比率は、ファンドの資産合計に対する当該種類の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

当ファンドの各計算期間末日及び平成30年9月末前1年以内における各月末の純資産の推移は以下のとおりです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		基準価額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間	(第1期末) 平成24年 7月25日	17,143,150	17,202,796	10,060	10,095
	(第2期末) 8月27日	21,412,211	21,485,803	10,183	10,218
	(第3期末) 9月25日	27,441,917	27,550,165	10,140	10,180
第2特定期間	(第4期末) 10月25日	31,091,060	31,209,955	10,460	10,500
	(第5期末) 11月26日	38,900,909	39,046,224	10,708	10,748
	(第6期末) 12月25日	104,592,021	104,973,393	10,970	11,010
	(第7期末) 平成25年 1月25日	201,458,369	202,145,023	11,736	11,776
	(第8期末) 2月25日	350,061,602	351,219,485	12,093	12,133
	(第9期末) 3月25日	333,815,613	334,909,458	12,207	12,247
第3特定期間	(第10期末) 4月25日	334,593,141	335,632,972	12,871	12,911
	(第11期末) 5月27日	320,388,313	321,382,996	12,884	12,924
	(第12期末) 6月25日	300,262,621	301,293,488	11,651	11,691
	(第13期末) 7月25日	318,074,715	319,116,680	12,211	12,251
	(第14期末) 8月26日	259,139,956	260,031,241	11,630	11,670
	(第15期末) 9月25日	255,284,047	256,148,093	11,818	11,858

第4特定期間	(第16期末)	10月25日	249,860,955	250,706,345	11,822	11,862
	(第17期末)	11月25日	258,322,049	259,169,987	12,186	12,226
	(第18期末)	12月25日	264,036,617	264,883,177	12,476	12,516
	(第19期末)	平成26年 1月27日	255,110,394	255,946,742	12,201	12,241
	(第20期末)	2月25日	249,514,600	250,324,351	12,325	12,365
	(第21期末)	3月25日	231,610,595	232,364,902	12,282	12,322
第5特定期間	(第22期末)	4月25日	223,181,840	223,905,819	12,331	12,371
	(第23期末)	5月26日	222,392,067	223,110,470	12,383	12,423
	(第24期末)	6月25日	220,155,332	220,864,780	12,413	12,453
	(第25期末)	7月25日	224,810,528	225,533,739	12,434	12,474
	(第26期末)	8月25日	232,632,604	233,364,340	12,717	12,757
	(第27期末)	9月25日	241,094,995	241,823,918	13,230	13,270
第6特定期間	(第28期末)	10月27日	229,814,412	230,516,653	13,090	13,130
	(第29期末)	11月25日	247,895,262	248,591,694	14,238	14,278
	(第30期末)	12月25日	243,636,458	244,316,763	14,325	14,365
	(第31期末)	平成27年 1月26日	237,022,970	237,697,984	14,046	14,086
	(第32期末)	2月25日	244,654,581	245,342,015	14,236	14,276
	(第33期末)	3月25日	273,700,817	275,988,743	14,355	14,475
第7特定期間	(第34期末)	4月27日	333,011,888	335,821,738	14,222	14,342
	(第35期末)	5月25日	373,583,568	376,699,962	14,385	14,505
	(第36期末)	6月25日	415,457,552	418,913,744	14,425	14,545
	(第37期末)	7月27日	447,274,200	451,022,408	14,320	14,440
	(第38期末)	8月25日	438,128,786	442,016,845	13,522	13,642
	(第39期末)	9月25日	473,874,558	478,060,110	13,586	13,706
第8特定期間	(第40期末)	10月26日	492,750,003	497,055,653	13,733	13,853
	(第41期末)	11月25日	513,118,714	517,595,882	13,753	13,873
	(第42期末)	12月25日	551,880,357	556,838,599	13,357	13,477
	(第43期末)	平成28年 1月25日	552,620,432	557,685,623	13,092	13,212
	(第44期末)	2月25日	554,508,136	559,879,651	12,388	12,508
	(第45期末)	3月25日	567,774,964	573,209,429	12,537	12,657
第9特定期間	(第46期末)	4月25日	569,774,800	575,320,000	12,330	12,450
	(第47期末)	5月25日	570,452,923	576,097,457	12,128	12,248
	(第48期末)	6月27日	530,997,633	536,675,587	11,222	11,342
	(第49期末)	7月25日	557,538,793	563,248,158	11,718	11,838
	(第50期末)	8月25日	531,708,623	537,465,300	11,084	11,204
	(第51期末)	9月26日	530,220,076	536,019,196	10,972	11,092
第10特定期間	(第52期末)	10月25日	534,205,257	539,920,423	11,217	11,337
	(第53期末)	11月25日	566,167,142	571,939,822	11,769	11,889
	(第54期末)	12月26日	570,408,206	576,152,768	11,915	12,035
	(第55期末)	平成29年 1月25日	557,558,712	563,335,177	11,583	11,703
	(第56期末)	2月27日	553,036,195	557,876,979	11,425	11,525
	(第57期末)	3月27日	540,950,447	545,799,510	11,156	11,256
第11特定期間	(第58期末)	4月25日	541,955,471	546,859,820	11,051	11,151
	(第59期末)	5月25日	549,820,050	554,766,122	11,116	11,216
	(第60期末)	6月26日	549,580,263	554,562,945	11,030	11,130
	(第61期末)	7月25日	552,128,022	557,165,520	10,960	11,060
	(第62期末)	8月25日	546,152,915	551,227,243	10,763	10,863
	(第63期末)	9月25日	557,578,129	562,683,952	10,920	11,020

第12特定期間	(第64期末)	10月25日	561,153,432	566,282,132	10,941	11,041
	(第65期末)	11月27日	546,267,703	551,410,636	10,622	10,722
	(第66期末)	12月25日	540,943,340	546,020,752	10,654	10,754
	(第67期末)	平成30年 1月25日	520,075,105	525,178,479	10,191	10,291
	(第68期末)	2月26日	495,828,581	500,934,706	9,710	9,810
	(第69期末)	3月26日	479,918,558	485,027,911	9,393	9,493
第13特定期間	(第70期末)	4月25日	491,890,826	497,013,614	9,602	9,702
	(第71期末)	5月25日	484,558,640	489,677,154	9,467	9,567
	(第72期末)	6月25日	463,892,489	468,938,134	9,194	9,294
	(第73期末)	7月25日	457,279,012	462,293,026	9,120	9,220
	(第74期末)	8月27日	456,374,834	461,411,252	9,061	9,161
	(第75期末)	9月25日	452,597,499	457,603,568	9,041	9,141
	平成29年 9月末		558,849,999	-	10,904	-
	10月末		559,783,217	-	10,875	-
	11月末		549,282,778	-	10,655	-
	12月末		541,530,292	-	10,642	-
	平成30年 1月末		517,108,153	-	10,110	-
	2月末		500,901,105	-	9,785	-
	3月末		489,473,285	-	9,532	-
	4月末		493,348,119	-	9,606	-
	5月末		479,928,055	-	9,356	-
	6月末		462,650,933	-	9,175	-
	7月末		460,139,555	-	9,150	-
	8月末		457,831,859	-	9,064	-
	9月末		456,969,151	-	9,101	-

\*基準価額は1万口当たり

## 【分配の推移】

特定期間	計算期間			分配金(円)
第1特定期間	第1期	自 平成24年 6月20日	至 平成24年 7月25日	35
	第2期	自 平成24年 7月26日	至 平成24年 8月27日	35
	第3期	自 平成24年 8月28日	至 平成24年 9月25日	40
第2特定期間	第4期	自 平成24年 9月26日	至 平成24年10月25日	40
	第5期	自 平成24年10月26日	至 平成24年11月26日	40
	第6期	自 平成24年11月27日	至 平成24年12月25日	40
	第7期	自 平成24年12月26日	至 平成25年 1月25日	40
	第8期	自 平成25年 1月26日	至 平成25年 2月25日	40
	第9期	自 平成25年 2月26日	至 平成25年 3月25日	40
第3特定期間	第10期	自 平成25年 3月26日	至 平成25年 4月25日	40
	第11期	自 平成25年 4月26日	至 平成25年 5月27日	40
	第12期	自 平成25年 5月28日	至 平成25年 6月25日	40
	第13期	自 平成25年 6月26日	至 平成25年 7月25日	40
	第14期	自 平成25年 7月26日	至 平成25年 8月26日	40
	第15期	自 平成25年 8月27日	至 平成25年 9月25日	40

