

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年10月17日提出
【発行者名】	岡三アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 綿川 昌明
【本店の所在の場所】	東京都中央区京橋二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	中田 尚孝
【電話番号】	03-3516-1432
【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】	<中京>アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附付）
【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】	継続募集額(平成29年4月18日から平成30年4月19日まで) 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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出しましたので、2017年 4月17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訂正するため、またその他の情報について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。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第一部【証券情報】

(4)【発行(売出)価格】

<訂正前>

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 カスタマーサービス部 0120-048-214
ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

<訂正後>

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 クライアント・サービス部 0120-048-214
ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

(12)【その他】

<訂正前>

(略)

取得申込不可日

以下に該当する日は、「取得・換金申込不可日」として、取得申込みの受付を行いません。

- ・ オーストラリア証券取引所の休業日およびその前営業日
- ・ シドニーまたはメルボルンの銀行の休業日およびその前営業日

「取得・換金申込不可日」につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。また、委託会社のホームページにも、掲載いたします。

環境保全のための寄附について

販売会社は、販売会社が受取る信託報酬の中からファンドの日々の純資産総額に対し年0.15%の率を乗じて得た額を、環境保護団体等に寄附します。

(略)

<訂正後>

(略)

取得申込不可日

以下に該当する日は、「申込不可日」として、取得申込みの受付を行いません。

- ・ オーストラリア証券取引所の休業日およびその前営業日
- ・ シドニーまたはメルボルンの銀行の休業日およびその前営業日

「申込不可日」につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。また、委託会社のホームページにも、掲載いたします。

環境保全のための寄附について

販売会社は、販売会社が受取る信託報酬の中からファンドの日々の純資産総額に対し年0.15%の率を乗じて得た額を、環境保護団体等に寄附します。

（略）

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成25年3月27日 投資信託契約締結、設定、運用開始

<訂正後>

2013年3月27日 投資信託契約締結、設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況（平成29年1月末日現在）

資本金

10億円

委託会社の沿革

昭和39年10月 6日

「日本投信委託株式会社」設立

昭和62年 6月27日

第三者割当増資の実施（新資本金 4億5,000万円）

平成 2年 6月30日

第三者割当増資の実施（新資本金 10億円）

平成20年 4月 1日

岡三投資顧問株式会社と合併し、商号を「岡三アセットマネジメント株式会社」に変更

大株主の状況

名 称	住 所	持株数	持株比率
岡三興業株式会社	東京都中央区日本橋小網町9番9号	253,400株	30.71%
株式会社岡三証券グループ	東京都中央区日本橋1丁目17番6号	174,801株	21.19%
株式会社りそな銀行	大阪府中央区備後町2丁目2番1号	41,150株	4.99%
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内1丁目4番5号	41,150株	4.99%
株式会社みずほ銀行	東京都千代田区大手町1丁目5番5号	41,149株	4.99%

<訂正後>

(略)

委託会社の概況（2017年7月末日現在）

資本金

10億円

委託会社の沿革

1964年10月 6日

1987年 6月27日

1990年 6月30日

2008年 4月 1日

「日本投信委託株式会社」設立

第三者割当増資の実施（新資本金 4億5,000万円）

第三者割当増資の実施（新資本金 10億円）

岡三投資顧問株式会社と合併し、商号を「岡三アセットマネ
ジメント株式会社」に変更

大株主の状況

名 称	住 所	持株数	持株比率
岡三興業株式会社	東京都中央区日本橋小網町9番9号	253,400株	30.71%
株式会社岡三証券グループ	東京都中央区日本橋1丁目17番6号	174,801株	21.19%
株式会社りそな銀行	大阪市中央区備後町2丁目2番1号	41,150株	4.99%
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内1丁目4番5号	41,150株	4.99%
株式会社みずほ銀行	東京都千代田区大手町1丁目5番5号	41,149株	4.99%

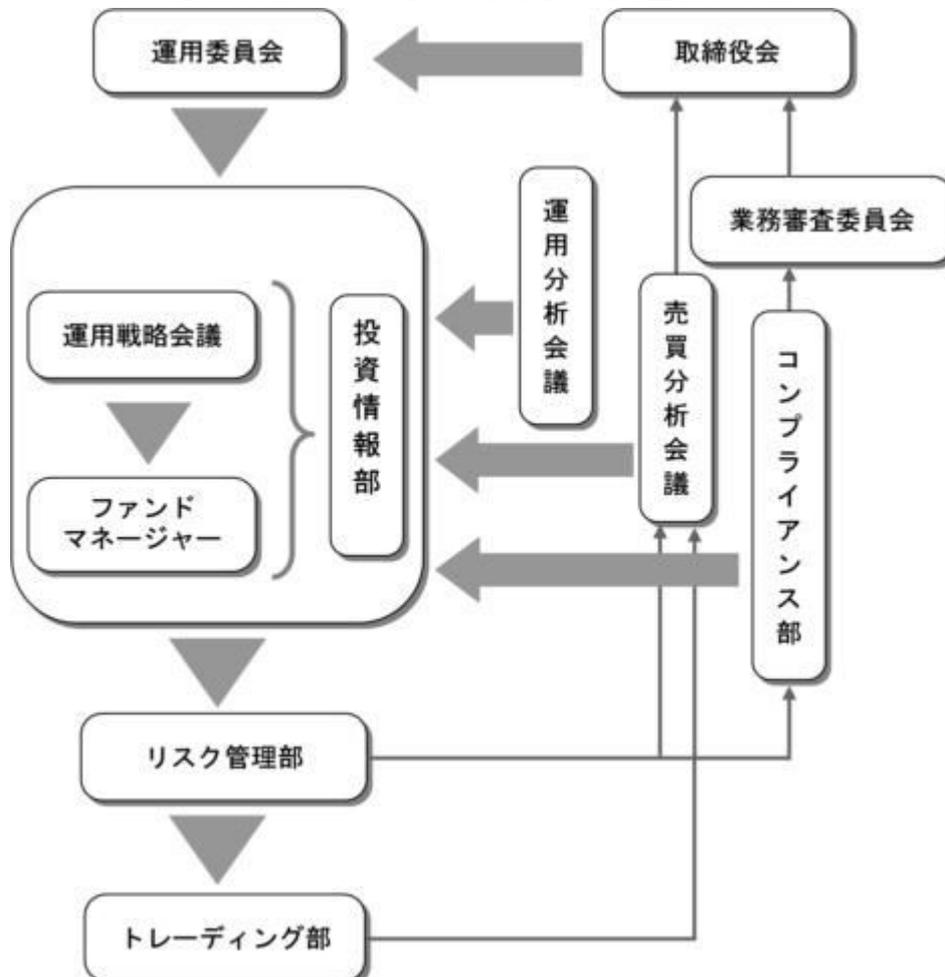
2【投資方針】

(3)【運用体制】

<更新後>

運用体制、内部管理および意思決定を監督する組織

ファンドの運用体制、内部管理および意思決定を監督する組織は、以下のようになります。



会議名または部署名	役割
運用委員会 (月1回開催)	運用本部で開催する「ストラテジー会議」で策定された投資環境分析と運用の基本方針案に基づいて検討を行い、運用の基本方針を決定します。また、運用に関する内規の制定及び改廃のほか、運用ガイドライン等運用のリスク管理に関する事項を決定します。
運用戦略会議 (月1回開催)	運用各部署より運用委員会で決定された運用の基本方針に基づいた個別ファンドの具体的な投資戦略が報告され、その内容について検討を行います。
運用担当部署	ファンドマネージャーは、運用戦略会議で検討された投資戦略に基づき、ファンド毎に具体的な運用計画を策定し、運用計画書・運用実施計画に基づいて、運用の指図を行います。
投資情報部	国内外のマクロ経済・セミマクロ経済の調査・分析、市場環境の分析等をもとに、ファンドマネージャーに情報提供を行うことで、運用をサポートします。また、投資者に経済情勢等に関するタイムリーな情報を発信します。
運用分析会議 (月1回開催)	運用のパフォーマンス向上、運用の適正性の確保、および運用のリスク管理に資することを目的に、個別ファンドの運用パフォーマンスを分析・検証・評価し、運用本部にフィードバックを行います。
売買分析会議 (月1回開催)	運用財産に係る運用の適切性確保に資することを目的にファンドの有価証券売買状況や組入れ状況など、日々、リスク管理部、トレーディング部が行っている運用の指図に関するチェック状況の報告・指摘を行います。議長は会議の結果を取締役会へ報告します。
業務審査委員会 (原則月1回開催)	運用の指図において発生した事務処理ミスや社内規程等に抵触した事項などについて、審議・検討を行います。委員長は審議・検討結果を取締役会へ報告します。
コンプライアンス部 (3名程度)	運用業務にかかわる関係法令及び社内諸規則等の遵守状況の検証並びに検証に基づく運用本部への指導を行います。
リスク管理部 (7名程度)	「運用の指図に関する検証規程」に基づき、投資信託財産の運用の指図につき、法令諸規則等に定める運用の指図に関する事項の遵守状況の確認を行います。発注前の検証として、発注内容が法令諸規則等に照らして適切であるのか伝票又はオーダー・マネジメント・システムのコンプライアンスチェック機能を利用して確認を行い、発注後の検証として、運用指図結果の適法性又は適正性について確認を行います。
トレーディング部 (8名程度)	有価証券、デリバティブ取引に係る権利等の発注に関し、法令諸規則等に基づいて最良執行に努めています。また、運用指図の結果について最良執行の観点からの検証・分析を行います。

社内規程

委託会社では、ファンドの運用に関する社内規程において、運用を行うに当たって遵守すべき事項等を定め、ファンドの商品性に則った適切な運用を行っています。

また、委託会社では、リスク管理規程において、運用に関するリスク管理方針を定め、運用本部及び運用本部から独立した部署が、運用の指図について運用の基本方針や法令諸規則等に照らして適切かどうかのモニタリング・検証を通じて、運用リスクの管理を行っています。

ファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

「受託会社」または「再信託受託会社」に対しては、日々の基準価額および純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。

委託会社は、他の運用会社が運用の指図を行う投資対象ファンドについて、ファンド運営の適切性、運用の継続性等を確認したうえで投資を行うとともに、運用成績等に関するモニタリングを行っています。

運用体制等につきましては、2017年7月末日現在のものであり、変更になることがあります。

3【投資リスク】

(参考情報)

< 更新後 >

(参考情報)

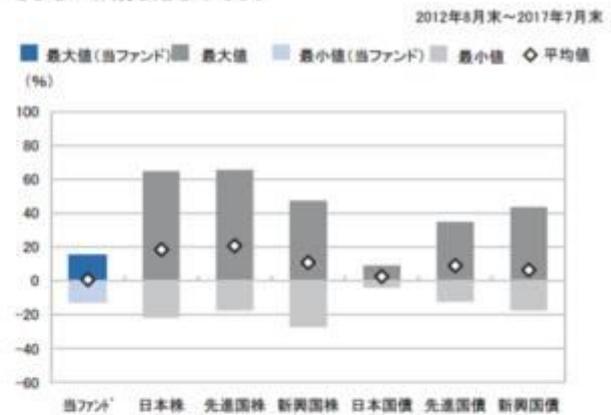
ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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ものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
*年間騰落率は、2014年3月から2017年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

グラフは、ファンドと代表的な資産のリスクを定量的に比較できるように作成したものです。



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	15.3	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△12.9	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	0.8	18.6	20.8	10.8	2.6	9.1	6.5

*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。
*2012年8月から2017年7月の5年間(当ファンドは2014年3月から2017年7月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
*決算日に対応した数値とは異なります。
*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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-KOKUSAI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・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債・・・JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

<訂正前>

(略)

「分配金再投資コース」の取得申込者が、収益分配金の再投資によりファンドを買付ける場合には、無手数料とします。詳細につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 カスタマーサービス部 0120-048-214

ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

<訂正後>

(略)

「分配金再投資コース」の取得申込者が、収益分配金の再投資によりファンドを買付ける場合には、無手数料とします。詳細につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 クライアント・サービス部 0120-048-214

ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度、未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。

個人受益者に対する課税

収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金は、配当所得として、以下の税率による源泉徴収が行われます。確定申告は不要ですが、確定申告による総合課税または申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

償還金および解約金に対する課税

償還価額および解約価額から取得費（申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益は、譲渡所得となり、以下の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）をご利用の場合には、原則として確定申告は不要です。

償還時および解約時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能です。

償還時および解約時の差益（譲渡益）については、他の上場株式等の譲渡損と相殺することができ、損益通算が可能となります。

また、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等との損益通算も可能です。

2037年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額×2.1%相当額）がかかります。

期間	税率
2014年1月1日以降 2037年12月31日まで	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、地方税5%）

法人受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに償還時及び解約時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

2037年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額×2.1%相当額）がかかります。

期間	税率
2014年1月1日以降 2037年12月31日まで	15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）
2038年1月1日以降	15%（所得税15%）

普通分配金、元本払戻金（特別分配金）とは

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。

基準価額（分配落）が受益者の個別元本と同額の場合または上回っている場合には、分配金の全額が普通分配金となります。

基準価額（分配落）が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、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。元本払戻金（特別分配金）は、元本の一部払戻しに相当し、非課税扱いとなります。

個別元本とは

個別元本とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額（申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均されます。

ただし、複数の販売会社でファンドを買付けた場合は、販売会社ごとに個別元本の算出が行われます。

また、同一販売会社であっても、複数口座でファンドを買付けた場合には口座ごとに、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」を併用する場合にはコースごとに、個別元本の算出が行われることがあります。

受益者が、元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、個別元本は、分配金発生時の個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額となります。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

毎年、一定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が一定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が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

その他

- ・ 配当控除の適用はありません。
- ・ 買取請求による換金の場合の課税上の取扱い及び損益通算等につきましては、取得申込みを取り扱った販売会社にお問い合わせ下さい。

上記の内容は2017年7月末日現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合には変更になることがあります。課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

2017年 7月31日現在の運用状況は、以下の通りです。

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をいいます。また、小数点以下第3位を四捨五入しており、合計と合わない場合があります。

【＜中京＞アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附付）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	424,099,949	79.84
親投資信託受益証券	日本	88,560,034	16.67
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		18,542,735	3.49
合計（純資産総額）		531,202,718	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 （円）	帳簿価額 金額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	投資信託受益証券	LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）	808,425,370	0.5294	427,980,390	0.5246	424,099,949	79.84
2	日本	親投資信託受益証券	アジア・ニュージーランド債券マザーファンド	60,599,449	1.4667	88,881,211	1.4614	88,560,034	16.67

（種類別投資比率）

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	79.84
親投資信託受益証券	16.67
合計	96.51

