

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年 1月19日提出
【発行者名】	損保ジャパン日本興亜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 山口 裕之
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目 2番16号
【事務連絡者氏名】	須田 静
【電話番号】	03-5290-3469
【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】	グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース （上記を総称して「グローバル変動金利債券ファンド」ということがあります。）
【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】	募集額 グローバル変動金利債券ファンドの合計で、5,000億円を上限とします。
【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】

平成29年7月19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。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正内容を示します。

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】

<訂正前>

（略）

<ファンドの特色>

（略）

ユニオンバンケール プリヴェ ユービーピー エスエーについて

- ・ スイスを代表する資産運用会社の一つ
- ・ 1969年スイスで設立。グローバルに24拠点を展開
- ・ 運用資産額：1,183億スイスフラン(約13兆5,110億円)
- ・ 世界の個人投資家・機関投資家に様々な運用戦略を提供

(2016年12月末現在)

（略）

<訂正後>

（略）

<ファンドの特色>

（略）

ユニオンバンケール プリヴェ ユービーピー エスエーについて

- ・ スイスを代表する資産運用会社の一つ
- ・ 1969年スイスで設立。グローバルに24拠点を展開
- ・ 運用資産額：1,189億スイスフラン(約13兆9,184億円)
- ・ 世界の個人投資家・機関投資家に様々な運用戦略を提供

(2017年6月末現在)

（略）

（ 3 ）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（ 略 ）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円 （平成29年4月末現在）

（ 略 ）

（ ）大株主の状況（平成29年4月末現在）

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円 （平成29年10月末現在）

（ 略 ）

（ ）大株主の状況（平成29年10月末現在）

（ 略 ）

2【投資方針】

（3）【運用体制】

<訂正前>

a．委託会社の運用体制と社内規程

（略）

平成29年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

b．運用委託先の運用体制等

（略）

上記は平成29年4月末現在のものであり、今後変更される場合もあります。

<訂正後>

a．委託会社の運用体制と社内規程

（略）

平成29年10月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

b．運用委託先の運用体制等

（略）

上記は平成29年10月末現在のものであり、今後変更される場合もあります。

（5）【投資制限】

<訂正前>

a．各ファンドの信託約款に基づく投資制限

（略）

資金の借入れ

（略）

（ ） 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（略）

<訂正後>

a．各ファンドの信託約款に基づく投資制限

（略）

資金の借入れ

（略）

（ ） 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

（略）

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

< リスクの管理体制 >

a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

(注) 上図は、平成29年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

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

※データは、設定日より掲載しています。

円ヘッジありコース

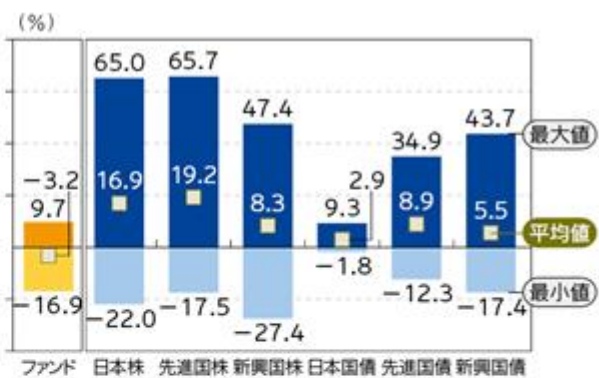


ファンドと他の代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なりますので、ご注意ください。



円ヘッジなしコース



2012年5月～2017年4月

ファンド : 2015年4月～2017年4月
代表的な資産クラス: 2012年5月～2017年4月

●上記は、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および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および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。

●上記は、期間5年のグラフになります。

●「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

代表的な資産クラスの指数		
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
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、円換算ベース)	MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI 国債	野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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債券インデックスです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLCは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国債	J PモルガンGBI-EM グローバル・ディバーシファイド (円ベース)	J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、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。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(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。

< 訂正後 >

(略)

< リスクの管理体制 >

a. 委託会社のリスク管理体制

(略)

(注)上図は、平成29年10月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

(略)