第4特定期間	第16期	自 平成25年 9月26日	至 平成25年10月25日	40
	第17期	自 平成25年10月26日	至 平成25年11月25日	40
	第18期	自 平成25年11月26日	至 平成25年12月25日	40
	第19期	自 平成25年12月26日	至 平成26年 1月27日	40
	第20期	自 平成26年 1月28日	至 平成26年 2月25日	40
	第21期	自 平成26年 2月26日	至 平成26年 3月25日	40
第5特定期間	第22期	自 平成26年 3月26日	至 平成26年 4月25日	40
	第23期	自 平成26年 4月26日	至 平成26年 5月26日	40
	第24期	自 平成26年 5月27日	至 平成26年 6月25日	40
	第25期	自 平成26年 6月26日	至 平成26年 7月25日	40
	第26期	自 平成26年 7月26日	至 平成26年 8月25日	40
	第27期	自 平成26年 8月26日	至 平成26年 9月25日	40
第6特定期間	第28期	自 平成26年 9月26日	至 平成26年10月27日	40
	第29期	自 平成26年10月28日	至 平成26年11月25日	40
	第30期	自 平成26年11月26日	至 平成26年12月25日	40
	第31期	自 平成26年12月26日	至 平成27年 1月26日	40
	第32期	自 平成27年 1月27日	至 平成27年 2月25日	40
	第33期	自 平成27年 2月26日	至 平成27年 3月25日	120
第7特定期間	第34期	自 平成27年 3月26日	至 平成27年 4月27日	120
	第35期	自 平成27年 4月28日	至 平成27年 5月25日	120
	第36期	自 平成27年 5月26日	至 平成27年 6月25日	120
	第37期	自 平成27年 6月26日	至 平成27年 7月27日	120
	第38期	自 平成27年 7月28日	至 平成27年 8月25日	120
	第39期	自 平成27年 8月26日	至 平成27年 9月25日	120
第8特定期間	第40期	自 平成27年 9月26日	至 平成27年10月26日	120
	第41期	自 平成27年10月27日	至 平成27年11月25日	120
	第42期	自 平成27年11月26日	至 平成27年12月25日	120
	第43期	自 平成27年12月26日	至 平成28年 1月25日	120
	第44期	自 平成28年 1月26日	至 平成28年 2月25日	120
	第45期	自 平成28年 2月26日	至 平成28年 3月25日	120
第9特定期間	第46期	自 平成28年 3月26日	至 平成28年 4月25日	120
	第47期	自 平成28年 4月26日	至 平成28年 5月25日	120
	第48期	自 平成28年 5月26日	至 平成28年 6月27日	120
	第49期	自 平成28年 6月28日	至 平成28年 7月25日	120
	第50期	自 平成28年 7月26日	至 平成28年 8月25日	120
	第51期	自 平成28年 8月26日	至 平成28年 9月26日	120

第10特定期間	第52期	自 平成28年 9月27日	至 平成28年10月25日	120
	第53期	自 平成28年10月26日	至 平成28年11月25日	120
	第54期	自 平成28年11月26日	至 平成28年12月26日	120
	第55期	自 平成28年12月27日	至 平成29年 1月25日	120
	第56期	自 平成29年 1月26日	至 平成29年 2月27日	100
	第57期	自 平成29年 2月28日	至 平成29年 3月27日	100
第11特定期間	第58期	自 平成29年 3月28日	至 平成29年 4月25日	100
	第59期	自 平成29年 4月26日	至 平成29年 5月25日	100
	第60期	自 平成29年 5月26日	至 平成29年 6月26日	100
	第61期	自 平成29年 6月27日	至 平成29年 7月25日	100
	第62期	自 平成29年 7月26日	至 平成29年 8月25日	100
	第63期	自 平成29年 8月26日	至 平成29年 9月25日	100
第12特定期間	第64期	自 平成29年 9月26日	至 平成29年10月25日	100
	第65期	自 平成29年10月26日	至 平成29年11月27日	100
	第66期	自 平成29年11月28日	至 平成29年12月25日	100
	第67期	自 平成29年12月26日	至 平成30年 1月25日	100
	第68期	自 平成30年 1月26日	至 平成30年 2月26日	100
	第69期	自 平成30年 2月27日	至 平成30年 3月26日	100
第13特定期間	第70期	自 平成30年 3月27日	至 平成30年 4月25日	100
	第71期	自 平成30年 4月26日	至 平成30年 5月25日	100
	第72期	自 平成30年 5月26日	至 平成30年 6月25日	100
	第73期	自 平成30年 6月26日	至 平成30年 7月25日	100
	第74期	自 平成30年 7月26日	至 平成30年 8月27日	100
	第75期	自 平成30年 8月28日	至 平成30年 9月25日	100

\* 分配金は1万口当たり

#### 【収益率の推移】

特定期間	計算期間			収益率(%)
第1特定期間	第1期	自 平成24年 6月20日	至 平成24年 7月25日	1.0
	第2期	自 平成24年 7月26日	至 平成24年 8月27日	1.6
	第3期	自 平成24年 8月28日	至 平成24年 9月25日	0.0
第2特定期間	第4期	自 平成24年 9月26日	至 平成24年10月25日	3.6
	第5期	自 平成24年10月26日	至 平成24年11月26日	2.8
	第6期	自 平成24年11月27日	至 平成24年12月25日	2.8
	第7期	自 平成24年12月26日	至 平成25年 1月25日	7.3
	第8期	自 平成25年 1月26日	至 平成25年 2月25日	3.4
	第9期	自 平成25年 2月26日	至 平成25年 3月25日	1.3



第3特定期間	第10期	自 平成25年 3月26日	至 平成25年 4月25日	5.8
	第11期	自 平成25年 4月26日	至 平成25年 5月27日	0.4
	第12期	自 平成25年 5月28日	至 平成25年 6月25日	9.3
	第13期	自 平成25年 6月26日	至 平成25年 7月25日	5.1
	第14期	自 平成25年 7月26日	至 平成25年 8月26日	4.4
	第15期	自 平成25年 8月27日	至 平成25年 9月25日	2.0
第4特定期間	第16期	自 平成25年 9月26日	至 平成25年10月25日	0.4
	第17期	自 平成25年10月26日	至 平成25年11月25日	3.4
	第18期	自 平成25年11月26日	至 平成25年12月25日	2.7
	第19期	自 平成25年12月26日	至 平成26年 1月27日	1.9
	第20期	自 平成26年 1月28日	至 平成26年 2月25日	1.3
	第21期	自 平成26年 2月26日	至 平成26年 3月25日	0.0
第5特定期間	第22期	自 平成26年 3月26日	至 平成26年 4月25日	0.7
	第23期	自 平成26年 4月26日	至 平成26年 5月26日	0.7
	第24期	自 平成26年 5月27日	至 平成26年 6月25日	0.6
	第25期	自 平成26年 6月26日	至 平成26年 7月25日	0.5
	第26期	自 平成26年 7月26日	至 平成26年 8月25日	2.6
	第27期	自 平成26年 8月26日	至 平成26年 9月25日	4.3
第6特定期間	第28期	自 平成26年 9月26日	至 平成26年10月27日	0.8
	第29期	自 平成26年10月28日	至 平成26年11月25日	9.1
	第30期	自 平成26年11月26日	至 平成26年12月25日	0.9
	第31期	自 平成26年12月26日	至 平成27年 1月26日	1.7
	第32期	自 平成27年 1月27日	至 平成27年 2月25日	1.6
	第33期	自 平成27年 2月26日	至 平成27年 3月25日	1.7
第7特定期間	第34期	自 平成27年 3月26日	至 平成27年 4月27日	0.1
	第35期	自 平成27年 4月28日	至 平成27年 5月25日	2.0
	第36期	自 平成27年 5月26日	至 平成27年 6月25日	1.1
	第37期	自 平成27年 6月26日	至 平成27年 7月27日	0.1
	第38期	自 平成27年 7月28日	至 平成27年 8月25日	4.7
	第39期	自 平成27年 8月26日	至 平成27年 9月25日	1.4
第8特定期間	第40期	自 平成27年 9月26日	至 平成27年10月26日	2.0
	第41期	自 平成27年10月27日	至 平成27年11月25日	1.0
	第42期	自 平成27年11月26日	至 平成27年12月25日	2.0
	第43期	自 平成27年12月26日	至 平成28年 1月25日	1.1
	第44期	自 平成28年 1月26日	至 平成28年 2月25日	4.5
	第45期	自 平成28年 2月26日	至 平成28年 3月25日	2.2