【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】

	純資産総額(円)		基準価額(円) (1口当たり)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間末 (2013年 7月22日)	1,067,020,057	1,089,574,245	0.9296	0.9496
第2特定期間末 (2014年 1月20日)	1,030,222,687	1,101,407,377	0.8694	0.9294
第3特定期間末 (2014年 7月22日)	1,009,963,300	1,081,469,861	0.8713	0.9313
第4特定期間末 (2015年 1月20日)	944,156,324	1,011,706,809	0.8601	0.9201
第5特定期間末 (2015年 7月21日)	851,422,024	919,290,965	0.7604	0.8204
第6特定期間末 (2016年 1月20日)	690,216,280	755,961,300	0.6304	0.6904
第7特定期間末 (2016年 7月20日)	612,605,472	660,293,108	0.5966	0.6416
第8特定期間末 (2017年 1月20日)	593,512,261	623,785,053	0.6005	0.6305
第9特定期間末 (2017年 7月20日)	538,837,201	567,436,488	0.5890	0.6190
2016年 7月末日	607,123,263		0.5910	
8月末日	596,472,379		0.5804	
9月末日	578,494,220		0.5694	
10月末日	584,186,880		0.5754	
11月末日	597,977,792		0.5915	
12月末日	582,674,353		0.5887	
2017年 1月末日	586,831,772		0.5961	
2月末日	580,582,937		0.5933	
3月末日	570,398,686		0.5864	
4月末日	548,444,614		0.5693	
5月末日	537,125,999		0.5686	
6月末日	531,299,108		0.5798	
7月末日	531,202,718		0.5841	

【分配の推移】

	期間	分配金 (1口当たり)
第1特定期間	2013年 3月27日～2013年 7月22日	0.0200円
第2特定期間	2013年 7月23日～2014年 1月20日	0.0600円
第3特定期間	2014年 1月21日～2014年 7月22日	0.0600円
第4特定期間	2014年 7月23日～2015年 1月20日	0.0600円
第5特定期間	2015年 1月21日～2015年 7月21日	0.0600円
第6特定期間	2015年 7月22日～2016年 1月20日	0.0600円
第7特定期間	2016年 1月21日～2016年 7月20日	0.0450円
第8特定期間	2016年 7月21日～2017年 1月20日	0.0300円
第9特定期間	2017年 1月21日～2017年 7月20日	0.0300円

【収益率の推移】

	期間	収益率(%)
第1特定期間	2013年 3月27日～2013年 7月22日	5.0
第2特定期間	2013年 7月23日～2014年 1月20日	0.0
第3特定期間	2014年 1月21日～2014年 7月22日	7.1
第4特定期間	2014年 7月23日～2015年 1月20日	5.6
第5特定期間	2015年 1月21日～2015年 7月21日	4.6
第6特定期間	2015年 7月22日～2016年 1月20日	9.2
第7特定期間	2016年 1月21日～2016年 7月20日	1.8
第8特定期間	2016年 7月21日～2017年 1月20日	5.7
第9特定期間	2017年 1月21日～2017年 7月20日	3.1

(注) 収益率は期間騰落率です。小数点以下第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

期間	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	1,150,783,611	2,940,879
第2特定期間	120,118,705	82,939,932
第3特定期間	163,243,909	189,175,430
第4特定期間	104,501,130	165,832,622
第5特定期間	161,821,253	139,883,353
第6特定期間	29,751,957	54,553,918
第7特定期間	7,856,305	75,873,922
第8特定期間	2,731,588	41,227,241
第9特定期間	3,185,528	76,721,029

（参考）

アジア・ニュージーランド債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	ニュージーランド	3,437,055,646	35.51
	マレーシア	2,023,613,732	20.91
	タイ	268,636,952	2.78
	インドネシア	3,197,487,069	33.03
	韓国	201,508,364	2.08
	小計	9,128,301,763	94.31
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		550,979,587	5.69
合計（純資産総額）		9,679,281,350	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 （円）	帳簿価額 金額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
1	ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GVT 5.5	17,000,000	9,616.31	1,634,772,793	9,566.70	1,626,340,096	5.5	2023年4月15日	16.80
2	ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GVT 6	10,000,000	9,485.33	948,533,250	9,409.68	940,968,210	6	2021年5月15日	9.72
3	ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GVT 5	10,000,000	8,811.18	881,118,114	8,697.47	869,747,340	5	2019年3月15日	8.99
4	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 11	70,000,000,000	0.92	646,577,470	0.93	652,840,650	11	2020年11月15日	6.74
5	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 12.8	60,000,000,000	0.98	593,755,440	0.99	598,302,180	12.8	2021年6月15日	6.18
6	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 7.875	65,000,000,000	0.83	540,886,515	0.84	550,824,105	7.875	2019年4月15日	5.69

7	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT 5.734	20,000,000	2,702.92	540,585,976	2,690.32	538,064,692	5.734	2019年7 月30日	5.56
8	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT 4.378	20,000,000	2,592.59	518,518,296	2,628.86	525,772,788	4.378	2019年11 月29日	5.43
9	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT 4.048	20,000,000	2,550.95	510,191,356	2,607.75	521,550,024	4.048	2021年9 月30日	5.39
10	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 10.25	31,000,000,000	0.92	285,726,504	0.94	293,242,237	10.25	2022年7 月15日	3.03
11	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.654	10,000,000	2,581.09	258,109,360	2,587.69	258,769,328	3.654	2019年10 月31日	2.67
12	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 7	30,000,000,000	0.82	248,308,610	0.83	251,221,080	7	2022年5 月15日	2.60
13	韓国	国債証券	KOREA TRSY BD 5.5	2,000,000,000	10.23	204,703,792	10.07	201,508,364	5.5	2017年9 月10日	2.08
14	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 11.5	20,000,000,000	0.91	182,804,180	0.90	181,471,200	11.5	2019年9 月15日	1.87
15	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 8.375	20,000,000,000	0.85	170,565,000	0.89	178,109,700	8.375	2024年3 月15日	1.84
16	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 5.625	20,000,000,000	0.78	156,040,000	0.77	155,777,720	5.625	2023年5 月15日	1.61
17	タイ	国債証券	THAILAND GOVT 3.45	40,000,000	344.11	137,647,437	340.93	136,375,972	3.45	2019年3 月8日	1.41
18	タイ	国債証券	THAILAND GOVT 1.875	40,000,000	327.27	130,909,029	330.65	132,260,980	1.875	2022年6 月17日	1.37
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT 4.012	5,000,000	2,591.25	129,562,546	2,581.94	129,097,217	4.012	2017年9 月15日	1.33
20	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 12.9	10,000,000,000	1.01	101,718,990	1.03	103,547,480	12.9	2022年6 月15日	1.07
21	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 11.6	10,000,000,000	0.88	88,502,900	0.87	87,318,490	11.6	2018年8 月15日	0.90
22	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 5.25	10,000,000,000	0.80	80,498,380	0.82	82,503,660	5.25	2018年5 月15日	0.85
23	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOV'T 11.75	6,100,000,000	0.99	60,680,054	1.02	62,328,567	11.75	2023年8 月15日	0.64
24	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.48	2,000,000	2,534.94	50,698,948	2,517.98	50,359,683	3.48	2023年3 月15日	0.52

(種類別投資比率)

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	94.31
合計	94.31

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。

LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）

(1) [投資状況]

資産の種類	国名/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	オーストラリア	37,857,644,196	16.08
地方債証券	カナダ	2,468,041,257	1.05
	オーストラリア	51,647,879,110	21.94
	ニュージーランド	484,494,691	0.21
	小計	54,600,415,058	23.20
特殊債券	ドイツ	9,035,073,243	3.84
	スウェーデン	576,659,160	0.25
	ノルウェー	2,081,440,010	0.88
	オーストラリア	2,413,071,165	1.03
	国際機関	15,289,294,621	6.50
	小計	29,395,538,199	12.49
社債券	日本	213,069,600	0.09
	アメリカ	11,386,195,187	4.84
	カナダ	2,728,951,750	1.16
	フランス	2,065,544,520	0.88
	オランダ	6,353,843,853	2.70
	フィンランド	195,043,068	0.08
	イギリス	2,793,006,942	1.19
	スイス	2,879,148,678	1.22
	スウェーデン	1,115,205,935	0.47
	オーストラリア	69,582,589,125	29.56

	ニュージーランド	2,354,785,816	1.00
	香港	361,359,449	0.15
	韓国	4,264,436,082	1.81
	アラブ首長国連邦	1,129,916,694	0.48
	小計	107,423,096,699	45.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,087,973,852	2.59
合計(純資産総額)		235,364,668,004	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	オーストラリア	11,983,316,638	5.09
	売建	オーストラリア	9,885,733,913	4.20

(注)その他の資産として、先物取引を利用しております。評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

(2) [投資資産]

[投資有価証券の主要銘柄]

a. 上位30銘柄

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA GOVT	55,100,000	10,355.14	5,705,686,217	10,360.77	5,708,785,923	4.750	2027/4/21	2.43
2	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA GOVT	62,060,000	9,166.65	5,688,823,921	9,184.14	5,699,679,518	3.250	2029/4/21	2.42
3	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA GOVT	56,000,000	9,900.44	5,544,246,792	9,907.64	5,548,283,160	4.250	2026/4/21	2.36
4	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA GOVT	51,220,000	10,400.94	5,327,363,158	10,422.47	5,338,393,641	4.500	2033/4/21	2.27
5	オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY	40,500,000	9,552.00	3,868,562,065	9,569.32	3,875,575,167	4.250	2023/7/21	1.65
6	オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY	39,000,000	9,833.37	3,835,015,470	9,839.26	3,837,312,297	5.500	2021/6/21	1.63
7	オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREAS CORP	32,000,000	10,091.62	3,229,319,424	10,108.41	3,234,691,872	5.000	2024/8/20	1.37

8	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	36,500,000	8,363.94	3,052,841,276	8,383.98	3,060,156,314	2.250	2028/5/21	1.30
9	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	35,700,000	8,253.45	2,946,484,649	8,277.19	2,954,957,330	2.750	2035/6/21	1.26
10	オーストラリア	地方債証券	VICTORIA TREASURY	27,500,000	10,323.94	2,839,084,298	10,333.26	2,841,646,583	6.000	2022/10/17	1.21
11	オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY	26,500,000	10,420.19	2,761,351,251	10,441.64	2,767,034,865	5.750	2024/7/22	1.18
12	オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREAS CORP	24,100,000	10,180.13	2,453,413,379	10,186.81	2,455,023,355	6.000	2022/3/1	1.04
13	オーストラリア	地方債証券	WESTERN AUST TREAS CORP	23,500,000	10,403.05	2,444,717,432	10,418.61	2,448,373,632	6.000	2023/10/16	1.04
14	オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY	23,500,000	10,225.75	2,403,053,271	10,244.04	2,407,349,823	6.000	2022/7/21	1.02
15	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	30,180,000	7,870.82	2,375,416,403	7,885.15	2,379,740,503	3.000	2047/3/21	1.01
16	オーストラリア	地方債証券	WEST AUSTRALIA TREASURY	22,750,000	9,974.97	2,269,307,927	10,012.60	2,277,866,750	5.000	2025/7/23	0.97
17	オーストラリア	地方債証券	VICTORIA TREASURY	22,100,000	9,752.68	2,155,342,457	9,745.64	2,153,788,385	6.000	2020/6/15	0.92
18	オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY	22,100,000	9,709.52	2,145,804,340	9,698.71	2,143,414,954	6.250	2020/2/21	0.91
19	オーストラリア	地方債証券	VICTORIA TREASURY	20,500,000	10,418.96	2,135,887,375	10,435.40	2,139,257,021	5.500	2024/12/17	0.91
20	オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREAS CORP	20,600,000	9,719.63	2,002,243,863	9,710.66	2,000,396,908	6.000	2020/5/1	0.85
21	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA GOVT	21,000,000	9,218.77	1,935,943,002	9,231.25	1,938,564,180	3.250	2025/4/21	0.82
22	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	20,100,000	9,399.41	1,889,281,551	9,414.17	1,892,249,758	3.750	2037/4/21	0.80
23	オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY CORP	18,500,000	9,900.79	1,831,646,575	9,937.79	1,838,492,667	4.750	2025/7/21	0.78
24	オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY	15,500,000	8,879.92	1,376,387,863	8,920.17	1,382,627,884	3.250	2026/7/21	0.59
25	イギリス	社債券	BARCLAYS BANK PLC/AUST	15,000,000	9,048.33	1,357,250,715	9,058.97	1,358,846,100	4.500	2019/4/4	0.58
26	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	15,000,000	8,806.61	1,320,991,965	8,825.33	1,323,800,370	2.750	2027/11/21	0.56
27	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVT BK	13,500,000	9,549.10	1,289,129,094	9,542.95	1,288,298,439	6.500	2019/8/7	0.55
28	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	14,500,000	8,617.78	1,249,579,368	8,629.49	1,251,276,717	3.250	2039/6/21	0.53

29	オーストラリア	地方債証券	WESTERN AUST TREAS CORP	12,000,000	10,323.85	1,238,862,600	10,321.48	1,238,577,804	7.000	2021/7/15	0.53
30	オーストラリア	社債券	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	13,000,000	9,170.95	1,192,224,618	9,186.07	1,194,190,062	4.750	2021/10/7	0.51

（注1）変動利付債券は平成29年7月末現在の利率です。

（注2）平成29年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

b.種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	16.08
地方債証券	23.20
特殊債券	12.49
社債券	45.64
合計	97.41

[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]

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資比率 (%)
債券先 物取引	オーストラリア	シドニー先 物取引所	AU 10YR 1709	買建	1,049	オーストラリアドル	134,633,847.47	11,834,315,193	135,220,086.2	11,885,845,577	5.04
			AU 20YR 1709	買建	20	オーストラリアドル	1,101,120.6	96,788,500	1,108,885.8	97,471,061	0.04
			AU 3YR 1709	売建	1,007	オーストラリアドル	112,309,743.28	9,872,026,434	112,465,687.3	9,885,733,913	4.20

（注1）評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

（注2）評価額は、平成29年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

参考情報

運用実績

2017年7月31日現在

基準価額・純資産の推移(2013年3月27日～2017年7月31日)



※基準価額は1万口当たり、信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、決算時の分配金を完課税で再投資したものと計算しております。
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配金の推移

2017年7月	50円
2017年6月	50円
2017年5月	50円
2017年4月	50円
2017年3月	50円
直近1年累計	600円
設定来累計	4,250円

※上記分配金は1万口当たり、税引前です。

主な資産の状況

組入ファンド

ファンド名	純資産比率
LM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)	79.84%
アジア・ニュージーランド債券マザーファンド	16.67%

組入上位銘柄

(LM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用))