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

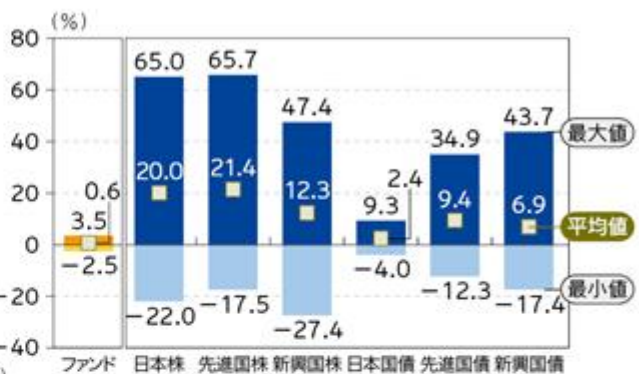
※データは、設定日より掲載しています。

円ヘッジありコース



ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なりますので、ご注意ください。



円ヘッジなしコース



2012年11月～2017年10月

ファンド :2015年4月～2017年10月
代表的な資産クラス:2012年11月～2017年10月

- 上記は、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および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および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。
- 上記は、期間5年のグラフになります。

- 「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

代表的な資産クラスの指数		
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
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、円換算ベース)	MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI 国債	野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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債券インデックスです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は Citigroup Index LLCに帰属します。また、Citigroup Index LLCは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国債	J PモルガンGBI-EM グローバル・ディバーシファイド (円ベース)	J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、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。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(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。

4【手数料等及び税金】

（3）【信託報酬等】

<訂正前>

（略）

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日及び毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

（略）

<訂正後>

（略）

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日及び毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

（略）

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記は平成29年4月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

（略）

上記は平成29年10月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	5,880,727,200	97.22
内 日本	5,880,727,200	97.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	168,225,947	2.78
純資産総額	6,048,953,147	100.00

その他資産の投資状況

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	5,303,450,000	87.68
内 日本	5,303,450,000	87.68

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	584,974,218	98.06
内 日本	584,974,218	98.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,560,054	1.94
純資産総額	596,534,272	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況
グローバル変動金利債券マザーファンド

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	236,760,592	2.44
内 韓国	236,760,592	2.44
社債券	9,180,802,318	94.52
内 アメリカ	2,705,654,174	27.86
内 イギリス	838,286,969	8.63
内 スウェーデン	771,908,375	7.95
内 日本	675,265,252	6.95
内 フランス	655,030,422	6.74
内 オランダ	596,094,384	6.14
内 オーストラリア	549,167,854	5.65
内 カナダ	466,204,968	4.80
内 スペイン	335,526,327	3.45
内 スイス	322,409,518	3.32
内 イタリア	211,559,125	2.18
内 デンマーク	202,260,929	2.08
内 ノルウェー	174,512,069	1.80
内 ベルギー	124,715,978	1.28
内 ガーンジー	118,682,208	1.22
内 メキシコ	118,492,664	1.22
内 ドイツ	98,155,889	1.01
内 ルクセンブルグ	92,104,092	0.95
内 イギリス領バーズン 諸島	90,793,247	0.93
内 中国	33,977,874	0.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	295,283,763	3.04
純資産総額	9,712,846,673	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（注3）為替予約取引の時価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

平成29年10月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	グローバル変動金利債券マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	5,454,208,125	0.9899 5,399,268,223	1.0782 5,880,727,200	- -	97.22%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.22%
合計	97.22%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

平成29年10月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	グローバル変動金利債券マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	542,547,040	0.9882 536,188,005	1.0782 584,974,218	- -	98.06%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.06%
合計	98.06%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）マザーファンドの投資資産