第9特定期間	第46期	自 平成28年 3月26日	至 平成28年 4月25日	0.7
	第47期	自 平成28年 4月26日	至 平成28年 5月25日	0.7
	第48期	自 平成28年 5月26日	至 平成28年 6月27日	6.5
	第49期	自 平成28年 6月28日	至 平成28年 7月25日	5.5
	第50期	自 平成28年 7月26日	至 平成28年 8月25日	4.4
	第51期	自 平成28年 8月26日	至 平成28年 9月26日	0.1
第10特定期間	第52期	自 平成28年 9月27日	至 平成28年10月25日	3.3
	第53期	自 平成28年10月26日	至 平成28年11月25日	6.0
	第54期	自 平成28年11月26日	至 平成28年12月26日	2.3
	第55期	自 平成28年12月27日	至 平成29年 1月25日	1.8
	第56期	自 平成29年 1月26日	至 平成29年 2月27日	0.5
	第57期	自 平成29年 2月28日	至 平成29年 3月27日	1.5
第11特定期間	第58期	自 平成29年 3月28日	至 平成29年 4月25日	0.0
	第59期	自 平成29年 4月26日	至 平成29年 5月25日	1.5
	第60期	自 平成29年 5月26日	至 平成29年 6月26日	0.1
	第61期	自 平成29年 6月27日	至 平成29年 7月25日	0.3
	第62期	自 平成29年 7月26日	至 平成29年 8月25日	0.9
	第63期	自 平成29年 8月26日	至 平成29年 9月25日	2.4
第12特定期間	第64期	自 平成29年 9月26日	至 平成29年10月25日	1.1
	第65期	自 平成29年10月26日	至 平成29年11月27日	2.0
	第66期	自 平成29年11月28日	至 平成29年12月25日	1.2
	第67期	自 平成29年12月26日	至 平成30年 1月25日	3.4
	第68期	自 平成30年 1月26日	至 平成30年 2月26日	3.7
	第69期	自 平成30年 2月27日	至 平成30年 3月26日	2.2
第13特定期間	第70期	自 平成30年 3月27日	至 平成30年 4月25日	3.3
	第71期	自 平成30年 4月26日	至 平成30年 5月25日	0.4
	第72期	自 平成30年 5月26日	至 平成30年 6月25日	1.8
	第73期	自 平成30年 6月26日	至 平成30年 7月25日	0.3
	第74期	自 平成30年 7月26日	至 平成30年 8月27日	0.4
	第75期	自 平成30年 8月28日	至 平成30年 9月25日	0.9

\* 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1期については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額（10,000円）を用いております。

#### （４）【設定及び解約の実績】

当ファンドの各計算期間における設定及び解約の実績は次の通りです。

特定期間	計算期間		設定口数(口)	解約口数(口)
第1特定期間	第1期	自 平成24年 6月20日 至 平成24年 7月25日	17,041,717	-
	第2期	自 平成24年 7月26日 至 平成24年 8月27日	3,984,720	-
	第3期	自 平成24年 8月28日 至 平成24年 9月25日	6,035,740	-

第2特定期間	第4期	自 平成24年 9月26日	至 平成24年10月25日	2,661,608	-
	第5期	自 平成24年10月26日	至 平成24年11月26日	6,604,989	-
	第6期	自 平成24年11月27日	至 平成24年12月25日	64,814,390	5,800,000
	第7期	自 平成24年12月26日	至 平成25年 1月25日	80,391,408	4,070,983
	第8期	自 平成25年 1月26日	至 平成25年 2月25日	135,821,224	18,013,848
	第9期	自 平成25年 2月26日	至 平成25年 3月25日	34,574,800	50,584,323
第3特定期間	第10期	自 平成25年 3月26日	至 平成25年 4月25日	16,114,642	29,618,260
	第11期	自 平成25年 4月26日	至 平成25年 5月27日	49,317,219	60,604,193
	第12期	自 平成25年 5月28日	至 平成25年 6月25日	15,513,981	6,467,935
	第13期	自 平成25年 6月26日	至 平成25年 7月25日	7,095,267	4,320,761
	第14期	自 平成25年 7月26日	至 平成25年 8月26日	1,667,200	39,337,344
	第15期	自 平成25年 8月27日	至 平成25年 9月25日	2,688,987	9,498,745
第4特定期間	第16期	自 平成25年 9月26日	至 平成25年10月25日	1,409,735	6,073,569
	第17期	自 平成25年10月26日	至 平成25年11月25日	1,104,491	467,408
	第18期	自 平成25年11月26日	至 平成25年12月25日	3,079,874	3,424,552
	第19期	自 平成25年12月26日	至 平成26年 1月27日	1,866,431	4,419,402
	第20期	自 平成26年 1月28日	至 平成26年 2月25日	3,538,360	10,187,568
	第21期	自 平成26年 2月26日	至 平成26年 3月25日	5,324,413	19,185,446
第5特定期間	第22期	自 平成26年 3月26日	至 平成26年 4月25日	611,072	8,192,967
	第23期	自 平成26年 4月26日	至 平成26年 5月26日	3,073,742	4,467,771
	第24期	自 平成26年 5月27日	至 平成26年 6月25日	3,527,007	5,765,713
	第25期	自 平成26年 6月26日	至 平成26年 7月25日	3,761,351	320,816
	第26期	自 平成26年 7月26日	至 平成26年 8月25日	2,131,307	-
	第27期	自 平成26年 8月26日	至 平成26年 9月25日	774,971	1,478,077
第6特定期間	第28期	自 平成26年 9月26日	至 平成26年10月27日	490,454	7,161,065
	第29期	自 平成26年10月28日	至 平成26年11月25日	484,897	1,937,090
	第30期	自 平成26年11月26日	至 平成26年12月25日	2,473,394	6,505,212
	第31期	自 平成26年12月26日	至 平成27年 1月26日	1,833,386	3,156,066
	第32期	自 平成27年 1月27日	至 平成27年 2月25日	3,922,581	817,628
	第33期	自 平成27年 2月26日	至 平成27年 3月25日	20,783,005	1,981,072
第7特定期間	第34期	自 平成27年 3月26日	至 平成27年 4月27日	45,972,848	2,479,229
	第35期	自 平成27年 4月28日	至 平成27年 5月25日	27,139,978	1,594,633
	第36期	自 平成27年 5月26日	至 平成27年 6月25日	29,520,373	1,203,822
	第37期	自 平成27年 6月26日	至 平成27年 7月27日	25,338,317	1,003,672
	第38期	自 平成27年 7月28日	至 平成27年 8月25日	13,671,816	2,017,571
	第39期	自 平成27年 8月26日	至 平成27年 9月25日	26,166,654	1,375,549
第8特定期間	第40期	自 平成27年 9月26日	至 平成27年10月26日	10,245,812	237,628
	第41期	自 平成27年10月27日	至 平成27年11月25日	14,509,775	216,622
	第42期	自 平成27年11月26日	至 平成27年12月25日	40,797,909	708,469
	第43期	自 平成27年12月26日	至 平成28年 1月25日	9,703,373	790,946
	第44期	自 平成28年 1月26日	至 平成28年 2月25日	27,173,751	1,646,690
	第45期	自 平成28年 2月26日	至 平成28年 3月25日	19,277,262	14,031,488