銘柄名	償還日	利率	国/地域	純資産比率
AUSTRALIA GOVT	2027/04/21	4.750%	オーストラリア	2.43%
AUSTRALIA GOVT	2029/04/21	3.250%	オーストラリア	2.42%
AUSTRALIA GOVT	2026/04/21	4.250%	オーストラリア	2.36%
AUSTRALIA GOVT	2033/04/21	4.500%	オーストラリア	2.27%
QUEENSLAND TREASURY	2023/07/21	4.250%	オーストラリア	1.65%

※比率はLM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)の純資産総額に対する比率です。
 ※レップ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社のデータをもとに岡三アセットマネジメントが作成しています。

組入上位銘柄

(アジア・ニュージーランド債券マザーファンド)

銘柄名	償還日	利率	国/地域	純資産比率
NEW ZEALAND GVT 5.5	2023/04/15	5.500%	ニュージーランド	16.80%
NEW ZEALAND GVT 6	2021/05/15	6.000%	ニュージーランド	9.72%
NEW ZEALAND GVT 5	2019/03/15	5.000%	ニュージーランド	8.99%
INDONESIA GOVT 11	2020/11/15	11.000%	インドネシア	6.74%
INDONESIA GOVT 12.8	2021/06/15	12.800%	インドネシア	6.18%

※比率はマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

※組入銘柄は、上位5銘柄もしくは全銘柄を記載しています。

年間収益率の推移



※ファンドにはベンチマークはありません。
 ※2013年はファンドの設定日から年末まで、2017年は7月末までの騰落率を示しています。
 ※ファンドの年間収益率は、基準価額増減に分配金(税引前)を合計して算出しています。

・過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。
 ・最新の運用実績は、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。

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

(略)

取得申込不可日

以下に該当する日は、「取得・換金申込不可日」として、取得申込みの受付を行いません。

- ・ オーストラリア証券取引所の休業日およびその前営業日
- ・ シドニーまたはメルボルンの銀行の休業日およびその前営業日

「取得・換金申込不可日」につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。また、委託会社のホームページにも、掲載いたします。

取得申込受付時間

原則として、午後3時までとし、販売会社所定の事務手続きが完了した場合に、当日の受付として取り扱います。この時間を過ぎての申込みは、翌営業日（ただし、取得申込不可日を除きます。）の取扱いとなります。

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 カスタマーサービス部 0120-048-214ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

<訂正後>

(略)

取得申込不可日

以下に該当する日は、「申込不可日」として、取得申込みの受付を行いません。

- ・ オーストラリア証券取引所の休業日およびその前営業日
- ・ シドニーまたはメルボルンの銀行の休業日およびその前営業日

「申込不可日」につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。また、委託会社のホームページにも、掲載いたします。

取得申込受付時間

原則として、午後3時までとし、販売会社所定の事務手続きが完了した場合に、当日の受付として取り扱います。この時間を過ぎての申込みは、翌営業日（ただし、申込不可日を除きます。）の取扱いとなります。

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 クライアント・サービス部 0120-048-214ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

(略)

換金申込不可日

以下に該当する日は、「取得・換金申込不可日」として、換金申込みの受付を行いません。

- ・ オーストラリア証券取引所の休業日およびその前営業日
- ・ シドニーまたはメルボルンの銀行の休業日およびその前営業日

「取得・換金申込不可日」につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。また、委託会社のホームページにも、掲載いたします。

換金申込受付時間

原則として、午後3時までとし、販売会社所定の事務手続きが完了した場合に、当日の受付として取り扱います。この時間を過ぎての申込みは、翌営業日（ただし、換金申込不可日を除きます。）の取扱いとなります。

(略)

解約請求の受付の中止及び取消

- ・ 投資対象とする投資信託証券にかかる解約請求の受付の中止および取消、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することや、すでに受付けた解約請求の受付を取消することがあります。
- ・ 解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付の中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該解約価額は、当該受付再開後の最初の基準価額の計算日（ただし、換金申込不可日を除きます。）に解約請求を受付けたものとして計算された価額とします。

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 カスタマーサービス部 0120-048-214

ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

<訂正後>

(略)

換金申込不可日

以下に該当する日は、「申込不可日」として、換金申込みの受付を行いません。

- ・ オーストラリア証券取引所の休業日およびその前営業日
- ・ シドニーまたはメルボルンの銀行の休業日およびその前営業日

「申込不可日」につきましては、販売会社又は委託会社にお問い合わせ下さい。また、委託会社のホームページにも、掲載いたします。

換金申込受付時間

原則として、午後3時までとし、販売会社所定の事務手続きが完了した場合に、当日の受付として取り扱います。この時間を過ぎての申込みは、翌営業日（ただし、申込不可日を除きます。）の取扱いとなります。

(略)

解約請求の受付の中止及び取消

- ・ 投資対象とする投資信託証券にかかる解約請求の受付の中止および取消、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することや、すでに受付けた解約請求の受付を取消することがあります。
- ・ 解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付の中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該解約価額は、当該受付再開後の最初の基準価額の計算日（ただし、申込不可日を除きます。）に解約請求を受付けたものとして計算された価額とします。

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 クライアント・サービス部 0120-048-214

ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 カスタマーサービス部 0120-048-214

ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

なお、基準価額は、計算日の翌日付の日本経済新聞に1万口当たりで掲載されます。掲載に関する権利は株式会社日本経済新聞社にあり、掲載されない場合もあります。また、基準価額は、掲載後変更される場合がありますので、販売会社又は委託会社で確認して下さい。

<訂正後>

(略)

お問い合わせ先

岡三アセットマネジメント株式会社 クライアント・サービス部 0120-048-214

ホームページ <http://www.okasan-am.jp>

なお、基準価額は、計算日の翌日付の日本経済新聞に1万口当たりで掲載されます。掲載に関する権利は株式会社日本経済新聞社にあり、掲載されない場合もあります。また、基準価額は、掲載後変更される場合がありますので、販売会社又は委託会社で確認して下さい。

(3)【信託期間】

<訂正前>

信託期間は、平成25年3月27日から平成35年1月20日までとします。

ただし、投資信託契約の解約(繰上償還)の規定により信託を終了させる場合があります。

また、受益者に有利である場合等は、信託期間を延長することがあります。

<訂正後>

信託期間は、2013年3月27日から2023年1月20日までとします。

ただし、投資信託契約の解約(繰上償還)の規定により信託を終了させる場合があります。

また、受益者に有利である場合等は、信託期間を延長することがあります。

(4)【計算期間】

<訂正前>

計算期間は、原則として、毎月21日から翌月20日までとします。

なお、第1計算期間は、平成25年3月27日から平成25年4月22日までとします。

また、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<訂正後>

計算期間は、原則として、毎月21日から翌月20日までとします。

また、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

第3【ファンドの経理状況】

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、第9特定期間(平成29年 1月21日から平成29年 7月20日まで)の財務諸表について、東陽監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【<中京>アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附付）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8特定期間末 (平成29年 1月20日現在)	第9特定期間末 (平成29年 7月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,098,982	935,106
コール・ローン	14,747,471	12,683,309
投資信託受益証券	475,452,924	433,007,107
親投資信託受益証券	97,749,169	88,881,211
未収入金	10,000,000	9,000,000
流動資産合計	599,048,546	544,506,733
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,941,905	4,574,228
未払解約金	-	574,309
未払受託者報酬	21,571	18,905
未払委託者報酬	566,218	496,282
未払利息	22	24
その他未払費用	6,569	5,784
流動負債合計	5,536,285	5,669,532
負債合計		
	5,536,285	5,669,532
純資産の部		
元本等		
元本	*1988,381,161	*1914,845,660
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	394,868,900	376,008,459
元本等合計	593,512,261	538,837,201
純資産合計		
	*3593,512,261	*3538,837,201
負債純資産合計		
	599,048,546	544,506,733

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第8特定期間		第9特定期間	
	自	平成28年 7月21日 至 平成29年 1月20日	自	平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
営業収益				
受取配当金		22,467,841		20,930,493
受取利息		39		88
有価証券売買等損益		15,092,405		1,313,775
営業収益合計		37,560,285		19,616,806
営業費用				
支払利息		4,222		4,572
受託者報酬		128,930		119,463
委託者報酬		3,384,344		3,135,913
その他費用		39,735		36,793
営業費用合計		3,557,231		3,296,741
営業利益又は営業損失（ ）		34,003,054		16,320,065
経常利益又は経常損失（ ）		34,003,054		16,320,065
当期純利益又は当期純損失（ ）		34,003,054		16,320,065
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（ ）		622,576		194,539
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		414,271,342		394,868,900
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,442,179		32,673,141
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		17,442,179		32,673,141
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,147,423		1,338,939
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,147,423		1,338,939
分配金		*130,272,792		*128,599,287
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		394,868,900		376,008,459

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項 目	期 別	第9特定期間	
		自 平成29年 1月21日	至 平成29年 7月20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、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
		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。時価評価に当たっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準		受取配当金 原則として、投資信託の分配落ち日に計上しております。	
		有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	
		計算期間の取扱い	

期 別	第9特定期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
項 目	
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、6ヵ月未満であるため財務諸表を6ヵ月毎に作成しており、平成29年 1月21日から平成29年 7月20日までを特定期間としております。

(貸借対照表に関する注記)

第8特定期間末 (平成29年 1月20日現在)	第9特定期間末 (平成29年 7月20日現在)
*1. 当該特定期間の末日における受益権の総数 988,381,161口	*1. 当該特定期間の末日における受益権の総数 914,845,660口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 394,868,900円	2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 376,008,459円
*3. 当該特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たりの純資産額 0.6005円 (10,000口当たりの純資産額 6,005円)	*3. 当該特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たりの純資産額 0.5890円 (10,000口当たりの純資産額 5,890円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8特定期間 自 平成28年 7月21日 至 平成29年 1月20日	第9特定期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
*1. 分配金の計算過程 第41計算期間(平成28年 7月21日～平成28年 8月22日) 費用控除後の配当等収A 3,606,380円 益額 費用控除後・繰越欠損B 0円 金補填後の有価証券売買等損益額 収益調整金額 C 28,774,995円 分配準備積立金額 D 0円 当ファンドの分配対象E=A+B+C+D 32,381,375円 収益額 当ファンドの期末残存F 1,027,296,657口 口数 10,000口当たり収益分G=E/F*10,000 315円 配対象額 10,000口当たり分配金H 50円 額	*1. 分配金の計算過程 第47計算期間(平成29年 1月21日～平成29年 2月20日) 費用控除後の配当等収A 3,440,867円 益額 費用控除後・繰越欠損B 0円 金補填後の有価証券売買等損益額 収益調整金額 C 20,086,628円 分配準備積立金額 D 0円 当ファンドの分配対象E=A+B+C+D 23,527,495円 収益額 当ファンドの期末残存F 980,956,764口 口数 10,000口当たり収益分G=E/F*10,000 239円 配対象額 10,000口当たり分配金H 50円 額

第8特定期間 自 平成28年 7月21日 至 平成29年 1月20日			第9特定期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日		
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	5,136,483円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	4,904,783円
第42計算期間(平成28年 8月23日～平成28年 9月20日)			第48計算期間(平成29年 2月21日～平成29年 3月21日)		
費用控除後の配当等収A 益額		3,633,881円	費用控除後の配当等収A 益額		3,426,009円
費用控除後・繰越欠損B 金補填後の有価証券売 買等損益額		0円	費用控除後・繰越欠損B 金補填後の有価証券売 買等損益額		0円
収益調整金額	C	26,933,381円	収益調整金額	C	18,456,148円
分配準備積立金額	D	0円	分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象E=A+B+C+D 収益額		30,567,262円	当ファンドの分配対象E=A+B+C+D 収益額		21,882,157円
当ファンドの期末残存F 口数		1,015,549,891口	当ファンドの期末残存F 口数		972,180,156口
10,000口当たり収益分G=E/F*10,000 配対象額		300円	10,000口当たり収益分G=E/F*10,000 配対象額		225円
10,000口当たり分配金H 額		50円	10,000口当たり分配金H 額		50円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	5,077,749円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	4,860,900円
第43計算期間(平成28年 9月21日～平成28年10月20日)			第49計算期間(平成29年 3月22日～平成29年 4月20日)		
費用控除後の配当等収A 益額		3,991,732円	費用控除後の配当等収A 益額		3,386,344円
費用控除後・繰越欠損B 金補填後の有価証券売 買等損益額		0円	費用控除後・繰越欠損B 金補填後の有価証券売 買等損益額		0円
収益調整金額	C	25,473,420円	収益調整金額	C	17,021,502円
分配準備積立金額	D	0円	分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象E=A+B+C+D 収益額		29,465,152円	当ファンドの分配対象E=A+B+C+D 収益額		20,407,846円
当ファンドの期末残存F 口数		1,014,906,553口	当ファンドの期末残存F 口数		972,122,497口
10,000口当たり収益分G=E/F*10,000 配対象額		290円	10,000口当たり収益分G=E/F*10,000 配対象額		209円
10,000口当たり分配金H 額		50円	10,000口当たり分配金H 額		50円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	5,074,532円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	4,860,612円
第44計算期間(平成28年10月21日～平成28年11月21日)			第50計算期間(平成29年 4月21日～平成29年 5月22日)		
費用控除後の配当等収A 益額		3,550,845円	費用控除後の配当等収A 益額		3,648,887円
費用控除後・繰越欠損B 金補填後の有価証券売 買等損益額		0円	費用控除後・繰越欠損B 金補填後の有価証券売 買等損益額		0円
収益調整金額	C	24,355,624円	収益調整金額	C	15,100,369円
分配準備積立金額	D	0円	分配準備積立金額	D	0円