グローバル変動金利債券マザーファンド

平成29年10月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	CITIGROUP INC FLOAT 2017/11/10 アメリカ	社債券	197,640,000	100.15 197,948,318	100.26 198,165,722	1.072000 2017/11/10	2.04%
2	DANSKE BANK A/S FLOAT 2022/04/06 デンマーク	社債券	158,112,000	106.93 169,075,486	113.56 179,555,149	5.875000 2022/4/6	1.85%
3	MITSUB UFJ LEASE FLOAT 2019/07/23 日本	社債券	169,740,000	99.83 169,465,021	100.44 170,491,948	2.137500 2019/7/23	1.76%
4	BANK OF AMER CRP FLOAT 2019/05/06 アメリカ	社債券	158,112,000	101.84 161,024,423	101.66 160,746,145	1.131000 2019/5/6	1.65%
5	SKANDINAV ENSKIL 5.75% 2020/05/13 スウェーデン	社債券	147,108,000	101.56 149,414,653	104.30 153,438,057	5.750000 2020/5/13	1.58%
6	SVENSKA HNDLSBKN 5.25% 2021/03/01 スウェーデン	社債券	147,108,000	100.37 147,655,241	103.16 151,768,381	5.250000 2021/3/1	1.56%
7	MORGAN STANLEY Float 2019/01/24 アメリカ	社債券	147,108,000	100.73 148,187,772	100.56 147,939,160	2.214760 2019/1/24	1.52%
8	INTESA SANPAOLO FLOAT 2020/06/15 イタリア	社債券	144,936,000	101.05 146,466,524	102.03 147,881,099	0.721000 2020/6/15	1.52%
9	FORD MOTOR CRED Float 2019/03/12 アメリカ	社債券	147,108,000	100.35 147,622,878	100.45 147,780,283	2.140330 2019/3/12	1.52%
10	ABN AMRO BANK NV 5.75% 2020/09/22 オランダ	社債券	131,760,000	103.86 136,853,841	110.01 144,957,081	5.750000 2020/9/22	1.49%
11	HSBC HOLDINGS 6.875% 2021/06/01 イギリス	社債券	124,476,000	106.63 132,734,982	109.82 136,700,787	6.875000 2021/6/1	1.41%
12	JPMORGAN CHASE FLOAT 2022/04/25 アメリカ	社債券	124,476,000	100.10 124,605,319	100.97 125,694,620	2.267420 2022/4/25	1.29%
13	KBC GROEP NV 5.625% 2019/03/19 ベルギー	社債券	118,584,000	101.65 120,548,936	105.17 124,715,978	5.625000 2019/3/19	1.28%
14	SWEDBANK AB 6.0% 2022/03/17 スウェーデン	社債券	113,160,000	107.87 122,071,350	107.56 121,720,554	6.000000 2022/3/17	1.25%
15	COOPERATIEVE RAB 6.625% 2021/06/29 オランダ	社債券	105,408,000	111.85 117,898,848	115.43 121,674,562	6.625000 2021/6/29	1.25%
16	CRED SUIS GP FUN FLOAT 2021/04/16 ガーンジィ	社債券	113,160,000	104.87 118,674,286	104.88 118,682,208	3.643890 2021/4/16	1.22%
17	BANK OF NY MELLO FLOAT 2022/10/30 アメリカ	社債券	113,160,000	102.70 116,223,874	102.29 115,757,022	2.427960 2022/10/30	1.19%
18	COM BK AUSTRALIA FLOAT 2021/09/06 オーストラリア	社債券	113,160,000	100.81 114,085,761	101.07 114,380,996	2.146110 2021/9/6	1.18%

19	DISCOVERY COMMUN FLOAT 2019/09/20 アメリカ	社債券	113,160,000	100.31 113,518,717	100.55 113,792,564	2.036110 2019/9/20	1.17%
20	BNP PARIBAS 7.625% 2021/03/30 フランス	社債券	101,844,000	108.89 110,903,023	111.68 113,747,526	7.625000 2021/3/30	1.17%
21	BANK OF AMER CRP FLOAT 2020/07/21 アメリカ	社債券	113,160,000	100.24 113,442,809	100.20 113,389,714	2.022500 2020/7/21	1.17%
22	CREDIT SUISSE 7.125% 2022/07/29 スイス	社債券	101,844,000	106.80 108,774,597	109.57 111,598,618	7.125000 2022/7/29	1.15%
23	UBS GROUP 5.75% 2022/02/19 スイス	社債券	92,232,000	107.76 99,395,659	115.65 106,669,074	5.750000 2022/2/19	1.10%
24	GOLDMAN SACHS GP Float 2023/11/29 アメリカ	社債券	101,844,000	103.01 104,917,651	104.02 105,942,202	2.917220 2023/11/29	1.09%
25	NORDEA BANK AB 5.5% 2019/09/23 スウェーデン	社債券	101,844,000	101.01 102,877,716	103.65 105,563,342	5.500000 2019/9/23	1.09%
26	WELLS FARGO CO FLOAT 2022/10/31 アメリカ	社債券	101,844,000	101.73 103,609,431	102.48 104,379,915	2.541110 2022/10/31	1.07%
27	MORGAN STANLEY FLOAT 2022/10/24 アメリカ	社債券	101,844,000	101.68 103,559,958	102.40 104,288,256	2.764760 2022/10/24	1.07%
28	BARCLAYS BK PLC 7.625% 2022/11/21 イギリス	社債券	90,528,000	108.82 98,521,622	114.79 103,922,522	7.625000 2022/11/21	1.07%
29	DNB BANK ASA FLOAT 2021/06/02 ノルウェー	社債券	101,844,000	101.09 102,959,191	102.02 103,910,414	2.386110 2021/6/2	1.07%
30	GEN MOTORS FIN FLOAT 2019/01/15 アメリカ	社債券	101,957,160	102.43 104,443,895	101.84 103,838,269	3.419170 2019/1/15	1.07%