第9特定期間	第46期	自 平成28年 3月26日	至 平成28年 4月25日	13,823,252	4,595,338
	第47期	自 平成28年 4月26日	至 平成28年 5月25日	8,802,343	524,475
	第48期	自 平成28年 5月26日	至 平成28年 6月27日	3,885,900	1,100,864
	第49期	自 平成28年 6月28日	至 平成28年 7月25日	3,007,900	390,326
	第50期	自 平成28年 7月26日	至 平成28年 8月25日	5,966,600	2,023,976
	第51期	自 平成28年 8月26日	至 平成28年 9月26日	3,730,195	193,239
第10特定期間	第52期	自 平成28年 9月27日	至 平成28年10月25日	6,709,510	13,705,693
	第53期	自 平成28年10月26日	至 平成28年11月25日	6,164,983	1,372,141
	第54期	自 平成28年11月26日	至 平成28年12月26日	4,991,421	7,334,598
	第55期	自 平成28年12月27日	至 平成29年 1月25日	3,038,816	380,231
	第56期	自 平成29年 1月26日	至 平成29年 2月27日	4,628,755	1,922,484
	第57期	自 平成29年 2月28日	至 平成29年 3月27日	4,414,064	3,586,110
第11特定期間	第58期	自 平成29年 3月28日	至 平成29年 4月25日	6,419,337	890,710
	第59期	自 平成29年 4月26日	至 平成29年 5月25日	4,172,299	-
	第60期	自 平成29年 5月26日	至 平成29年 6月26日	6,462,920	2,801,952
	第61期	自 平成29年 6月27日	至 平成29年 7月25日	5,903,091	421,470
	第62期	自 平成29年 7月26日	至 平成29年 8月25日	7,231,212	3,548,229
	第63期	自 平成29年 8月26日	至 平成29年 9月25日	5,648,944	2,499,476
第12特定期間	第64期	自 平成29年 9月26日	至 平成29年10月25日	5,618,913	3,331,162
	第65期	自 平成29年10月26日	至 平成29年11月27日	3,329,690	1,906,463
	第66期	自 平成29年11月28日	至 平成29年12月25日	3,507,050	10,059,134
	第67期	自 平成29年12月26日	至 平成30年 1月25日	2,664,696	68,467
	第68期	自 平成30年 1月26日	至 平成30年 2月26日	2,720,926	2,445,842
	第69期	自 平成30年 2月27日	至 平成30年 3月26日	2,749,934	2,427,094
第13特定期間	第70期	自 平成30年 3月27日	至 平成30年 4月25日	3,075,445	1,732,013
	第71期	自 平成30年 4月26日	至 平成30年 5月25日	1,978,776	2,406,116
	第72期	自 平成30年 5月26日	至 平成30年 6月25日	2,302,867	9,589,756
	第73期	自 平成30年 6月26日	至 平成30年 7月25日	2,147,589	5,310,696
	第74期	自 平成30年 7月26日	至 平成30年 8月27日	2,261,491	21,088
	第75期	自 平成30年 8月28日	至 平成30年 9月25日	2,140,497	5,175,432

(注1) 本邦以外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期計算期間の設定口数(口)には、当初募集期間中の販売口数を含みます。

#### <参考情報> 運用実績(2018年9月28日現在)

##### ■基準価額・純資産の推移



※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を再投資したものととして算出しております。  
※基準価額は、信託報酬控除後です。

基準価額	9,101 円
純資産総額	4.5 億円

※基準価額は1万口当たり

##### ■分配の推移

2018年5月	100 円
2018年6月	100 円
2018年7月	100 円
2018年8月	100 円
2018年9月	100 円
直近1年間累計	1,200 円
設定来累計	6,030 円

※1万口当たり(税引前)

## ■主要な資産の状況

※純資産比率は、ファンドの純資産総額に対する比率です。

### <投資状況>

資産の種類	銘柄名	純資産比率(%)
投資証券	Parvest Bond Asia ex-Japan Classic-MD Shares（ルクセンブルク）	98.72
投資信託受益証券	BNPパリバ日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)（日本）	0.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1.28
合計		100.00

### <投資対象ファンドの組入上位10銘柄>

#### Parvest Bond Asia ex-Japan

2018年9月27日現在

順位	種類	国/地域	銘柄名	クーポン(%)	償還日	純資産比率(%)
1	国債証券	インド	INDIA GOVERNMENT BOND	7.59	2026/01/11	4.09
2	国債証券	タイ	THAILAND GOVERNMENT BOND	4.875	2029/06/22	3.69
3	社債券	中国	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD	4.625	2023/03/14	2.98
4	投資証券	ルクセンブルク	PARVEST BOND RMB XCA	-	-	2.87
5	社債券	中国	MINMETALS BOUNTEOUS FIN	4.2	2026/07/27	2.83
6	社債券	イスラエル	ISRAEL ELECTRIC CORP LTD	7.75	2027/12/15	2.51
7	社債券	中国	PROVEN HONOUR CAPITAL	4.125	2025/05/19	2.48
8	社債券	中国	CHINA SCE GRP HLDGS LTD	5.875	2022/03/10	2.38
9	社債券	インドネシア	GAJAH TUNGGAL TBK PT	8.375	2022/08/10	2.30
10	社債券	カザフスタン	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	4.75	2027/04/19	2.25

#### BNPパリバ日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2018年9月27日現在

順位	種類	国/地域	銘柄名	償還日	純資産比率(%)
1	国債証券	日本	第728回国庫短期証券	2018/12/20	58.89

※当該銘柄は当ファンドの説明のためのものであり、当社が取得申込みの勧誘を行うものではありません。

## ■年間収益率の推移



※設定日以降の収益率を暦年ベースで表示しております。2012年は設定日(2012年6月20日)から年末までの収益率、2018年は年初から9月末までの収益率です。

※収益率は、分配金(税引前)を再投資したものととして算出しております。

※当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過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

\*運用実績は、別途月次等で適時開示しており、委託会社のホームページまたは販売会社でご確認いただけます。

**第2【管理及び運営】****3【資産管理等の概要】****(3)【信託期間】****<訂正前>**

平成24年 6月20日から平成34年 3月25日とします。

(以下略)

**<訂正後>**

2012年 6月20日から2022年 3月25日とします。

(以下略)

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

#### <訂正・更新後>

- (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、財務諸表に記載している金額は、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ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成30年3月27日から平成30年9月25日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

BNPパリバ アジア・ボンド・ファンド（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (平成30年3月26日現在)	当特定期間末 (平成30年9月25日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,658,770	8,291,456
投資信託受益証券	9,942	9,942
投資証券	476,369,964	448,089,183
未収配当金	1,443,383	1,448,044
その他未収収益	1,016,213	974,740
流動資産合計	485,498,272	458,813,365
資産合計	485,498,272	458,813,365
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	5,109,353	5,006,069
未払解約金	-	762,059
未払受託者報酬	12,270	11,681
未払委託者報酬	417,191	397,119
未払利息	17	21
その他未払費用	40,883	38,917
流動負債合計	5,579,714	6,215,866
負債合計	5,579,714	6,215,866
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	*1,*2 510,935,375	*1,*2 500,606,939
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	*3 31,016,817	*3 48,009,440
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	479,918,558	452,597,499
純資産合計	479,918,558	452,597,499
負債純資産合計	485,498,272	458,813,365

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前特定期間 (自 平成29年 9月26日 至 平成30年 3月26日)	当特定期間 (自 平成30年 3月27日 至 平成30年 9月25日)
<b>営業収益</b>		
受取配当金	9,361,735	8,709,326
有価証券売買等損益	20,678,269	30,040,984
為替差損益	34,910,674	35,075,229
その他収益	2,329,334	2,097,457
営業収益合計	43,897,874	15,841,028
<b>営業費用</b>		
支払利息	5,441	4,282
受託者報酬	86,608	76,998
委託者報酬	2,944,578	2,617,867
その他費用	490,477	466,015
営業費用合計	3,527,104	3,165,162
営業利益又は営業損失( )	47,424,978	12,675,866
経常利益又は経常損失( )	47,424,978	12,675,866
当期純利益又は当期純損失( )	47,424,978	12,675,866
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( )	28,596	7,141
期首剰余金又は期首欠損金( )	46,995,801	31,016,817
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,361,536	1,627,913
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	70,300	1,627,913
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,291,236	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,252,683	945,813
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,163,005	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	89,678	945,813
分配金	*1 30,667,897	*1 30,343,448
期末剰余金又は期末欠損金( )	31,016,817	48,009,440

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。  (2) 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資証券の基準価額で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における特定期間末日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条及び第61条に基づき処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

前特定期間末 (平成30年3月26日現在)		当特定期間末 (平成30年9月25日現在)	
*1 期首元本額	510,582,328 円	*1 期首元本額	510,935,375 円
期中追加設定元本額	20,591,209 円	期中追加設定元本額	13,906,665 円
期中解約元本額	20,238,162 円	期中解約元本額	24,235,101 円
*2 特定期間末における受益権の総数	510,935,375 口	*2 特定期間末における受益権の総数	500,606,939 口
*3 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は、31,016,817 円であります。		*3 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は、48,009,440 円であります。	