第8特定期間 自 平成28年 7月21日 至 平成29年 1月20日		第9特定期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日	
当ファンドの分配対象E=A+B+C+D	27,906,469円	当ファンドの分配対象E=A+B+C+D	18,749,256円
収益額		収益額	
当ファンドの期末残存F	1,013,447,626口	当ファンドの期末残存F	944,169,358口
口数		口数	
10,000口当たり収益分G=E/F*10,000	275円	10,000口当たり収益分G=E/F*10,000	198円
配対象額		配対象額	
10,000口当たり分配金H	50円	10,000口当たり分配金H	50円
額		額	
収益分配金金額 I=F*H/10,000	5,067,238円	収益分配金金額 I=F*H/10,000	4,720,846円
第45計算期間(平成28年11月22日～平成28年12月20日)		第51計算期間(平成29年 5月23日～平成29年 6月20日)	
費用控除後の配当等収A	3,976,358円	費用控除後の配当等収A	3,639,011円
益額		益額	
費用控除後・繰越欠損B	0円	費用控除後・繰越欠損B	0円
金補填後の有価証券売		金補填後の有価証券売	
買等損益額		買等損益額	
収益調整金額 C	22,423,044円	収益調整金額 C	13,900,896円
分配準備積立金額 D	0円	分配準備積立金額 D	0円
当ファンドの分配対象E=A+B+C+D	26,399,402円	当ファンドの分配対象E=A+B+C+D	17,539,907円
収益額		収益額	
当ファンドの期末残存F	994,977,168口	当ファンドの期末残存F	935,583,676口
口数		口数	
10,000口当たり収益分G=E/F*10,000	265円	10,000口当たり収益分G=E/F*10,000	187円
配対象額		配対象額	
10,000口当たり分配金H	50円	10,000口当たり分配金H	50円
額		額	
収益分配金金額 I=F*H/10,000	4,974,885円	収益分配金金額 I=F*H/10,000	4,677,918円
第46計算期間(平成28年12月21日～平成29年 1月20日)		第52計算期間(平成29年 6月21日～平成29年 7月20日)	
費用控除後の配当等収A	3,897,769円	費用控除後の配当等収A	3,600,248円
益額		益額	
費用控除後・繰越欠損B	0円	費用控除後・繰越欠損B	0円
金補填後の有価証券売		金補填後の有価証券売	
買等損益額		買等損益額	
収益調整金額 C	21,282,564円	収益調整金額 C	12,576,940円
分配準備積立金額 D	0円	分配準備積立金額 D	0円
当ファンドの分配対象E=A+B+C+D	25,180,333円	当ファンドの分配対象E=A+B+C+D	16,177,188円
収益額		収益額	
当ファンドの期末残存F	988,381,161口	当ファンドの期末残存F	914,845,660口
口数		口数	
10,000口当たり収益分G=E/F*10,000	254円	10,000口当たり収益分G=E/F*10,000	176円
配対象額		配対象額	
10,000口当たり分配金H	50円	10,000口当たり分配金H	50円
額		額	
収益分配金金額 I=F*H/10,000	4,941,905円	収益分配金金額 I=F*H/10,000	4,574,228円

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

期 別 項 目	第8特定期間 自 平成28年 7月21日 至 平成29年 1月20日	第9特定期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは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を投資対象として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、売買目的の有価証券であります。保有する有価証券の詳細は、「（４）附属明細表」に記載しております。当該有価証券を保有した際の主要なリスクは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、カウンターリスク及び流動性リスク等です。その他、保有するコール・ローン等の金銭債権及び金銭債務につきましては、信用リスク等を有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドの委託会社の運用委員会において、運用に関する内規の制定及び改廃、運用ガイドライン等運用のリスク管理に関する事項の決定を行うほか、リスク管理部及びコンプライアンス部において、「運用の指図に関する検証規程」に基づき、投資信託財産の運用の指図について、法令、投資信託協会諸規則、社内規程及び投資信託約款に定める運用の指図に関する事項の遵守状況を確認しております。また、運用分析会議におけるファンドの運用パフォーマンスの分析・検証・評価や、売買分析会議におけるファンドの組入有価証券の評価損率や格付状況、有価証券売買状況や組入状況の報告等により、全社的に投資リスクを把握し管理を行っております。	同左

2. 金融商品の時価に関する事項

期 別	第8特定期間末 (平成29年 1月20日現在)	第9特定期間末 (平成29年 7月20日現在)
1. 貸借対照表額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として全て時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	時価の算定方法は、「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。この他、コール・ローン等は短期間で決済され、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第8特定期間 自 平成28年 7月21日 至 平成29年 1月20日	第9特定期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
該当事項はありません。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

第9特定期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 元本の移動

第8特定期間末 (平成29年 1月20日現在)	第9特定期間末 (平成29年 7月20日現在)
投資信託財産に係る元本の状況	投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 1,026,876,814円	期首元本額 988,381,161円
期中追加設定元本額 2,731,588円	期中追加設定元本額 3,185,528円
期中一部解約元本額 41,227,241円	期中一部解約元本額 76,721,029円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券の最終の計算期間の損益に含まれた評価差額

第8特定期間末（平成29年 1月20日現在）

（単位：円）

種 類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	8,656,324
親投資信託受益証券	1,001,237
合計	9,657,561

第9特定期間末（平成29年 7月20日現在）

（単位：円）

種 類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	13,309,202
親投資信託受益証券	660,533
合計	13,969,735

3. デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

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	備考
投資信託受益証券	日本円	L M・オーストラリア債券ファンド （適格機関投資家専用）	817,920,491	433,007,107	
	計	銘柄数：1 組入時価比率：80.4%	817,920,491	433,007,107 100.0%	
	投資信託受益証券合計			433,007,107	
親投資信託受益証券	日本円	アジア・ニュージーランド債券マ ザーファンド	60,599,449	88,881,211	
	計	銘柄数：1 組入時価比率：16.5%	60,599,449	88,881,211 100.0%	
	親投資信託受益証券合計			88,881,211	
合計				521,888,318	

(注)1.比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の各合計金額に対する比率であります。

2.親投資信託受益証券及び投資信託受益証券の券面総額欄には、口数を表示しております。

2.デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等、時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「アジア・ニュージーランド債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としております。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、当該マザーファンドの受益証券です。

マザーファンドの経理状況は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

アジア・ニュージーランド債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

科目	期別	注記番号	平成29年 1月20日現在	平成29年 7月20日現在
			金額	金額
資産の部				
流動資産				
預金			11,057,700	119,340,926
金銭信託			21,304,817	21,810,559
コール・ローン			285,893,935	295,827,576
国債証券			9,288,618,834	9,175,786,396
未収利息			120,914,707	117,066,885
前払費用			2,245,082	355,686
流動資産合計			9,730,035,075	9,730,188,028
資産合計			9,730,035,075	9,730,188,028
負債の部				
流動負債				
未払利息			431	567
その他未払費用			2,006	2,776
流動負債合計			2,437	3,343
負債合計			2,437	3,343
純資産の部				
元本等				
元本		*1	6,734,044,056	6,633,974,198
剰余金				
剰余金又は欠損金()			2,995,988,582	3,096,210,487
元本等合計			9,730,032,638	9,730,184,685
純資産合計		*2	9,730,032,638	9,730,184,685
負債純資産合計			9,730,035,075	9,730,188,028

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期 別	自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。ただし、償還日までの残存期間が1年以内の債券について、価格変動性が限定的で、償却原価法による評価が合理的であり、かつ受益者の利益を害しないと委託会社が判断した場合は、償却原価法によって評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p> <p>計算期間の取扱い</p> <p>当ファンドの計算期間は、<中京>アジア・オセアニア債券オープン(環境応援寄附)の特定期間に合わせるため、平成29年 1月21日から平成29年 7月20日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 1月20日現在	平成29年 7月20日現在
*1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 6,734,044,056口	*1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 6,633,974,198口
*2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たりの純資産額 1.4449円 (10,000口当たりの純資産額 14,449円)	*2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たりの純資産額 1.4667円 (10,000口当たりの純資産額 14,667円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

期 別	自 平成28年 7月21日 至 平成29年 1月20日	自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは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を投資対象として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが運用する主な有価証券は、売買目的の有価証券であります。保有する有価証券の詳細は、「附属明細表」に記載しております。当該有価証券を保有した際の主要なリスクは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、カントリーリスク及び流動性リスク等です。その他、保有するコール・ローン等の金銭債権及び金銭債務につきましては、信用リスク等を有しております。</p> <p>なお、当ファンドでは、デリバティブ取引として、為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図ることを目的とした為替予約取引を利用しております。為替予約取引の主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスクです。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドの委託会社の運用委員会において、運用に関する内規の制定及び改廃、運用ガイドライン等運用のリスク管理に関する事項の決定を行うほか、リスク管理部及びコンプライアンス部において、「運用の指図に関する検証規程」に基づき、投資信託財産の運用の指図について、法令、投資信託協会諸規則、社内規程及び投資信託約款に定める運用の指図に関する事項の遵守状況を確認しております。また、運用分析会議におけるファンドの運用パフォーマンスの分析・検証・評価や、売買分析会議におけるファンドの組入有価証券の評価損率や格付状況、有価証券売買状況や組入状況の報告等により、全社的に投資リスクを把握し管理を行っております。</p> <p>なお、デリバティブ取引の管理については、取引権限及び取引限度額等を定めた社内規定を制定しており、デリバティブ取引の執行については、運用部長及び担当役員の承認を得て行っております。</p>	同左

2. 金融商品の時価に関する事項

期 別	平成29年 1月20日現在	平成29年 7月20日現在
項 目		
1. 貸借対照表額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として全て時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	時価の算定方法は、「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。この他、コール・ローン等は短期間で決済され、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格を時価としております。	同左

(その他の注記)

1. 元本の移動

平成29年 1月20日現在	
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月21日
期首元本額	7,887,343,761円
期首より平成29年 1月20日までの追加設定元本額	56,613,788円
期首より平成29年 1月20日までの一部解約元本額	1,209,913,493円
期末元本額	6,734,044,056円
平成29年 1月20日現在の元本の内訳（*）	
アジア・オセアニア債券オープン（毎月決算型）	5,745,590,320円
三重県応援・債券ファンド（毎月決算型）	536,370,506円
水戸証券アジア・オセアニア債券オープン（寄附付）	243,928,447円
大阪・兵庫応援外国債券オープン	64,122,018円
<中京>アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附付）	67,651,166円
アジア・オセアニア債券オープン（1年決算型）	52,157,481円
三重県応援・債券ファンド（1年決算型）	24,224,118円

平成29年 7月20日現在	
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月21日
期首元本額	6,734,044,056円
期首より平成29年 7月20日までの追加設定元本額	209,273,576円

平成29年 7月20日現在	
期首より平成29年 7月20日までの一部解約元本額	309,343,434円
期末元本額	6,633,974,198円
平成29年 7月20日現在の元本の内訳（＊）	
アジア・オセアニア債券オープン（毎月決算型）	5,677,601,433円
三重県応援・債券ファンド（毎月決算型）	549,946,017円
水戸証券アジア・オセアニア債券オープン（寄附付）	198,834,647円
大阪・兵庫応援外国債券オープン	50,116,361円
<中京>アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附付）	60,599,449円
アジア・オセアニア債券オープン（1年決算型）	77,505,612円
三重県応援・債券ファンド（1年決算型）	19,370,679円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託毎の元本額

2. 有価証券関係

売買目的有価証券の当計算期間の損益に含まれた評価差額

平成29年 1月20日現在

（単位：円）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	25,395,024
合計	25,395,024

平成29年 7月20日現在

（単位：円）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	28,298,965
合計	28,298,965

3. デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

附属明細表

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	備考
国債証券	ニュージーランドドル	NEW ZEALAND GVT 5	10,000,000.00	10,493,600.00	
		NEW ZEALAND GVT 5.5	17,000,000.00	19,594,540.00	
		NEW ZEALAND GVT 6	10,000,000.00	11,335,200.00	
	計	銘柄数：3	37,000,000.00	41,423,340.00 (3,412,868,982)	37.2%
		組入時価比率：35.1%			
	タイバーツ	THAILAND GOVT 1.875	40,000,000.00	39,974,000.00	
		THAILAND GOVT 3.45	40,000,000.00	41,223,200.00	
		計	銘柄数：2	80,000,000.00	81,197,200.00 (270,386,676)
		組入時価比率：2.8%			
	マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.48	2,000,000.00	1,953,820.00	
		MALAYSIA GOVT 3.654	10,000,000.00	10,033,600.00	
		MALAYSIA GOVT 4.012	5,000,000.00	5,009,400.00	
		MALAYSIA GOVT 4.048	20,000,000.00	20,203,800.00	
		MALAYSIA GOVT 4.378	20,000,000.00	20,387,400.00	
		MALAYSIA GOVT 5.734	20,000,000.00	20,879,600.00	
		計	銘柄数：6	77,000,000.00	78,467,620.00 (2,049,574,234)
		組入時価比率：21.1%			
	インドネシアルピア	INDONESIA GOV'T 10.25	31,000,000,000.00	35,352,710,000.00	
		INDONESIA GOV'T 11	70,000,000,000.00	78,721,300,000.00	
		INDONESIA GOV'T 11.5	20,000,000,000.00	21,881,000,000.00	
		INDONESIA GOV'T 11.6	10,000,000,000.00	10,542,800,000.00	
		INDONESIA GOV'T 11.75	6,100,000,000.00	7,516,542,000.00	
		INDONESIA GOV'T 12.8	60,000,000,000.00	72,188,400,000.00	
INDONESIA GOV'T 12.9		10,000,000,000.00	12,485,000,000.00		
INDONESIA GOV'T 5.25		10,000,000,000.00	9,930,600,000.00		
INDONESIA GOV'T 5.625		20,000,000,000.00	18,796,000,000.00		
INDONESIA GOV'T 7		30,000,000,000.00	30,276,900,000.00		
INDONESIA GOV'T 7.875		65,000,000,000.00	66,331,200,000.00		
INDONESIA GOV'T 8.375		20,000,000,000.00	21,482,400,000.00		
計	銘柄数：12	352,100,000,000.00	385,504,852,000.00 (3,238,240,756)	35.3%	
	組入時価比率：33.3%				
韓国ウォン	KOREA TRSY BD 5.5	2,000,000,000.00	2,051,260,000.00		
	計	銘柄数：1	2,000,000,000.00	2,051,260,000.00 (204,715,748)	2.2%
	組入時価比率：2.1%				

合計		9,175,786,396	
		(9,175,786,396)	

(注)1. 小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

3. 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の各合計金額に対する比率であります。

2. デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等、時価の状況表

該当事項はありません。

LM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)

ファンドは、LM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)を主要投資対象としております。

以下の経理状況は、レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社から提供された財務諸表です。

ファンドの経理状況

(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)(以下「財務諸表等規則」という。)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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)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ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドは、当特定期間(平成29年1月12日から平成29年7月11日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

その監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。

1 [財務諸表]

[LM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)]

(1) [貸借対照表]

(単位:円)

	前期 平成29年 1月11日現在	当期 平成29年 7月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,680,409,357	3,616,077,100
コール・ローン	3,473,875,553	2,633,598,942
国債証券	35,141,674,240	37,281,442,066
地方債証券	52,366,874,552	53,911,349,656
特殊債券	28,313,155,621	29,016,837,201