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前特定期間 (自 平成29年9月26日 至 平成30年3月26日)
*1 分配金の計算過程 (自 平成29年9月26日 至 平成29年10月25日) 計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,883,329円)、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(94,003,811円)、及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は95,887,140円(1万口当たり1,869.61円)であり、うち、5,128,700円(1万口当たり100.00円)を分配金額としております。 (自 平成29年10月26日 至 平成29年11月27日) 計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,401,022円)、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(91,010,768円)、及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は92,411,790円(1万口当たり1,796.86円)であり、うち、5,142,933円(1万口当たり100.00円)を分配金額としております。

（自 平成29年11月28日 至 平成29年12月25日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,838,031円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（86,158,482円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は87,996,513円（1万口当たり1,733.09円）であり、うち、5,077,412円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成29年12月26日 至 平成30年1月25日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,294,080円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（83,343,091円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は84,637,171円（1万口当たり1,658.45円）であり、うち、5,103,374円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成30年1月26日 至 平成30年2月26日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,267,053円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（79,576,691円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は80,843,744円（1万口当たり1,583.26円）であり、うち、5,106,125円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成30年2月27日 至 平成30年3月26日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,271,457円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（75,785,753円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は77,057,210円（1万口当たり1,508.15円）であり、うち、5,109,353円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

#### 当特定期間

（自 平成30年3月27日

至 平成30年9月25日）

#### \*1 分配金の計算過程

（自 平成30年3月27日 至 平成30年4月25日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,795,871円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（72,137,222円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は73,933,093円（1万口当たり1,443.22円）であり、うち、5,122,788円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成30年4月26日 至 平成30年5月25日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,289,044円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（68,753,934円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は70,042,978円（1万口当たり1,368.41円）であり、うち、5,118,514円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成30年5月26日 至 平成30年6月25日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,253,904円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（64,000,456円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は65,254,360円（1万口当たり1,293.27円）であり、うち、5,045,645円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成30年6月26日 至 平成30年7月25日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,265,233円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（59,831,893円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は61,097,126円（1万口当たり1,218.52円）であり、うち、5,014,014円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成30年7月26日 至 平成30年8月27日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,405,617円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（56,333,770円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は57,739,387円（1万口当たり1,146.43円）であり、うち、5,036,418円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

（自 平成30年8月28日 至 平成30年9月25日）

計算期間末における解約に伴う当期純損益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,575,223円）、解約に伴う当期純損益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（52,385,447円）、及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は53,960,670円（1万口当たり1,077.89円）であり、うち、5,006,069円（1万口当たり100.00円）を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

### ・ 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	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対する投資を行っております。
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券（投資信託受益証券、投資証券）、デリバティブ取引（為替予約取引）、金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、カントリーリスク、投資銘柄の集中リスク等の信用リスク、流動性リスクを有しております。当ファンドが行うデリバティブ取引については、信託財産に属する外貨建資産の受渡しを行う際の円貨額を確定させるため、為替予約取引を行っております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、金融商品に係るリスク全般について複数の部署及び会議体において組織的に管理を行っております。これら金融商品に係るリスクについては、パフォーマンス評価及び投資運用委員会により定期的に検証を行い、その結果に基づき関連所轄部門に対する是正勧告を行っております。また、運用部門及びプロダクト部門においては、運用管理の一環として個別銘柄のチェックやポートフォリオのモニタリングを行っております。さらに、フロント・オフィスとバック・オフィスが分離されていることに加えて、独立した管理部門及び法務・コンプライアンス部によるリスク管理体制が敷かれています。
4．金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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よった場合、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

	前特定期間末 （平成30年3月26日現在）	当特定期間末 （平成30年9月25日現在）

1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
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)」に記載していません。	(1) 有価証券 同左
	(2) デリバティブ取引 -	(2) デリバティブ取引 -
	(3) 上記以外の金融商品 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、短期間で決済されることから、当該帳簿価額を時価としております。	(3) 上記以外の金融商品 同左

## (有価証券に関する注記)

前特定期間末(平成30年3月26日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	1
投資証券	3,581,730
合計	3,581,731

当特定期間末(平成30年9月25日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	1
投資証券	4,612,289
合計	4,612,290

## (デリバティブ取引に関する注記)

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)

該当事項はありません。

## (一口当たり情報に関する注記)

前特定期間末 (平成30年3月26日現在)		当特定期間末 (平成30年9月25日現在)	
一口当たり純資産額	0.9393円	一口当たり純資産額	0.9041円
(一万口当たり純資産額)	(9,393円)	(一万口当たり純資産額)	(9,041円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	
				単価	金額
投資信託 受益証券	円	B N P パリバ日本短期債券ファンド (適格機関投資家限定)	9,992	0.9950	9,942
		円 小計	9,992	-	9,942
投資信託受益証券 合計			9,992	-	9,942
合計			9,992	-	9,942

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額		邦貨換算評価額 (円)
				単価	金額	
投資証券	米ドル	Parvest Bond Asia ex-Japan Classic-MD Shares	47,452.894	83.55	3,964,689.29	448,089,183
		米ドル 小計	47,452.894	-	3,964,689.29	448,089,183
投資証券 合計			47,452.894	-	3,964,689.29	448,089,183
合計			47,452.894	-	3,964,689.29	448,089,183

(注1) 投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数字は、証券数を表示しております。

(注2) 通貨の表示に関しては、その通貨の表記単位で表示しております。

(注3) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する 比率
米ドル	投資証券 1 銘柄	100.0%	100.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)



## （参考）

当ファンドは、「BNPパリバ日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」の投資信託受益証券及び「Parvest Bond Asia ex-Japan」の投資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」及び「投資証券」は、すべてこれらの投資信託受益証券及び投資証券であります。

1. 「BNPパリバ日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」の状況  
 なお、以下に掲載した情報は当ファンドの監査の対象外であります。

## （1）貸借対照表

区 分	注記 番号	（平成30年3月23日現在）	（平成30年9月21日現在）
		金 額（円）	金 額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		179,951,946	353,088
国債証券		-	500,191
流動資産合計		179,951,946	853,279
資産合計		179,951,946	853,279
負債の部			
流動負債			
未払利息		468	-
未払受託者報酬		57	380
未払委託者報酬		526	3,472
流動負債合計		1,051	3,852
負債合計		1,051	3,852
純資産の部			
元本等			
元本		180,853,698	853,698
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		902,803	4,271
元本等合計		179,950,895	849,427
純資産合計		179,950,895	849,427
負債純資産合計		179,951,946	853,279

## （2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として、金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合は、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日または直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格提供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>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な時価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、もしくは受託者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>
-----------------	---

## (一口当たり情報に関する注記)

(平成30年3月23日現在)		(平成30年9月21日現在)	
一口当たり純資産額	0.9950 円	一口当たり純資産額	0.9950 円
(一万口当たり純資産額	9,950 円)	(一万口当たり純資産額	9,950 円)

## (3) 有価証券組入明細

種類	銘柄名	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第728回国庫短期証券	500,000	500,191	
合計		500,000	500,191	

## 2. 「Parvest Bond Asia ex-Japan」の状況

以下に記載した情報は、委託会社が同投資証券のマネージメント・カンパニーであるBNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourgからの情報に基づき、これらの投資証券の直近会計年度末である平成29年12月31日の状況を掲記したものであります。従って、現地の法律に基づいて作成された正式財務諸表とは、同一の様式ではありません。

なお、以下に掲載した情報は当ファンドの監査の対象外であります。

## (1) 純資産計算書

純資産計算書 2017年12月31日現在	(単位: USD)
資産	
投資有価証券時価評価額	225,273,365.00
金融商品に係る未実現利益	1,586,420.00
銀行預金	56,891.00
その他資産	2,734,479.00

資産合計	229,651,155.00
負債	
オプション評価額	9,450.00
その他負債	1,475,783.00
負債合計	1,485,233.00
純資産額	228,165,922.00

## (2) 損益および純資産変動計算書

損益および純資産変動計算書 2017年12月31日に終了した会計年度	(単位：USD)
投資収益	9,859,801.00
投資顧問報酬	2,489,027.00
銀行支払利息	12,846.00
スワップ及び差金決済取引に係る純支払利息	35,441.00
その他費用	628,846.00
支払税	104,655.00
販売費用	1,063.00
取引費用	2,175.00
費用合計	3,274,053.00
投資純利益(純損失)	6,585,748.00
投資有価証券に係る実現純利益(純損失)	740,697.00
金融商品に係る実現純利益(純損失)	11,444,203.00
当期実現純利益(純損失)	18,770,648.00
投資有価証券に係る未実現評価純利益(純損失)の変動	3,493,333.00
金融商品に係る未実現評価純利益(純損失)の変動	458,057.00
運用による純資産額の純変動	22,722,038.00
当会計年度中の純発行額(純買戻額)	(79,205,897.00)
支払分配金	(3,052,923.00)
当会計年度中の純資産額の純変動	(59,536,782.00)
期首純資産	287,702,704.00
期末純資産	228,165,922.00

## (3) 一口当たりの純資産額情報

PARVEST Bond Asia ex-Japan

(通貨：USD)

	2016年12月31日	2017年12月31日
純資産額	287,702,704.00	228,165,922.00

株数 (Classic MD クラス)	606,821.138	424,906.691
一株あたり純資産額 (Classic MDクラス)	92.11	91.88

## (4) 投資有価証券明細表

2017年12月31日現在

## PARVEST Bond Asia ex-Japan

銘柄	通貨	券面	時価(USD)	純資産 比率 (%)
譲渡可能な上場又はその他規制市場取引の有価証券			221,658,952	97.15
債券			182,111,214	79.82
ヴァージン諸島			26,062,191	11.40
BLUESTAR FIN LTD 3.500% 16-30/09/2021	USD	1,500,000	1,500,343	0.66
CHINA RAILWAY 2.875% 17-25/07/2022	USD	1,500,000	1,488,104	0.65
MINMETALS BOUNTE 4.200% 16-27/07/2026	USD	4,500,000	4,605,558	2.02
SINOPEC CAPITAL 3.125% 13-24/04/2023	USD	8,550,000	8,517,702	3.72
STATE GRID OSEAS 3.500% 17-04/05/2027	USD	9,900,000	9,950,484	4.35
香港			22,632,126	9.93
CHINA TAIPING CA 4.125% 12-21/11/2022	USD	5,500,000	5,627,493	2.47
CHINA WATER AFFAIRS 5.250% 17-07/02/2022	USD	4,500,000	4,601,250	2.02
FRANSHION BRILLA 3.600% 17-03/03/2022	USD	3,500,000	3,484,821	1.53
FWD LTD 5.000% 14-24/09/2024	USD	1,850,000	1,952,975	0.86
HK ELECTRIC FINANCE 2.875% 16-03/05/2026	USD	2,700,000	2,602,521	1.14
ICBCIL FINANCE 2.500% 16-29/09/2021	USD	4,500,000	4,363,066	1.91
インドネシア			22,070,806	9.68
GAJAH TUNGGAL 8.375% 17-10/08/2022	USD	2,200,000	2,169,750	0.95
INDONESIA EXIMBK 3.875% 17-06/04/2024	USD	3,000,000	3,057,000	1.34
JASA MARGA 7.500% 17-11/12/2020	IDR	9,400,000,000	692,832	0.30
PERUSAHAAN LISTR 4.125% 17-15/05/2027	USD	3,600,000	3,597,624	1.58
REP OF INDONESIA 3.850% 17-18/07/2027	USD	1,000,000	1,025,230	0.45
REP OF INDONESIA 5.125% 15-15/01/2045	USD	2,000,000	2,206,280	0.97
SBSN INDO III 3.400% 17-29/03/2022	USD	2,000,000	2,029,700	0.89
SBSN INDO III 4.325% 15-28/05/2025	USD	7,000,000	7,292,390	3.20
中国			19,685,556	8.63
BAIDU INC 3.625% 17-06/07/2027	USD	2,000,000	1,977,745	0.87
CHINA EVERGRANDE 8.750% 17-28/06/2025	USD	4,200,000	4,352,250	1.91
CHN SCE PROPERTY 5.875% 17-10/03/2022	USD	2,500,000	2,425,000	1.06
COUNTRY GARDEN 4.750% 16-28/09/2023	USD	1,500,000	1,488,750	0.65

EASY TACTIC LTD 5.875% 17-13/02/2023	USD	850,000	842,563	0.37
GOLDEN EAGLE RETAIL 4.625% 13-21/05/2023	USD	2,000,000	1,875,000	0.82
HUACHEN ENERGY 6.625% 17-18/05/2020	USD	4,500,000	4,376,250	1.92
SINOPEC OVERSEAS 3.250% 17-13/09/2027	USD	2,400,000	2,347,998	1.03
ケイマン諸島			18,073,573	7.93
AVI FUNDING 3.800% 15-16/09/2025	USD	5,500,000	5,634,540	2.47
CCBL CAYMAN 1 2.750% 16-31/05/2021	USD	2,500,000	2,453,416	1.08
CDBL FUNDING 1 4.250% 14-02/12/2024	USD	4,000,000	4,151,506	1.82
CHINA OVERSEAS FIN 6.450% 14-11/06/2034	USD	2,200,000	2,732,840	1.20
EMIRATES REIT SU 5.125% 17-12/12/2022	USD	3,100,000	3,101,271	1.36
インド			13,496,568	5.91
DELHI INTERNATIONAL AIRPORT 6.125% 16-31/10/2026	USD	2,500,000	2,659,375	1.17
EX - IM BANK OF INDIA 3.125% 16-20/07/2021	USD	2,700,000	2,710,134	1.19
INDIAN RENEW ENE 7.125% 17-10/10/2022	INR	150,000,000	2,359,671	1.03
RELIANCE INDUSTRIES 3.667% 17-30/11/2027	USD	1,300,000	1,284,186	0.56
VEDANTA RESOURCES 6.125% 17-09/08/2024	USD	4,400,000	4,483,202	1.96
シンガポール			10,669,266	4.68
INDIKA ENERGY CAP 5.875% 17-09/11/2024	USD	1,620,000	1,620,000	0.71
INDIKA ENERGY CAP 6.875% 17-10/04/2022	USD	3,900,000	4,095,000	1.79
ONGC VIDESH VANK 2.875% 16-27/01/2022	USD	3,500,000	3,459,224	1.52
ONGC VIDESH VANK 3.750% 16-27/07/2026	USD	1,500,000	1,495,042	0.66
韓国			9,896,782	4.34
EXP - IMP BANK KOREA 2.375% 16-21/04/2027	USD	3,000,000	2,775,762	1.22
GS CALTEX CORP 3.000% 14-18/06/2019	USD	2,600,000	2,603,592	1.14
KOREA DEV BANK 2.000% 16-12/09/2026	USD	5,000,000	4,517,428	1.98
オランダ			9,877,339	4.32
BHARTI AIRTEL IN 5.350% 14-20/05/2024	USD	4,000,000	4,309,370	1.89
JAIN INT TRADING 7.125% 17-01/02/2022	USD	2,000,000	1,991,110	0.87
KAZAKHSTAN TEMIR 6.950% 12-10/07/2042	USD	1,100,000	1,286,109	0.56
MAJAPAHIT HOLD 7.875% 07-29/06/2037	USD	1,700,000	2,290,750	1.00
マレーシア			9,185,552	4.03
AXIATA SPV2 3.466% 15-19/11/2020	USD	2,000,000	2,025,908	0.89
PETRONAS 7.625% 96 -15/10/2026	USD	1,638,000	2,164,208	0.95
PETRONAS CAP LTD 3.125% 15-18/03/2022	USD	2,000,000	2,022,220	0.89
PETRONAS CAP LTD 7.875% 02-22/05/2022	USD	2,467,000	2,973,216	1.30
フィリピン			7,496,379	3.28