社債券	104,074,206,530	106,729,621,449
派生商品評価勘定	83,142,756	64,276,020
未収入金	267,462,883	615,558
未収利息	2,493,436,838	2,468,355,567
前払費用	14,743,232	42,371,919
その他未収収益	64,208,022	19,755,052
差入委託証拠金	178,561,480	365,544,632
流動資産合計	229,151,751,064	236,149,845,162
資産合計	229,151,751,064	236,149,845,162
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,438,108	233,347,979
未払金	422,420,061	216,850,260
未払収益分配金	1,738,003,360	1,809,719,495
未払解約金	1,361,321	22,210,420
未払受託者報酬	2,006,964	1,980,386
未払委託者報酬	90,313,405	89,117,323
未払利息	7,317	5,893
その他未払費用	358,774	309,679
流動負債合計	2,261,909,310	2,373,541,435
負債合計	2,261,909,310	2,373,541,435
純資産の部		
元本等		
元本	434,500,840,131	452,429,873,835
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	207,610,998,377	218,653,570,108
元本等合計	226,889,841,754	233,776,303,727
純資産合計	226,889,841,754	233,776,303,727
負債純資産合計	229,151,751,064	236,149,845,162

(2) [損益及び剰余金計算書]

(単位：円)

	前期		当期	
	自 至	平成28年 7月12日 平成29年 1月11日	自 至	平成29年 1月12日 平成29年 7月11日
営業収益				
受取利息		5,005,765,903		4,839,881,389
有価証券売買等損益		7,949,686,291		181,461,945
派生商品取引等損益		524,618,200		22,145,776
為替差損益		25,783,266,357		4,158,898,223
その他収益		42,161,849		40,178,226
営業収益合計		22,356,889,618		8,879,641,669
営業費用				
支払利息		545,247		621,706
受託者報酬		12,410,427		12,257,549
委託者報酬		558,469,124		551,589,577
その他費用		11,524,171		9,134,110
営業費用合計		582,948,969		573,602,942
営業利益又は営業損失（ ）		21,773,940,649		8,306,038,727
経常利益又は経常損失（ ）		21,773,940,649		8,306,038,727
当期純利益又は当期純損失（ ）		21,773,940,649		8,306,038,727
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（ ）		99,372,112		6,338,570
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		236,478,442,546		207,610,998,377
剰余金増加額又は欠損金減少額		25,748,227,532		6,220,966,422
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		25,748,227,532		6,220,966,422
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,870,752,322		14,847,284,730
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,870,752,322		14,847,284,730

分配金	10,684,599,578	10,715,953,580
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	207,610,998,377	218,653,570,108

(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 1月12日 至 平成29年 7月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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、「投資信託財産計算規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(未適用の会計基準等に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

前期 平成29年 1月11日現在	当期 平成29年 7月11日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 434,500,840,131口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 452,429,873,835口
2. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 207,610,998,377円	2. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 218,653,570,108円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額 0.5222円 (一万口当たり純資産額) (5,222円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額 0.5167円 (一万口当たり純資産額) (5,167円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日	自 平成29年 1月12日 至 平成29年 7月11日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。	同左
2. 分配金の計算過程	平成28年 7月12日から 平成28年 8月12日までの計算期間	平成29年 1月12日から 平成29年 2月13日までの計算期間
費用控除後の配当等収益額	886,035,632円	896,113,799円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	56,031,296,129円	47,337,702,340円
分配準備積立金額	- 円	- 円
当ファンドの分配対象収益額	56,917,331,761円	48,233,816,139円
当ファンドの期末残存口数	463,072,622,142口	439,369,351,663口
1万口当たり収益分配対象額	1,229.12円	1,097.80円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	1,852,290,488円	1,757,477,406円
	平成28年 8月13日から 平成28年 9月12日までの計算期間	平成29年 2月14日から 平成29年 3月13日までの計算期間
費用控除後の配当等収益額	750,373,756円	674,271,664円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	54,160,675,667円	46,705,121,103円
分配準備積立金額	- 円	- 円
当ファンドの分配対象収益額	54,911,049,423円	47,379,392,767円
当ファンドの期末残存口数	455,452,579,060口	441,494,291,652口
1万口当たり収益分配対象額	1,205.64円	1,073.16円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	1,821,810,316円	1,765,977,166円
	平成28年 9月13日から 平成28年10月11日までの計算期間	平成29年 3月14日から 平成29年 4月11日までの計算期間
費用控除後の配当等収益額	751,217,499円	672,784,247円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	51,715,050,540円	45,949,004,376円
分配準備積立金額	- 円	- 円
当ファンドの分配対象収益額	52,466,268,039円	46,621,788,623円
当ファンドの期末残存口数	443,658,838,741口	444,679,495,476口
1万口当たり収益分配対象額	1,182.58円	1,048.44円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	1,774,635,354円	1,778,717,981円

	平成28年10月12日から 平成28年11月11日まで の計算期間	平成29年 4月12日から 平成29年 5月11日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	802,893,130円	763,955,344円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	50,232,932,529円	45,383,845,506円
分配準備積立金額	- 円	- 円
当ファンドの分配対象収益額	51,035,825,659円	46,147,800,850円
当ファンドの期末残存口数	439,640,993,653口	449,972,558,825口
1万口当たり収益分配対象額	1,160.85円	1,025.57円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	1,758,563,974円	1,799,890,235円
	平成28年11月12日から 平成28年12月12日まで の計算期間	平成29年 5月12日から 平成29年 6月12日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	856,336,097円	739,521,203円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	48,742,460,642円	44,458,246,171円
分配準備積立金額	- 円	- 円
当ファンドの分配対象収益額	49,598,796,739円	45,197,767,374円
当ファンドの期末残存口数	434,824,021,710口	451,042,824,466口
1万口当たり収益分配対象額	1,140.66円	1,002.08円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	1,739,296,086円	1,804,171,297円
	平成28年12月13日から 平成29年 1月11日まで の計算期間	平成29年 6月13日から 平成29年 7月11日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	713,906,548円	784,171,131円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	47,830,784,807円	43,532,037,431円
分配準備積立金額	- 円	- 円
当ファンドの分配対象収益額	48,544,691,355円	44,316,208,562円
当ファンドの期末残存口数	434,500,840,131口	452,429,873,835口
1万口当たり収益分配対象額	1,117.25円	979.51円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	1,738,003,360円	1,809,719,495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	前期	当期
	自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日	自 平成29年 1月12日 至 平成29年 7月11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、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して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。 また、当ファンドは、有価証券等の価格変動リスクの回避を目的として債券先物取引を、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。為替予約取引は為替変動リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。	同左
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よった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日	自 平成29年 1月12日 至 平成29年 7月11日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （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。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価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。	同左

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

項目	前期	当期
	自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日	自 平成29年 1月12日 至 平成29年 7月11日
期首元本額	470,266,440,365円	434,500,840,131円
期中追加設定元本額	16,267,971,721円	30,757,542,842円
期中解約元本額	52,033,571,955円	12,828,509,138円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	前期 平成29年 1月11日現在	当期 平成29年 7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	531,415,545	908,835,412
地方債証券	97,758,699	700,146,783
特殊債券	25,224,998	301,015,626
社債券	134,409,427	692,766,887
合計	469,539,819	2,602,764,708

3 デリバティブ取引関係 取引の時価等に関する事項 債券関連

種類	前期 平成29年 1月11日現在				当期 平成29年 7月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年 超				うち1年 超			
市場取引								
債券先物取引								
買建	9,349,174,061	-	9,426,035,107	76,861,046	11,791,241,909	-	11,572,473,753	218,768,156
売建	7,313,777,928	-	7,308,552,186	5,225,742	10,017,032,809	-	9,953,554,162	63,478,647
合計	16,662,951,989	-	16,734,587,293	82,086,788	21,808,274,718	-	21,526,027,915	155,289,509

(注) 時価の算定方法

外国先物取引について

- 1) 外国先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 2) 特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

通貨関連

種類	前期 平成29年 1月11日現在				当期 平成29年 7月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年 超				うち1年 超			

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,010,048,140	-	1,007,366,000	2,682,140	1,041,924,000	-	1,042,560,000	636,000
オーストラリアドル	1,010,048,140	-	1,007,366,000	2,682,140	1,041,924,000	-	1,042,560,000	636,000
売建	1,063,550,000	-	1,067,250,000	3,700,000	1,540,912,550	-	1,555,331,000	14,418,450
オーストラリアドル	1,063,550,000	-	1,067,250,000	3,700,000	1,540,912,550	-	1,555,331,000	14,418,450
合計	2,073,598,140	-	2,074,616,000	6,382,140	2,582,836,550	-	2,597,891,000	13,782,450

(注) 時価の算定方法

為替予約取引について

1. 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

特定期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

特定期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2. 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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

次表の通りです。

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
オーストラリアドル	国債証券	AUSTRALIA GOVT	8,500,000.00	8,651,980.00	
		AUSTRALIA GOVT	21,000,000.00	22,024,380.00	
		AUSTRALIA GOVT	56,000,000.00	63,074,480.00	
		AUSTRALIA GOVT	55,100,000.00	64,911,106.00	

	AUSTRALIA GOVT	62,060,000.00	64,719,271.00	
	AUSTRALIA GOVT	51,220,000.00	60,607,089.40	
	AUSTRALIAN GOVT	15,000,000.00	15,028,350.00	
	AUSTRALIAN GOVT	36,500,000.00	34,730,845.00	
	AUSTRALIAN GOVT	35,700,000.00	33,520,872.00	
	AUSTRALIAN GOVT	20,100,000.00	21,493,533.00	
	AUSTRALIAN GOVT	13,500,000.00	13,229,460.00	
	AUSTRALIAN GOVT	30,180,000.00	27,024,077.40	
	国債証券小計	404,860,000.00	429,015,443.80 (37,281,442,066)	
地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5,000,000.00	5,501,385.00	
	AUST CAPITAL TERRITORY	7,200,000.00	7,589,880.00	
	AUST CAPITAL TERRITORY	3,400,000.00	3,648,574.00	
	BRITISH COLUMBIA PROV OF	6,500,000.00	6,899,490.00	
	MANITOBA PROVANCE	5,000,000.00	5,291,500.00	
	NEW S WALES TREAS CORP	20,600,000.00	22,778,656.00	
	NEW S WALES TREAS CORP	24,100,000.00	27,911,415.00	
	NEW S WALES TREAS CORP	5,000,000.00	5,392,100.00	
	NEW S WALES TREAS CORP	32,000,000.00	36,738,560.00	
	NEW S WALES TREAS CORP	5,000,000.00	5,422,250.00	
	NEW S WALES TREAS CORP	5,000,000.00	4,937,350.00	
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3,000,000.00	3,096,150.00	
	ONTARIO PROVINCE	5,500,000.00	6,094,825.00	
	ONTARIO PROVINCE	6,000,000.00	6,332,220.00	
	QUEBEC PROVINCE	3,000,000.00	3,399,180.00	
	QUEENSLAND TREASURY	8,000,000.00	8,310,880.00	
	QUEENSLAND TREASURY	22,100,000.00	24,411,881.00	
	QUEENSLAND TREASURY	7,500,000.00	8,564,625.00	
	QUEENSLAND TREASURY	39,000,000.00	43,629,300.00	
	QUEENSLAND TREASURY	23,500,000.00	27,338,490.00	
	QUEENSLAND TREASURY	40,500,000.00	44,010,945.00	
	QUEENSLAND TREASURY	26,500,000.00	31,414,690.00	
	QUEENSLAND TREASURY	15,500,000.00	15,658,565.00	
	QUEENSLAND TREASURY	7,000,000.00	6,706,630.00	
	QUEENSLAND TREASURY	4,000,000.00	3,971,320.00	

	QUEENSLAND TREASURY CORP	18,500,000.00	20,837,845.00	
	SOUTH AUST GOVT FIN	9,000,000.00	9,502,650.00	
	SOUTH AUST GOVT FIN	8,500,000.00	9,333,000.00	
	SOUTH AUST GOVT FIN	3,000,000.00	2,835,000.00	
	SOUTH AUST GOVT FIN	5,000,000.00	5,424,000.00	
	SOUTH AUST GOVT FIN	3,000,000.00	2,933,940.00	
	SOUTH AUST GOVT FIN	7,000,000.00	6,872,320.00	
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	2,000,000.00	2,211,120.00	
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	2,000,000.00	2,144,440.00	
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3,500,000.00	3,734,535.00	
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	2,000,000.00	2,007,460.00	
	TREASURY CORP VICTORIA	8,000,000.00	9,663,280.00	
	VICTORIA TREASURY	22,100,000.00	24,520,392.00	
	VICTORIA TREASURY	27,500,000.00	32,299,025.00	
	VICTORIA TREASURY	20,500,000.00	24,299,060.00	
	WEST AUSTRALIA TREASURY	10,000,000.00	11,087,100.00	
	WEST AUSTRALIA TREASURY	22,750,000.00	25,816,927.50	
	WESTERN AUST TREAS CORP	8,000,000.00	8,057,680.00	
	WESTERN AUST TREAS CORP	12,000,000.00	14,094,000.00	
	WESTERN AUST TREAS CORP	5,000,000.00	5,015,450.00	
	WESTERN AUST TREAS CORP	23,500,000.00	27,812,485.00	
	WESTERN AUST TREAS CORP	5,000,000.00	4,831,200.00	
	地方債証券小計	557,750,000.00	620,383,770.50 (53,911,349,656)	
特殊債券	AFRICAN DEV BANK	5,500,000.00	6,117,815.00	
	AFRICAN DEV BANK	7,500,000.00	8,265,075.00	
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	6,500,000.00	7,162,870.00	
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	7,500,000.00	8,282,850.00	
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	2,500,000.00	2,662,100.00	
	CORP ANDINA DE FOMENTO	9,000,000.00	10,252,170.00	
	CORP ANDINA DE FOMENTO	8,000,000.00	8,170,800.00	
	CORP ANDINA DE FOMENTO	3,000,000.00	3,038,640.00	
	COUNCIL OF EUROP	7,000,000.00	7,738,150.00	
	EUROFIMA	4,000,000.00	4,232,000.00	
	EUROFIMA	5,500,000.00	5,952,265.00	

EUROFIMA	3,000,000.00	3,398,580.00	
EUROPEAN INVT BK	13,500,000.00	14,665,860.00	
EUROPEAN INVT BK	6,000,000.00	6,634,200.00	
EUROPEAN INVT BK	10,500,000.00	11,940,810.00	
EUROPEAN INVT BK	2,000,000.00	2,215,440.00	
EUROPEAN INVT BK	3,000,000.00	3,321,000.00	
EXPORT FIN & INS	1,000,000.00	1,110,970.00	
FMACB 2013-1E A1	682,888.90	682,287.95	
FPTT 2016-1 B	5,000,000.00	4,993,750.00	
INTER-AMERICAN DEVEL BK	5,000,000.00	5,123,150.00	
INTER-AMERICAN DEVEL BK	3,000,000.00	3,016,560.00	
INTERAMER DEV BANK	3,600,000.00	3,923,460.00	
INTERAMER DEV BANK	3,000,000.00	3,368,040.00	
INTERAMER DEV BANK	3,000,000.00	3,194,520.00	
INTL BK RECON & DEVELOP	3,000,000.00	3,238,680.00	
INTL BK RECON & DEVELOP	4,500,000.00	4,972,500.00	
INTL BK RECON & DEVELOP	11,500,000.00	12,702,670.00	
INTL FIN CORP	7,000,000.00	7,701,190.00	
KFW	5,000,000.00	5,469,100.00	
KFW	6,000,000.00	6,650,220.00	
KFW	6,000,000.00	6,819,180.00	
KFW	9,000,000.00	10,117,710.00	
KFW	11,000,000.00	12,362,130.00	
KFW	4,000,000.00	4,252,280.00	
KFW	6,250,000.00	6,232,250.00	
KOMMUNAL BANKEN	1,500,000.00	1,540,770.00	
KOMMUNAL BANKEN	7,000,000.00	7,966,000.00	
KOMMUNAL BANKEN	3,000,000.00	3,229,980.00	
KOMMUNAL BANKEN	8,497,000.00	9,189,760.41	
KOMMUNAL BANKEN	1,500,000.00	1,704,330.00	
KOMMUNINVEST	3,000,000.00	3,305,310.00	
KOMMUNINVEST	3,000,000.00	3,236,370.00	
L-BANK BW FOERDERBANK	1,500,000.00	1,450,980.00	
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	2,000,000.00	1,877,720.00	
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	8,000,000.00	8,655,760.00	
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	5,500,000.00	6,193,275.00	

	LANDWIRTSCH.RENTENBANK	3,000,000.00	2,993,850.00	
	LANDWIRTSCH.RENTENBANK	7,000,000.00	7,515,970.00	
	LANDWIRTSCH.RENTENBANK	7,700,000.00	8,529,906.00	
	LANDWIRTSCH.RENTENBANK	12,500,000.00	13,472,625.00	
	LGFV PROGRAM TRUST	8,000,000.00	8,241,040.00	
	MEDL 2013-2 A3	4,000,000.00	4,077,600.00	
	MEDL 2014-1 A3	5,000,000.00	5,133,300.00	
	NORDIC INV BANK	4,000,000.00	4,039,520.00	
	NORDIC INV BANK	10,000,000.00	11,049,000.00	
	RESI 2013-1 A3	526,051.59	526,330.39	
	特殊債券小計	307,755,940.49	333,910,669.75	(29,016,837,201)
社債券	ABB FINANCE AUSTRALIA	4,300,000.00	4,327,864.00	
	ABN AMRO BANK NV	8,000,000.00	8,256,560.00	
	ABN AMRO BANK NV	8,000,000.00	8,065,200.00	
	AGL ENERGY LTD	5,000,000.00	5,236,550.00	
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	8,000,000.00	8,505,440.00	
	AIRSERVICES AUSTRALIA	5,500,000.00	5,859,865.00	
	AMP BANK LIMITED FRN	3,000,000.00	3,006,810.00	
	AMP BANK LIMITED FRN	3,600,000.00	3,629,232.00	
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	13,000,000.00	13,563,420.00	
	APPLE INC	8,000,000.00	8,071,280.00	
	APPLE INC	4,000,000.00	4,128,320.00	
	APT PIPELINES LTD	5,500,000.00	5,439,555.00	
	AQUASURE FINANCE PTY LTD	12,550,000.00	13,331,488.50	
	AURIZON NETWORK PTY LTD	5,300,000.00	5,706,881.00	
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	5,740,000.00	5,798,490.60	
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	1,000,000.00	1,143,710.00	
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	10,750,000.00	11,788,987.50	
	AUST & NZ BANKING FRN	5,000,000.00	5,002,750.00	
	AUST & NZ BANKING FRN	6,200,000.00	6,268,634.00	
	AUST & NZ BANKING GROUP	6,500,000.00	6,686,680.00	
	AUST & NZ BANKING GROUP	7,000,000.00	7,172,060.00	
	AUST & NZ BANKING GROUP	2,000,000.00	2,027,620.00	
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4,500,000.00	4,748,220.00	

AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4,300,000.00	4,390,687.00	
AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3,000,000.00	3,019,830.00	
AUSTRALIAN PRIME PROPERT	7,000,000.00	7,317,870.00	
AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5,000,000.00	5,421,850.00	
AUSTRALIAN PRIME PROPERT	6,000,000.00	5,947,500.00	
AUSTRALIAN RAIL TRACK	5,500,000.00	5,622,760.00	
AUSTRALIAN RAIL TRACK	5,000,000.00	5,109,300.00	
BANK OF AMERICA CORP	4,690,000.00	4,795,290.50	
BANK OF AMERICA CORP	7,000,000.00	7,232,960.00	
BANK OF QUEENSLAND	9,500,000.00	9,628,535.00	
BARCLAYS BANK PLC/AUST	15,000,000.00	15,440,850.00	
BHP BILLITON FINANCE LTD	12,000,000.00	12,068,880.00	
BHP FINANCE LTD	12,780,000.00	12,836,743.20	
BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	6,000,000.00	6,712,500.00	
BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	6,000,000.00	6,776,580.00	
BK OF QUEENSLAND	8,000,000.00	8,187,120.00	
BK TOKYO-MIT UFJ SYDNEY	2,400,000.00	2,422,320.00	
BMW AUSTRALIA FINANCE	7,000,000.00	7,022,610.00	
BNP PARIBAS/AUSTRALIA	7,600,000.00	7,641,648.00	
BNP PARIBAS/AUSTRALIA	7,300,000.00	7,401,324.00	
BNP PARIBAS/AUSTRALIA	6,000,000.00	6,121,800.00	
BP CAPITAL MARKETS PLC	3,100,000.00	3,110,478.00	
BP CAPITAL MARKETS PLC	3,000,000.00	3,085,320.00	
BPCE SA	4,500,000.00	4,564,125.00	
BPCE SA	5,100,000.00	5,141,055.00	
BRISBANE AIRPORT	4,500,000.00	4,927,410.00	
BRISBANE AIRPORT	3,000,000.00	3,246,480.00	
BWP TRUST	5,400,000.00	5,554,872.00	
BWP TRUST	2,000,000.00	1,985,720.00	
CALTEX AUSTRALIA FIN LTD	7,600,000.00	8,055,544.00	
CATERPILLAR FIN AUSTRALI	2,500,000.00	2,486,500.00	
CITIGROUP INC	5,000,000.00	5,070,550.00	
CITIGROUP INC	6,500,000.00	6,615,570.00	
COM BK AUSTRALIA	1,500,000.00	1,517,475.00	
COM BK AUSTRALIA	3,000,000.00	3,094,950.00	

COM BK AUSTRALIA	11,000,000.00	11,284,130.00	
COM BK AUSTRALIA	9,800,000.00	10,914,162.00	
COM BK AUSTRALIA	6,000,000.00	6,492,900.00	
COMMONWEALTH BANK AUST	5,000,000.00	4,945,100.00	
COMMONWEALTH BANK AUST	8,000,000.00	8,026,320.00	
COMMONWEALTH BANK AUST	3,000,000.00	3,006,120.00	
COMMONWEALTH BANK AUST	4,000,000.00	3,839,480.00	
COMMONWEALTH PROP FUND	5,000,000.00	5,263,850.00	
COMMONWEALTH PROP FUND	3,000,000.00	3,286,470.00	
CONNECTEAST FINANCE PTY	1,800,000.00	1,929,978.00	
CONNECTEAST FINANCE PTY	5,000,000.00	5,124,000.00	
CREDIT SUISSE SYDNEY	10,000,000.00	10,240,600.00	
CREDIT SUISSE SYDNEY	12,000,000.00	12,164,520.00	
CREDIT SUISSE/SYDNEY FRN	2,000,000.00	2,061,860.00	
CROWN GROUP FINANCE LTD	500,000.00	500,225.00	
DBNGP FINANCE CO PTY	4,000,000.00	4,178,000.00	
DEXUS FINANCE PTY LTD	4,350,000.00	4,505,860.50	
DEXUS FINANCE PTY LTD	3,000,000.00	3,067,170.00	
DEXUS FINANCE PTY LTD	4,500,000.00	4,427,550.00	
DEXUS WHOLESALE PROPERTY	2,000,000.00	2,039,180.00	
DEXUS WHOLESALE PROPERTY	6,000,000.00	6,146,460.00	
DEXUS WHOLESALE PROPERTY	2,000,000.00	2,077,200.00	
ETSA UTILITIES FINANCE	5,800,000.00	5,834,452.00	
EXPORT DEVELOPMNT CANADA	8,500,000.00	8,715,220.00	
EXPORT-IMPORT BANK KOREA	3,000,000.00	3,045,150.00	
EXPORT-IMPORT BK KOR	5,860,000.00	6,027,068.60	
EXPORT-IMPORT BK KOR	4,100,000.00	4,231,241.00	
EXPORT-IMPORT BK KOR	4,000,000.00	4,008,000.00	
FBG FINANCE PTY LTD	5,500,000.00	5,632,495.00	
FEDERATION CENTRES LTD	5,000,000.00	5,322,200.00	
FEDERATION CENTRES LTD	10,500,000.00	11,088,105.00	
FONTERRA COOPERATIVE GRO	8,600,000.00	8,971,606.00	
FONTERRA COOPERATIVE GRO	7,200,000.00	7,938,936.00	
GE CAP AUSTRALIA FUNDING	2,000,000.00	2,024,860.00	
GE CAP AUSTRALIA FUNDING	8,720,000.00	9,360,920.00	

GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5,000,000.00	5,540,200.00	
GLENCORE AUST HOLDINGS P	7,000,000.00	7,188,930.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	6,500,000.00	6,573,255.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,300,000.00	1,334,840.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,000,000.00	3,132,690.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,000,000.00	1,053,790.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,000,000.00	2,999,220.00	
GOODMAN AUSTRALIA INDUST	3,500,000.00	3,566,430.00	
GPT RE LTD	8,730,000.00	9,253,712.70	
GPT RE LTD	7,000,000.00	7,237,090.00	
GPT WHL OFFICE FD NO1	5,800,000.00	5,904,806.00	
GPT WHOLESALE SHOP CENTR	10,000,000.00	10,082,900.00	
HSBC BANK AUSTRALIA	5,000,000.00	5,434,650.00	
HSBC LTD SYDNEY	3,000,000.00	3,021,900.00	
HSBC LTD SYDNEY FRN	4,100,000.00	4,101,763.00	
HYUNDAI CAPITAL SERVICES	6,500,000.00	6,511,505.00	
HYUNDAI CAPITAL SERVICES	2,500,000.00	2,487,100.00	
ICPF FINANCE PTY LTD	5,500,000.00	5,420,910.00	
INCITEC PIVOT LTD	3,500,000.00	3,631,530.00	
ING BANK NV/SYDNEY	8,500,000.00	8,781,010.00	
INVESTA OFFICE FUND	5,000,000.00	5,039,400.00	
JP MORGAN CHASE & CO	5,500,000.00	5,544,550.00	
JP MORGAN CHASE & CO	3,930,000.00	3,989,264.40	
JP MORGAN CHASE & CO	5,000,000.00	5,161,300.00	
JPMORGAN CHASE & CO	5,400,000.00	5,522,148.00	
KOREA DEVELOPMENT BANK	8,450,000.00	8,740,004.00	
KOREA SOUTH-EAST POWER	12,500,000.00	13,379,500.00	
LEND LEASE FIN LTD	4,500,000.00	4,653,495.00	
LEND LEASE FIN LTD	3,000,000.00	3,204,930.00	
LLOYDS BANK PLC	10,000,000.00	10,085,200.00	
MACQUARIE BANK LTD	8,000,000.00	8,050,960.00	
MACQUARIE BANK LTD	8,550,000.00	8,632,080.00	
MACQUARIE UNIVERSITY	5,100,000.00	5,720,517.00	
MET LIFE GLOB FUNDING I	1,300,000.00	1,339,988.00	
MET LIFE GLOB FUNDING I	2,500,000.00	2,482,025.00	

METLIFE GLOB FUNDING I	12,800,000.00	12,868,608.00	
METLIFE GLOB FUNDING I	8,000,000.00	8,195,680.00	
MIRVAC GROUP FINANCE LTD	2,000,000.00	1,938,040.00	
MIRVAC GROUP FUNDING LTD	4,500,000.00	4,558,005.00	
MIRVAC GROUP FUNDING LTD	5,000,000.00	5,353,150.00	
MORGAN STANLEY	4,500,000.00	4,635,495.00	
MUNICIPALITY FINANCE PLC	2,000,000.00	2,210,720.00	
NATIONAL AUSTRALIA B FRN	4,000,000.00	4,059,560.00	
NATIONAL AUSTRALIA B FRN	8,000,000.00	8,040,560.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	5,000,000.00	5,159,800.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	3,000,000.00	2,990,940.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	6,000,000.00	6,596,220.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	5,000,000.00	5,385,200.00	
NATIONAL BK OF ABU DHABI	6,610,000.00	6,700,953.60	
NATIONAL BK OF ABU DHABI	6,000,000.00	6,156,900.00	
NATIONAL WEALTH MANAGEME	6,000,000.00	6,062,880.00	
NATIONAL WEALTH MANAGEME	5,000,000.00	5,565,050.00	
NED WATERSCHAPBK	1,500,000.00	1,635,075.00	
NED WATERSCHAPBK	9,500,000.00	10,674,580.00	
NEDER FINANCIERINGS-MAAT	2,000,000.00	2,196,580.00	
NEDER FINANCIERINGS-MAAT	3,000,000.00	3,194,700.00	
NEW ZEALAND MILK PTY LTD	2,000,000.00	2,154,660.00	
NEWCASTLE PERMAN FRN	5,000,000.00	5,003,550.00	
OPTUS FINANCE PTY LTD	8,800,000.00	9,073,592.00	
OPTUS FINANCE PTY LTD	9,000,000.00	9,281,790.00	
PERTH AIRPORT PTY LTD	1,600,000.00	1,719,568.00	
PERTH AIRPORT PTY LTD	1,800,000.00	1,920,060.00	
QIC SHOPPING CENTRE FUND	7,000,000.00	7,007,210.00	
QIC SHOPPING CENTRE FUND	3,000,000.00	3,069,120.00	
QIC SHOPPING CENTRE FUND	3,000,000.00	3,147,510.00	
QIC SHOPPING CENTRE FUND	3,700,000.00	3,737,555.00	
QPH FINANCE CO PTY LTD	2,350,000.00	2,518,471.50	
RABOBANK NEDERLAND AU	1,400,000.00	1,416,338.00	
RABOBANK NEDERLAND(AUST)	7,500,000.00	7,794,000.00	
RABOBANK NEDERLAND(AUST)	6,000,000.00	6,629,520.00	