REP OF PHILIPPINES 3.700% 17-02/02/2042	USD	950,000	943,516	0.41
REP OF PHILIPPINES 5.500% 11-30/03/2026	USD	800,000	944,392	0.41
REP OF PHILIPPINES 9.500% 05-02/02/2030	USD	3,550,000	5,608,471	2.46
カザフスタン			4,551,438	2.00
KAZAKH DEVELOPMENT 9.500% 17-14/12/2020	KZT	220,000,000	659,127	0.29
KAZAKHSTAN TEMIR 4.850% 17-17/11/2027	USD	300,000	312,417	0.14
KAZMUNAYGAS NAT 4.750% 17-19/04/2027	USD	3,400,000	3,579,894	1.57
バーレーン			2,922,600	1.28
BAHRAIN 6.750% 17-20/09/2029	USD	700,000	689,864	0.30
BAHRAIN 7.000% 16-12/10/2028	USD	2,200,000	2,232,736	0.98
カナダ			1,549,800	0.68
NEXEN INC 7.400% 98-01/05/2028	USD	1,200,000	1,549,800	0.68
パキスタン			1,458,600	0.64
REP OF PAKISTAN 8.250% 14-15/04/2024	USD	1,320,000	1,458,600	0.64
モンゴル			1,454,118	0.64
MONGOLIA 10.875% 16-06/04/2021	USD	800,000	938,184	0.41
MONGOLIA 8.750% 17-09/03/2024	USD	450,000	515,934	0.23
アラブ首長国連邦			1,028,520	0.45
ABU DHABI CRUDE 4.600% 17-02/11/2047	USD	1,000,000	1,028,520	0.45
変動利付債			39,547,738	17.33
香港			12,675,566	5.56
BANK EAST ASIA L 14-20/11/2024 FRN	USD	4,800,000	4,857,651	2.13
BANK OF COMMUNICATIONS/HK 17-15/05/2020 FRN	USD	1,000,000	999,318	0.44
DAH SING BANKING 14-29/01/2024 FRN	USD	5,700,000	5,809,234	2.55
ICBC ASIA 13-10/10/2023 FRN	USD	1,000,000	1,009,363	0.44
韓国			10,789,899	4.73
KOREAN RE 14-21/10/2044 FRN	USD	6,200,000	6,237,200	2.73
SHINHAN BANK 16-07/12/2026 FRN	USD	4,500,000	4,552,699	2.00
シンガポール			7,701,384	3.37
OVERSEA-CHINESE 14-15/10/2024 FRN	USD	7,600,000	7,701,384	3.37
イギリス			5,011,027	2.20
ST BK INDIA/LON 17-06/04/2020 FRN	USD	5,000,000	5,011,027	2.20

ケイマン諸島			2,059,008	0.90
KRUNG THAI BANK/ 14-26/12/2024 FRN	USD	2,000,000	2,059,008	0.90
中国			1,310,854	0.57
CHINA CONSTRUCTION BANK 15-13/05/2025 FRN	USD	1,300,000	1,310,854	0.57
マネーマーケット商品			1,036,788	0.45
カザフスタン			1,036,788	0.45
NBK NOTE 0.000% 17-30/03/2018	KZT	360,000,000	1,036,788	0.45
投資証券			2,577,625	1.13
ルクセンブルク			2,577,625	1.13
BNP PARIBAS INSTICASH USD - X - CAP	USD	20,697.73	2,577,625	1.13
合計			225,273,365	98.73



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】平成30年9月28日

資産総額	457,015,391 円
負債総額	46,240 円
純資産総額( - )	456,969,151 円
発行済数量	502,115,696 口
1口当たり純資産額( / )	0.9101 円

## (参考情報)

## Parvest Bond Asia ex-Japan (平成30年9月27日)

純資産額	153.89 百万米ドル
純資産額 (CLASSIC-MD Shares)	27.06 百万米ドル
発行済株数 (CLASSIC-MD Shares)	323,337.092 株
1株当たり純資産額 (CLASSIC-MD Shares)	83.71 米ドル

## BNPパリバ日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)(平成30年9月27日)

資産総額	853,263 円
負債総額	3,853 円
純資産総額( - )	849,410 円
発行済数量	853,698 口
1口当たり純資産額( / )	0.9950 円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

#### <訂正・更新後>

##### a. 資本金の額（2018年11月末現在）

資本金の額	5億円
発行可能株式総数	500,000株
発行済株式総数	169,000株

（最近5年間における資本金の額の増減）

2014年4月18日に2億5,000万円の増資

2014年8月1日に2億5,000万円の減資

2016年7月26日に2億5,000万円の増資

2016年11月30日に2億5,000万円の減資

2018年11月21日に4億円の増資

##### b. 委託会社等の機構（2018年11月末現在）

#### （1）委託会社の機構

会社の意思決定機関として取締役会を設置しています。取締役会は、株主総会において選任された3名以上の取締役（各取締役の任期は選任後2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終結の時までです。）から構成され、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。取締役会は、原則として代表取締役が招集し、議長となります。代表取締役に事故あるときは、取締役会が予め定めた順序に従い、他の取締役がこれに代わります。取締役会の決議は、原則として、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数によって行います。

また、取締役会が決定した会社の経営方針を執行するために必要となる重要な事項についての審議及び意思決定を的確に行うことにより効果的な経営の推進を図ることを目的として、経営委員会を設置しています。

#### （2）投資運用の意思決定機構

##### 1. 委託会社の運用体制

###### ・運用部門

運用計画の策定、運用の意思決定、取引の執行、市場動向、ポートフォリオ、運用ガイドライン等のモニタリングを行います。

###### ・運用委員会

原則として月1回及び随時に開催し、投資環境や投資行動についての報告を行います。また、投資運用活動に関する協議を行い、関連する重要な情報を委員会で共有し、それによって当社の投資運用に関わる業務を効果的に推進します。

###### ・リスク管理委員会

原則として月1回及び随時に開催し、運用パフォーマンスと投資リスクの状況及び約款・投資ガイドラインの遵守状況等の報告を行います。また、投資リスク及びオペレーショナル・リスクなどに関する協議を行い、また関連する重要な情報を委員会で共有し、それによって当社の日常業務におけるリスク管理を効果的に推進します。

###### ・法務・コンプライアンス及びリスク管理部門

取引内容の法令遵守状況の確認を行い、必要に応じて指導、勧告を行うとともに内部管理委員会等に報告を行います。また、法令遵守状況の監視及び定期的な確認、法令及びコンプライアンスに関する情報の役職員への提供、研修の実施等を行います。

###### ・内部管理委員会

原則として月1回及び随時に開催し、各部署における自主検査の実施状況及び結果の報告、独立した専任部署による投資リスク、オペレーショナル・リスク、コンプライアンス・リスクなどの管理状況の確認を行います。あわせて当社における内部管理態勢、法令等遵守態勢及びリスク管理態勢の整備を確実なものとするために必要な協議と情報共有を迅速かつ効果的に行います。

##### 2. 運用の意思決定プロセス

運用部門が独自に行う調査及びBNPパリバグループの資産運用部門が提供する内外の経済情勢及び個別企業の分析情報に基づき、運用部門において投資環境（内外経済・産業動向・株式及び債券市場・為替市場等）の分析を行います。

運用部門のファンド・マネジャーは、以上の分析結果をふまえ、各ファンドの運用の基本方針にしたがって具体的な投資方針を決定し、その投資方針に基づく具体的な運用戦略や投資計画を作成し実際の投資行動を行います。

運用を外部に委託するファンドにおいては、原則として、委託先が約款上の運用の基本方針にしたがって独自に運用戦略や投資計画を作成し運用の指図を行います。

運用内容やファンド・マネジャーの投資行動のチェックは、運用部門から独立した管理部門のスタッフがこれを担当し、運用部門へのフィードバック及び担当取締役への報告を行うことにより、質の高い運用体制を維持できるように努めます。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

### <訂正・更新後>

委託会社は、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として、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・代理業務及び第二種金融商品取引業務を行っています。

委託会社が運用するファンドの本数及び純資産総額合計額は以下の通りです。（2018年11月末現在）

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額(単位：億円)
追加型株式投資信託	27	2,225
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	6	363
単位型公社債投資信託	3	2
合計	36	2,591

純資産総額合計額の金額については、億円未満の端数を切り捨てして記載しており、表中の個々の金額と合計欄の金額は一致しないことがあります。

## 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」につきまして、該当部分を以下内容に更新・訂正するとともに、末尾に「中間財務諸表」を追加します。

## &lt;更新・訂正後&gt;

1. 当社の財務諸表は、「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。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満を切り捨てて記載しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期事業年度（平成29年1月1日から平成29年12月31日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。第21期事業年度（平成30年1月1日から平成30年12月31日まで）に係る中間会計期間（平成30年1月1日から平成30年6月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