ROYAL BK CANADA/SYD	8,000,000.00	8,036,240.00	
ROYAL BK CANADA/SYD	7,000,000.00	7,078,820.00	
SCENTRE GROUP TRUST	5,000,000.00	5,527,000.00	
SCENTRE GROUP TRUST 2	3,000,000.00	3,127,770.00	
SCENTRE MGMT LTD	8,200,000.00	8,525,950.00	
SGSP AUSTRALIA ASSETS	4,600,000.00	4,928,348.00	
SHOPPING CENTRES AUSTRAL	6,500,000.00	6,533,540.00	
SHOPPING CENTRES AUSTRAL	5,000,000.00	4,904,050.00	
STOCKLAND TRUST MGMNT	3,000,000.00	3,163,260.00	
STOCKLAND TRUST MGMNT	11,000,000.00	11,419,870.00	
SUNCORP-METWAY	10,100,000.00	10,310,080.00	
SUNCORP-METWAY	2,000,000.00	2,027,200.00	
SUNCORP-METWAY	10,000,000.00	10,099,900.00	
SUNCORP-METWAY LTD	6,000,000.00	5,641,500.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN	7,000,000.00	7,229,530.00	
SWEDBANK AB	5,400,000.00	5,439,636.00	
SYDNEY AIRPORT FINANCE	2,000,000.00	2,102,200.00	
TELSTRA CORP LTD	6,800,000.00	6,983,668.00	
TELSTRA CORP LTD	2,200,000.00	2,512,488.00	
TELSTRA CORP LTD	1,000,000.00	997,500.00	
TELSTRA CORP LTD	4,500,000.00	4,497,885.00	
TORONTO-DOMINION BANK	7,000,000.00	7,171,430.00	
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	7,500,000.00	7,593,600.00	
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	6,500,000.00	6,699,550.00	
TRANSPower NEW ZEALAND L	4,000,000.00	4,160,400.00	
TRANSPower NEW ZEALAND L	4,990,000.00	5,607,762.00	
TRANSURBAN QUEENSLAND FI	5,000,000.00	5,230,750.00	
TRANSURBAN QUEENSLAND FI	4,000,000.00	3,915,040.00	
UBS AG AUSTRALIA	8,000,000.00	8,211,120.00	
UNITED ENERGY DISTRIBUTI	1,000,000.00	982,230.00	
UNIV OF SYDNEY	4,700,000.00	5,012,926.00	
UNIVERSITY OF MELBOURNE	8,200,000.00	8,617,298.00	
VICINITY CENTRES	5,000,000.00	4,826,600.00	
VICINITY HOLDINGS LTD	6,450,000.00	6,746,184.00	
VOLKSWAGEN FIN SERV AUST	3,000,000.00	3,038,040.00	

	VOLKSWAGEN FIN SERV AUST	4,000,000.00	4,029,800.00	
	VOLKSWAGEN FIN SERV AUST	4,500,000.00	4,603,095.00	
	WELLS FARGO & COMPANY	8,000,000.00	8,086,160.00	
	WELLS FARGO & COMPANY	5,000,000.00	5,128,300.00	
	WELLS FARGO & COMPANY	8,420,000.00	9,116,586.60	
	WELLS FARGO & COMPANY	4,000,000.00	4,234,160.00	
	WELLS FARGO & COMPANY	2,000,000.00	1,989,340.00	
	WESFARMERS LTD	6,500,000.00	6,888,700.00	
	WESFARMERS LTD	7,300,000.00	7,644,049.00	
	WESFARMERS LTD	5,000,000.00	5,090,550.00	
	WESTPAC BANKING	7,000,000.00	7,234,220.00	
	WESTPAC BANKING	2,000,000.00	2,029,780.00	
	WESTPAC BANKING	8,000,000.00	8,914,480.00	
	WESTPAC BANKING	1,500,000.00	1,521,405.00	
	WESTPAC BANKING	9,900,000.00	11,013,948.00	
	WESTPAC BANKING FRN	2,230,000.00	2,231,360.30	
	WOOLWORTHS LTD	6,700,000.00	7,061,733.00	
	WSO FINANCE PTY LTD	3,000,000.00	2,949,480.00	
	WSO FINANCE PTY LTD	1,000,000.00	1,005,210.00	
	社債券小計	1,187,350,000.00	1,228,188,969.50 (106,729,621,449)	
オーストラリアドル小計		2,457,715,940.49	2,611,498,853.55 (226,939,250,372)	
合計 (外貨建証券の邦貨換算額)			226,939,250,372 (226,939,250,372)	

(注)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

有価証券明細表注記
外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
オーストラリアドル	国債証券	12銘柄	16.4%
	地方債証券	47銘柄	23.8%
	特殊債券	57銘柄	12.8%
	社債券	217銘柄	47.0%
			100.0%

第2 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

債券関連

「(3)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 債券関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

通貨関連

「(3)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 通貨関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

2【ファンドの現況】

【＜中京＞アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附付）】

【純資産額計算書】

（2017年 7月31日現在）

資産総額	531,493,244円
負債総額	290,526円
純資産総額（ - ）	531,202,718円
発行済数量	909,382,909口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.5841円

（参考）

アジア・ニュージーランド債券マザーファンド

純資産額計算書

（2017年 7月31日現在）

資産総額	9,679,285,916円
負債総額	4,566円
純資産総額（ - ）	9,679,281,350円
発行済数量	6,623,078,882口

1 単位当たり純資産額 (/)	1.4614円
-------------------	---------

LM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)

純資産額計算書

(2017年 7月31日現在)

資産総額	235,969,405,333円
負債総額	604,737,329円
純資産総額 (-)	235,364,668,004円
発行済口数	448,666,048,771口
1万口当たり純資産額 (/ ×10,000)	5,246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】

<更新後>

（2017年7月末日現在）

（1）資本金の額	10億円
会社が発行する株式の総数	2,600,000株
発行済株式の総数	825,000株
最近5年間に於ける主な資本金の額の増減	なし

（2）委託会社の機構

委託会社の意思決定機構

委託会社は、12名以内で構成される取締役会により運営されます。

取締役は、委託会社の株主であることを要しません。

取締役は、株主総会において株主によって選任され、その任期は選任後2年以内に終了する事業年度の内最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでとします。

取締役会は、社長1名を選定するほか、会長、副社長、専務取締役、および常務取締役を若干名選任することができます。また、取締役会は取締役の中から代表取締役を若干名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、原則として、社長が招集します。取締役会の議長は、原則として、社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席したうえで、出席した取締役の過半数をもって決めます。

運用の意思決定機構

運用委員会は、月1回、運用本部で開催する「ストラテジー会議」で策定された投資環境分析と運用の基本方針案に基づいて検討を行い、運用の基本方針を決定します。

また、運用に関する内規の制定及び改廃のほか、運用ガイドライン等運用のリスク管理に関する事項を決定します。

運用戦略会議は、月1回、運用各部署より運用委員会で決定された運用の基本方針に基づいた個別ファンドの具体的な投資戦略が報告され、その内容について検討を行います。

ファンドマネージャーは、運用戦略会議で検討された投資戦略に基づき、ファンド毎に具体的な運用計画を策定し、運用計画書・運用実施計画に基づいて、運用の指図を行います。

投資情報部は、国内外のマクロ経済・セミマクロ経済の調査・分析、市場環境の分析等をもとに、ファンドマネージャーに情報提供を行うことで、運用をサポートします。また、投資者に経済情勢等に関するタイムリーな情報を発信します。

運用分析会議は、月1回、運用のパフォーマンス向上、運用の適正性の確保、および運用のリスク管理に資することを目的に、個別ファンドの運用パフォーマンスを分析・検証・評価し、運用本部にフィードバックを行います。

売買分析会議は、月1回、運用財産に係る運用の適切性確保に資することを目的にファンドの有価証券売買状況や組入れ状況など、日々、リスク管理部、トレーディング部が行っている運用の指図に関するチェック状況の報告・指摘を行います。議長は会議の結果を取締役会へ報告します。

2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

当社は、「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）及びその受益権の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資一任契約にかかる投資運用業、投資助言・代理業を行っています。

2017年7月末日現在、委託会社の運用する証券投資信託は以下のとおりです。（親投資信託を除く。）

種類	本数（本）	純資産総額(億円)
追加型株式投資信託	163	11,844
追加型公社債投資信託	3	2,420
単位型株式投資信託	70	2,221
単位型公社債投資信託	7	295
合計	243	16,781

純資産総額について、億円未満を切り捨てているため、合計と合わない場合があります。

3【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

(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）ならびに同規則第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年内閣府令第52号）により作成しております。

財務諸表の金額については、千円未満の端数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、当事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表について、東陽監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	10,148,043	12,889,303
有価証券	1,656	94,613
未収委託者報酬	1,128,492	1,073,372
未収運用受託報酬	11,170	18,838
未収投資助言報酬	14,853	11,660
前払費用	43,517	45,683
未収入金		56,411
未収収益	55,508	38,483

繰延税金資産		36,754		5,119
その他の流動資産		3,690		5,642
流動資産合計		11,443,688		14,239,128
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	21,718	1	252,684
器具備品	1	95,958	1	62,605
有形固定資産合計		117,676		315,290
無形固定資産				
ソフトウェア		12,998		10,557
電話加入権		2,122		2,122
無形固定資産合計		15,120		12,680
投資その他の資産				
投資有価証券		4,475,313		2,623,947
親会社株式		1,086,624		915,292
長期差入保証金		108,160		231,697
前払年金費用		60,702		49,496
その他		26,705		26,705
貸倒引当金		14,510		14,510
投資その他の資産合計		5,742,995		3,832,628
固定資産合計		5,875,793		4,160,598
資産合計		17,319,481		18,399,727

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	8,387	7,928
未払金	648,432	787,831
未払収益分配金	18	13
未払償還金	3,795	8,124
未払手数料	573,935	532,071
その他未払金	70,684	247,622
未払費用	221,750	192,452
未払法人税等	472,555	133,340
未払消費税等	86,980	
賞与引当金	33,506	13,420
流動負債合計	1,471,612	1,134,972
固定負債		
退職給付引当金	227,735	257,350
役員退職慰労引当金	33,610	41,120
繰延税金負債	93,015	107,927
資産除去債務	33,865	87,840
長期未払金		29,100
固定負債合計	388,226	523,338
負債合計	1,859,839	1,658,311
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000

資本剰余金		
資本準備金	566,500	566,500
資本剰余金合計	566,500	566,500
利益剰余金		
利益準備金	179,830	179,830
その他利益剰余金		
別途積立金	5,718,662	5,718,662
繰越利益剰余金	7,593,462	8,805,462
利益剰余金合計	13,491,954	14,703,955
株主資本合計	15,058,454	16,270,455
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	401,188	470,961
評価・換算差額等合計	401,188	470,961
純資産合計	15,459,642	16,741,416
負債・純資産合計	17,319,481	18,399,727

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	16,357,045	12,602,269
運用受託報酬	26,459	39,629
投資助言報酬	34,356	30,278
営業収益合計	16,417,861	12,672,177
営業費用		
支払手数料	8,715,105	6,581,071
広告宣伝費	273,041	233,028
公告費	126	220
受益権管理費	16,088	16,958
調査費	1,653,453	1,367,966
調査費	338,352	345,696
委託調査費	1,315,101	1,022,270
委託計算費	316,593	283,205
営業雑経費	370,731	360,386
通信費	58,965	55,900
印刷費	242,346	236,629
諸経費	56,093	55,218
協会費	9,396	9,534
諸会費	3,929	3,104
営業費用合計	11,345,141	8,842,838
一般管理費		
給料	1,564,193	1,634,016
役員報酬	152,970	174,000
給料・手当	1,407,245	1,460,016
賞与	3,978	
交際費	22,013	17,190

寄付金	38,513	21,013
旅費交通費	64,231	49,246
租税公課	41,794	53,904
不動産賃借料	160,609	199,709
賞与引当金繰入	33,506	10,270
退職給付費用	69,282	84,132
役員退職慰労引当金繰入	7,340	12,250
固定資産減価償却費	34,275	29,243
諸経費	365,842	347,126
一般管理費合計	2,401,603	2,458,103
営業利益	2,671,116	1,371,235

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	74,985	1	52,776
受取利息		1,989		694
約款時効収入		10		678
受取負担金		24,695		
受取保険金				20,002
雑益		3,780		3,318
営業外収益合計		105,461		77,469
営業外費用				
信託財産負担金		17		
固定資産除却損	2	40	2	77
為替差損		88		49
雑損		0		
営業外費用合計		146		127
経常利益		2,776,431		1,448,577
特別利益				
有価証券売却益		68,676		
有価証券償還益		548		
投資有価証券売却益		48,335		1,335
投資有価証券償還益		35,073		1,810
親会社株式売却益				133,994
受取補償金				390,000
特別利益合計		152,633		527,140
特別損失				
有価証券売却損		5,395		
有価証券償還損		12,957		19
投資有価証券売却損		67,629		118,400
投資有価証券償還損				72
投資有価証券評価損		24,083		322
移転関連費用				94,360
特別損失合計		110,066		213,173
税引前当期純利益		2,818,998		1,762,543
法人税、住民税及び事業税		797,633		493,560
法人税等調整額		114,260		15,732

法人税等合計	911,894	509,293
当期純利益	1,907,103	1,253,250

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	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		
		資本準 備金	資本剰 余金合 計		その他利益剰余金	利益剰余 金合計					
当期首残高	1,000,000	566,500	566,500	179,830	5,718,662	5,727,608	11,626,100	13,192,600	1,096,597	1,096,597	14,289,197
当期変動額											
剰余金の配当						41,250	41,250	41,250			41,250
当期純利益						1,907,103	1,907,103	1,907,103			1,907,103
株主資本以外の項目の 事業年度中の変動額 (純額)									695,409	695,409	695,409
当期変動額合計						1,865,853	1,865,853	1,865,853	695,409	695,409	1,170,444
当期末残高	1,000,000	566,500	566,500	179,830	5,718,662	7,593,462	13,491,954	15,058,454	401,188	401,188	15,459,642

当事業年度（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							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	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		
		資本準 備金	資本剰 余金合 計		その他利益剰余金	利益剰余 金合計					
当期首残高	1,000,000	566,500	566,500	179,830	5,718,662	7,593,462	13,491,954	15,058,454	401,188	401,188	15,459,642
当期変動額											
剰余金の配当						41,250	41,250	41,250			41,250
当期純利益						1,253,250	1,253,250	1,253,250			1,253,250
株主資本以外の項目の事 業年度中の変動額（純 額）									69,773	69,773	69,773
当期変動額合計						1,212,000	1,212,000	1,212,000	69,773	69,773	1,281,773
当期末残高	1,000,000	566,500	566,500	179,830	5,718,662	8,805,462	14,703,955	16,270,455	470,961	470,961	16,741,416

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は総平均法

により算定)
時価のないもの
総平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法により償却しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成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す。

建物 8～18年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産

定額法により償却しております。

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り償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れ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、貸倒懸念債権等特定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。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与支給に備えるため、当社所定の計算方法による支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異の費用処理方法

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。

(4) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、当社内規に基づく期末要支給見積額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理方法

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。

(会計方針の変更)

(平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

(追加情報)

(繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当会計期間から適用しております。

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	63,927千円	1,614千円
器具備品	162,599 "	67,734 "
計	226,526 "	69,348 "

(損益計算書関係)

1各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
受取配当金	55,470千円	40,590千円

2固定資産除却損の内訳は次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	40千円	77千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	825,000			825,000

2.剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月24日 定時株主総会	普通株式	41,250	50	平成27年3月31日	平成27年6月25日

3.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)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月27日 定時株主総会	普通株式	41,250	利益剰余金	50	平成28年3月31日	平成28年6月28日

当事業年度(自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	825,000			825,000

2. 剰余金の配当に関する事項

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27日 定時株主総会	普通株式	41,250	50	平成28年3月31日	平成28年6月28日

3. 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)	配当金の 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22日 定時株主総会	普通株式	41,250	利益剰余金	50	平成29年3月31日	平成29年6月23日

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

該当事項はありません

2. オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1年以内		80,835
1年超		848,767
合計		929,602

(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、金融商品取引法に定める投資運用業、投資助言・代理業及び第二種金融商品取引業を営んでおります。これらの事業を当社では、自己資金で行っております。

一方、資金運用については、短期的な預金及び債券、投資有価証券での運用を行っております。なお、デリバティブ取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社が保有する主な金融資産は現金及び預金、有価証券、未収委託者報酬、投資有価証券、親会社株式及び差入保証金であります。

預金は預入先金融機関の信用リスクに晒されております。有価証券、投資有価証券及び親会社株式は発行体の信用リスクやマーケットリスク等に晒されております。未収委託者報酬は投資信託財産中から当社（委託者）が得られる報酬であり、未収であるものであります。差入保証金は、主に本店の賃貸に伴うものであり、差入先の信用リスクに晒されております。

金融負債の主なものは、未払金（未払手数料）、未払法人税等であります。未払金（未払手数料）は委託者報酬中から当社が販売会社に支払うべき手数料であり、未払いのものであります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は経営の健全化及び経営資源の効率化を目的として、リスク管理体制の強化を図り、適切なリスク・コントロールに努めております。金融資産に関わる信用リスク、マーケットリスク等を管理するため、社内規程等に従い、ポジション枠や与信枠等の適切な管理に努めております。

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含まれておりません（（注2）参照）。

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	10,148,043	10,148,043	
(2) 有価証券	1,656	1,656	
(3) 未収委託者報酬	1,128,492	1,128,492	
(4) 投資有価証券	3,894,313	3,894,313	
(5) 親会社株式	1,086,624	1,086,624	
(6) 長期差入保証金	108,160	108,160	
(7) 未払金（未払手数料）	573,935	573,935	
(8) 未払金（その他未払金）	70,684	70,684	
(9) 未払法人税等	472,555	472,555	

当事業年度（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) 現金及び預金	12,889,303	12,889,303	
(2) 有価証券	94,613	94,613	
(3) 未収委託者報酬	1,073,372	1,073,372	
(4) 投資有価証券	2,042,947	2,042,947	
(5) 親会社株式	915,292	915,292	
(6) 長期差入保証金	231,697	230,568	1,128
(7) 未払金（未払手数料）	532,071	532,071	
(8) 未払金（その他未払金）	247,622	247,622	
(9) 未払法人税等	133,340	133,340	

(注1) 金融商品の時価の算定方法

- (1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬、(7) 未払金（未払手数料）、(8) 未払金（その他未払金）、(9) 未払法人税等

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。

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券、(5) 親会社株式

これらの時価について、上場株式は取引所の価格、債券は取引所の価格又は日本証券業協会が公表する価格等、投資信託は公表されている基準価額等によっております。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。

(6) 長期差入保証金

合理的に見積りした差入保証金の返還予定時期に基づき、リスク・フリーレートで割引率を算出し割引計算をしております。

(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	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
非上場株式	581,000	581,000

非上場株式については、市場価額がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	10,148,043			
未収委託者報酬	1,128,492			
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他	1,656	3,506,735	86,377	
長期差入保証金	103,593	4,630		
合計	11,381,723	3,511,395	86,377	

当事業年度（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
現金及び預金	12,889,303			
未収委託者報酬	1,073,372			
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他	94,613	1,647,443	78,016	
長期差入保証金		5,359		226,338
合計	14,057,289	1,652,802	78,016	226,338

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

区分	種類	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	(1) 株式	1,350,656	605,961	744,694			
	(2) 債券 国債・地方債等 社債 その他						
	(3) その他				182,820	156,000	26,820
	小計				1,533,476	761,961	771,515
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	10,140	12,350	2,210			
	(2) 債券 国債・地方債等 社債 その他						
	(3) その他				3,438,976	3,629,995	191,018
	小計				3,449,116	3,642,345	193,228
合計		4,982,593	4,404,307	578,286			

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 581,000千円）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。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

区分	種類	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	(1) 株式	1,206,084	460,956	745,127			
	(2) 債券 国債・地方債等 社債 その他						
	(3) その他				233,592	189,506	44,086
	小計				1,439,676	650,462	789,214
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	9,815	12,350	2,535			
	(2) 債券 国債・地方債等 社債 その他						
	(3) その他				1,603,361	1,711,167	107,806
	小計				1,613,176	1,723,517	110,341
合計		3,052,852	2,373,979	678,873			

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 581,000千円）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。

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額
(1) 株式			
(2) 債券			
国債・地方債等			
社債			
その他			
(3) その他	609,484	117,011	73,025
合計	609,484	117,011	73,025

当事業年度（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
(1) 株式	279,000	133,994	
(2) 債券			
国債・地方債等			
社債			
その他			
(3) その他	1,903,935	1,335	118,400
合計	2,182,935	135,329	118,400

3. 減損処理を行った有価証券

前事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

有価証券について24,083千円（その他有価証券のその他24,083千円）減損処理を行っております。

当事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

有価証券について322千円（その他有価証券のその他322千円）減損処理を行っております。

時価のある株式等については、決算日の時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には、原則として減損処理を行い、30%以上50%未満下落した場合には、回復可能性があるものと認められるものを除き、減損処理を行っております。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を利用していないため該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社の退職給付制度は、確定拠出年金制度（証券総合型DC岡三プラン）、確定給付企業年金制度及び退職一時金制度から構成されております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	481,968	511,687
勤務費用	47,703	55,301
利息費用	1,976	
数理計算上の差異の発生額	10,297	1,597
退職給付の支払額	30,258	11,244
退職給付債務の期末残高	511,687	554,146

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	284,842	278,768
期待運用収益	1,424	1,393
数理計算上の差異の発生額	32,888	13,214
事業主からの拠出額	33,038	19,316
退職給付の支払額	7,647	2,241
年金資産の期末残高	278,768	310,452

(3) 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及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	253,108	270,028
年金資産	278,768	310,452
	25,659	40,424
非積立型制度の退職給付債務	258,578	284,118
未積立退職給付債務	232,918	243,694
未認識数理計算上の差異	65,885	35,839
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	167,032	207,854
退職給付引当金	227,735	257,350
前払年金費用	60,702	49,496
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	167,032	207,854

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
--	--------------------------------------	--------------------------------------

勤務費用	47,703	55,301
利息費用	1,976	
期待運用収益	1,424	1,393
数理計算上の差異の費用処理額	6,607	15,233
確定給付制度に係る退職給付費用	54,863	69,141

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
株式	34.5%	36.1%
一般勘定	33.8%	32.7%
債券	19.0%	18.3%
その他	12.7%	12.9%
合計	100.0%	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率は、保有する年金資産のポートフォリオ、過去の運用実績、運用方針、及び市場の動向等を考慮し設定しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
割引率	0.00%	0.08%
長期期待運用収益率	0.50%	0.50%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度14,418千円、当事業年度14,991千円であります。

(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的主要原因別内訳

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	69,732 千円	78,800 千円
役員退職慰労引当金	10,291 "	12,590 "
賞与引当金	10,339 "	4,141 "
ゴルフ会員権評価損	1,838 "	1,838 "
貸倒引当金	4,442 "	4,442 "
その他有価証券評価差額金	59,167 "	33,809 "
有価証券評価損		7,279 "

投資有価証券評価損	9,998	〃	2,817	〃
未払広告宣伝費	7,681	〃	663	〃
資産除去債務	10,369	〃	26,896	〃
未払事業税	32,596	〃	4,792	〃
未払不動産賃借料			11,904	〃
その他	3,508	〃	2,757	〃
繰延税金資産の合計	219,967	〃	192,734	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	236,266	〃	241,721	〃
未収配当金	17,090	〃	11,836	〃
資産除去債務に対応する除去費用	4,285	〃	26,828	〃
前払年金費用	18,587	〃	15,155	〃
繰延税金負債の合計	276,228	〃	295,542	〃
繰延税金資産(負債)の純額	56,261	〃	102,807	〃

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率		30.86%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目		0.60%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目		0.28%
住民税均等割等		0.13%
税額控除		2.21%
その他		0.20%
税効果会計適用後の法人税等の負担率		28.90%

(注) 前事業年度は、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以下であるため注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本店の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から50年と見積り、割引率は1.030%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

	前事業年度 (自平成27年4月 1日 至平成28年3 月31日)		当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	
期首残高	33,292	千円	33,865	千円
有形固定資産の取得に伴う増加額		〃	87,764	〃
時の経過による調整額	573	〃	659	〃

資産除去債務の履行による減少額		"	34,449	"
期末残高	33,865	千円	87,840	千円

（セグメント情報等）

1.セグメント情報

（1）報告セグメントの概要

当社の報告セグメントは、当社の構成単位のうち分離された財務情報が入手可能であり、取締役会が、経営資源の配分の決定及び業績を評価するために、定期的に検討を行う対象となっているものであります。

当社は「投資信託部門」及び「投資顧問部門」ごとに、経営戦略を立案・決定し、経営資源の配分及び業績の評価を行っております。

なお、「投資顧問部門」のセグメントの売上高、利益又は損失の金額及び資産の額がいずれも事業セグメントの合計額の10%未満でありますので、報告セグメントは「投資信託部門」のみであります。

報告セグメントである「投資信託部門」では投資信託の運用、商品開発等を行っております。報告セグメントが1つであり、開示情報としての重要性が乏しいため、セグメント情報の記載を省略しております。

（2）報告セグメントごとの売上高、利益又は損失、資産、負債その他の項目の金額の算定方法

報告セグメントが1つであり、開示情報としての重要性が乏しいため、セグメント情報の記載を省略しております。

（3）報告セグメントごとの売上高、利益又は損失、資産、負債その他の項目の金額に関する情報

前事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

報告セグメントが1つであり、開示情報としての重要性が乏しいため、セグメント情報の記載を省略しております。

当事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

報告セグメントが1つであり、開示情報としての重要性が乏しいため、セグメント情報の記載を省略しております。

（4）報告セグメント合計額と財務諸表計上額との差額及び当該差額の主な内容（差異調整に関する事項）

前事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

報告セグメントが1つであり、開示情報としての重要性が乏しいため、セグメント情報の記載を省略しております。

当事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

報告セグメントが1つであり、開示情報としての重要性が乏しいため、セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

前事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

(1)製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客へ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)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客へ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。

す。

有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

(3)主要な顧客ごとの情報

該当事項はありません。

当事業年度（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

単一の製品・サービスの区分の外部顧客へ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)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客へ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。

有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

(3)主要な顧客ごとの情報

該当事項はありません。

3.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。

4.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。

5.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。

(関連当事者情報)

1.関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

前事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (千円)	事業の内容 又は職業	議決権等の所有 (被所有)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)
同一の親会社 を持つ会社	岡三証券 株式会社	東京都 中央区	5,000,000	証券業	被所有 直接 2.30%	当社ファンド の募集取 扱	支払手数料 の支払 (注2)	3,730,087 (注1)	未払 手 数 料	216,005 (注1)

(注) 1.上記の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2.取引条件及び取引条件の決定方針

過去の取引条件及びファンドの商品性を勘案して決定しております。

当事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (千円)	事業の内容 又は職業	議決権等の所有 (被所有)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)
----	------------	-----	------------------	---------------	--------------------	-----------	-------	--------------	----	--------------

同一の親会社 を持つ会社	岡三証券 株式会社	東京都 中央区	5,000,000	証券業	被所有 直接 2.30%	当社ファン ドの募集取 扱	支払手数料 の支払 (注2)	2,814,695 (注1)	未払 手数 料	197,827 (注1)
-----------------	--------------	------------	-----------	-----	--------------------	---------------------	----------------------	-------------------	---------------	-----------------

(注) 1.上記の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2.取引条件及び取引条件の決定方針

過去の取引条件及びファンドの商品性を勘案して決定しております。

2.親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1)親会社情報

株式会社岡三証券グループ(東京証券取引所に上場)

(2)重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	18,738円96銭	20,292円62銭
1株当たり当期純利益金額	2,311円64銭	1,519円09銭

(注) 1.潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式がないため記載しておりません。

2.1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりです。

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	1,907,103千円	1,253,250千円
普通株主に帰属しない金額		
普通株式に係る当期純利益	1,907,103千円	1,253,250千円
普通株式の期中平均株式数	825,000株	825,000株

3.1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりです。

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
純資産の部の合計額	15,459,642千円	16,741,416千円
純資産の部から控除する合計額		
普通株式に係る期末の純資産額	15,459,642千円	16,741,416千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の 普通株式の数	825,000株	825,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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】

<訂正前>

(1)「受託会社」

三井住友信託銀行株式会社
資本金の額

平成28年3月末日現在、342,037百万円

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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 「販売会社」（資本金の額は、平成28年3月末日現在）

(略)

<訂正後>

(1) 「受託会社」

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

2017年3月末日現在、342,037百万円

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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 「販売会社」（資本金の額は、2017年3月末日現在）

(略)

独立監査人の監査報告書

平成29年9月11日

岡三アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

東 陽 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 宝金正典 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 猿渡裕子 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「＜中京＞アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附）」の平成29年1月21日から平成29年7月20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、「＜中京＞アジア・オセアニア債券オープン（環境応援寄附）」の平成29年7月20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

岡三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](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年6月22日

岡三アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

東陽監査法人

指定社員 公認会計士 鈴木基仁 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 猿渡裕子 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」に掲げられている岡三アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第53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、岡三アセットマネジメント株式会社の平成29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。

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。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。