期別		第21期中間会計期間末 (平成30年6月30日現在)	
資産の部			
科目	注記 番号	内訳	金額
		千円	千円
流動資産			
預金			681,446
前払費用			5,435
未収委託者報酬			241,100
未収運用受託報酬			86,218
未収収益			138,034
立替金			762
流動資産計			1,152,998
固定資産			
投資その他の資産			13,317
長期差入保証金		7,317	
その他		6,000	
固定資産計			13,317
資産合計			1,166,316

期別		第21期中間会計期間末 (平成30年6月30日現在)	
負債の部			
科目	注記 番号	内訳	金額
		千円	千円
流動負債			
預り金			30,767
未払金			300,890
未払手数料		40,745	
未払委託調査費		184,406	
その他未払金		75,738	
未払費用			100,014
未払法人税等			1,900
未払消費税等	* 1		6,970
賞与引当金			56,232
役員賞与引当金			15,009
流動負債計			511,783
固定負債			
退職給付引当金			222,539
役員退職慰労引当金			9,745
資産除去債務			105,755
固定負債計			338,040
負債合計			849,823
純資産の部			
科目	注記 番号	内訳	金額
		千円	千円
株主資本			
資本金			100,000
資本剰余金			846,165
資本準備金		50,000	
その他資本剰余金		796,165	
利益剰余金			629,672
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		629,672	
株主資本合計			316,493
純資産合計			316,493
負債・純資産合計			1,166,316

## ( 2 ) 中間損益計算書

期 別		第21期中間会計期間 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年 6月30日	
科 目	注記 番号	内 訳	金 額
		千円	千円
営業収益			
委託者報酬			490,391
運用受託報酬			178,028
その他営業収益			254,917
営業収益計			923,337
営業費用			
支払手数料			146,006
広告宣伝費			149
調査費			250,619
調査研究費		14,159	
委託調査費		236,460	
委託計算費			36,049
営業雑経費			9,583
印刷費		7,547	
協会費		2,036	
営業費用計			442,409
一般管理費			
給料			391,707
役員報酬		20,081	
給料・手当		365,323	
賞与		6,301	
業務委託費			124,913
交際費			1,415
旅費交通費			9,313
租税公課			811
不動産賃借料			102,477
賞与引当金繰入額			48,701
役員賞与引当金繰入額			4,548
退職給付費用			26,695
役員退職慰労引当金繰入額			1,077
諸経費			76,590
一般管理費計			788,253
営業損失			307,324

期 別		第21期中間会計期間 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年 6月30日	
科 目	注記 番号	内 訳	金 額
		千円	千円
営業外収益			
受取利息			0
為替差益			1,312
雑益			1,440
営業外収益計			2,753
営業外費用			
雑損失			110
営業外費用計			110
経常損失			304,682
特別損失			
割増退職金			1,646
特別損失計			1,646
税引前中間純損失			306,329
法人税、住民税及び事業税			1,900
中間純損失			308,229

## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

第21期中間会計期間  
自 平成30年 1月 1日  
至 平成30年 6月30日

( 単位：千円 )

	株主資本							純資産合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		株主資本 合計	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	100,000	50,000	796,165	846,165	321,443	321,443	624,722	624,722
当中間期変動額								
中間純損失					308,229	308,229	308,229	308,229
当中間期変動額合計	-	-	-	-	308,229	308,229	308,229	308,229
当中間期末残高	100,000	50,000	796,165	846,165	629,672	629,672	316,493	316,493



## 重要な会計方針

第21期中間会計期間 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年 6月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。</p>
2. 引当金の計上基準	<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等を、貸倒懸念債権等の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員への賞与支給に備えるため、支給見込み額のうち当中間会計期間に負担すべき額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員への賞与支給に備えるため、支給見込み額のうち当中間会計期間に負担すべき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、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。退職給付引当金及び退職給付費用の計算については、退職給付に係る当中間会計期間末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支出に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>
3. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末の直物為替相場により円換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第21期中間会計期間末 (平成30年6月30日現在)
* 1 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の未払消費税等として表示しております。

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第21期中間会計期間 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年 6月30日				
1. 発行済株式に関する事項				
株式の種類	当期首株式数 (株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	89,000	-	-	89,000
2. 配当に関する事項				
該当事項はありません。				

## (リース取引関係)

第21期中間会計期間 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年 6月30日
オペレーティング・リース取引は次のとおりであります。 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものにかかる未経過リース料 (借主側) 1年内 82,168 千円 1年超 1,418 千円 合 計 83,587 千円

## (金融商品関係)

第21期中間会計期間末  
(平成30年6月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30年6月30日における中間貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。  
(単位:千円)

科 目	中間貸借対照表 計上額	時 価	差 額
預 金	681,446	681,446	-
未収委託者報酬	241,100	241,100	-
未収運用受託報酬	86,218	86,218	-
未収収益	138,034	138,034	-
資産計	1,146,800	1,146,800	-
未払手数料	40,745	40,745	-
未払委託調査費	184,406	184,406	-
その他未払金	75,738	75,738	-
未払費用	100,014	100,014	-
負債計	400,904	400,904	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法

## (1)預金

預金はすべて短期であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (2)未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益

これらの営業債権はすべて短期であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (3)未払手数料、未払委託調査費

これらの営業債務はすべて短期であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (4)その他未払金、未払費用

これらの債務はすべて短期であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （有価証券関係）

第21期中間会計期間末  
(平成30年6月30日現在)

重要性が低いと判断されたため記載を省略しております。

## （デリバティブ取引関係）

第21期中間会計期間末  
(平成30年6月30日現在)

該当事項はありません。

## （資産除去債務関係）

第21期中間会計期間  
自 平成30年 1月 1日  
至 平成30年 6月30日

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの  
当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	105,136千円
時の経過による調整額	<u>618千円</u>
当中間会計期間末残高	105,755千円

## （セグメント情報等）

第21期中間会計期間 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年 6月30日				
（セグメント情報） 当社は、投信投資顧問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）				
1. 製品及びサービスごとの情報				
（単位：千円）				
	投資信託業	投資顧問業	その他	合計
外部顧客への 営業収益	490,391	178,028	254,917	923,337
2. 地域ごとの情報				
(1) 営業収益				
（単位：千円）				
日 本	オランダ	ルクセンブルク	その他	合計
583,657	119,870	136,849	82,959	923,337
(注) 投資信託業の営業収益に関しては販売拠点、投資顧問業とその他の営業収益については契約先所在地を基に記載しております。				
(2) 有形固定資産 該当事項はありません。				
3. 主要な顧客ごとの情報				
（単位：千円）				
顧客の名称	営業収益	関連するセグメント名		
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり （適格機関投資家専用）	159,486	なし		
BNPパリバ・アセットマネジメント・ルクセンブルク	136,849	なし		
BNPパリバ・アセットマネジメント・ネーデルラント N.V.	119,870	なし		
（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およ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。				

## (1株当たり情報)

第21期中間会計期間	
自 平成30年 1月 1日	
至 平成30年 6月30日	
1株当たり純資産額	3,556円
1株当たり中間純損失	3,463円
1株当たり中間純損失の算定上の基礎	
中間純損失	308,229千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純損失	308,229千円
期中平均株式数	普通株式 89,000株
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純損失金額については、希薄化効果を有している潜在株式を発行していないため記載しておりません。	

## 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「第三部 委託会社等の情報 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」につきまして、以下の内容に訂正・更新します。

## (1) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：324,037百万円（2018年3月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

・名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・資本金の額：51,000百万円（2018年3月末現在）

・業務の概要：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。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
エース証券株式会社	8,831百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
浜銀TT証券株式会社	3,307百万円	
播陽証券株式会社	112百万円	
PWM日本証券株式会社	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	8,557百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社北海道銀行	93,524百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年11月21日

BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田光夫  
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BNPパリバ アジア・ボンド・ファンド（為替ヘッジなし）の平成30年3月27日から平成30年9月25日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、BNPパリバ アジア・ボンド・ファンド（為替ヘッジなし）の平成30年9月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

BNPパリバ・アセットマネジメント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。

2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)



独立監査人の中間監査報告書

平成30年9月12日

BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	正田 誠	印
--------------------	-------	------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているBNPパリバ・アセットマネジメント株式会社の平成30年1月1日から平成30年12月31日までの第21期事業年度の中間会計期間（平成30年1月1日から平成30年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

## 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社の平成30年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年1月1日から平成30年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、当社が、中間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。

2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。