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年10月31日現在

種類	投資比率
特殊債券	2.44%
社債券	94.52%
合計	96.96%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

平成29年10月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約 取引	日本	アメリカ・ドル売 / 円買2017年 12月	売建	35,880,000	3,900,852,072	4,053,722,400	67.02%
		ユーロ売 / 円買2017年12月	売建	9,482,000	1,223,868,289	1,249,727,600	20.66%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

グローバル変動金利債券マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

直近日（平成29年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成27年4月20日)	10,386,583,679	10,386,583,679	1.0108	1.0108
第2計算期間末 (平成28年4月20日)	7,974,960,748	7,974,960,748	0.9932	0.9932
第3計算期間末 (平成29年4月20日)	5,674,416,512	5,674,416,512	1.0132	1.0132
平成28年10月末日	6,818,646,009	-	1.0081	-
11月末日	6,328,830,701	-	1.0045	-
12月末日	6,244,974,614	-	1.0123	-
平成29年1月末日	5,920,323,092	-	1.0125	-
2月末日	5,782,773,296	-	1.0131	-
3月末日	5,736,285,849	-	1.0139	-
4月末日	5,710,686,614	-	1.0174	-
5月末日	5,794,726,947	-	1.0206	-
6月末日	5,730,066,823	-	1.0226	-
7月末日	5,798,516,781	-	1.0270	-
8月末日	6,006,319,010	-	1.0259	-
9月末日	5,895,883,499	-	1.0301	-
10月末日	6,048,953,147	-	1.0363	-

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

直近日（平成29年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成27年4月20日)	1,030,640,936	1,030,640,936	1.0300	1.0300
第2計算期間末 (平成28年4月20日)	715,150,174	715,150,174	0.9594	0.9594
第3計算期間末 (平成29年4月20日)	566,574,742	566,574,742	0.9602	0.9602
平成28年10月末日	578,711,645	-	0.9212	-
11月末日	601,253,197	-	0.9703	-
12月末日	617,803,515	-	1.0061	-
平成29年1月末日	590,892,253	-	0.9937	-
2月末日	577,550,890	-	0.9815	-
3月末日	581,412,031	-	0.9830	-
4月末日	576,717,287	-	0.9866	-
5月末日	576,942,579	-	0.9955	-
6月末日	590,878,291	-	1.0123	-
7月末日	578,464,805	-	1.0109	-
8月末日	588,104,700	-	1.0145	-
9月末日	595,807,126	-	1.0357	-
10月末日	596,534,272	-	1.0441	-

【分配の推移】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
平成29年4月21日～ 平成29年10月20日	-

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
平成29年4月21日～ 平成29年10月20日	-

【収益率の推移】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

	収益率(%)
第1計算期間	1.1
第2計算期間	1.7
第3計算期間	2.0
平成29年4月21日～ 平成29年10月20日	2.1

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（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。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	6.9
第3計算期間	0.1
平成29年4月21日～ 平成29年10月20日	8.6

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（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。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

	設定口数	解約口数
第1計算期間	11,411,251,985	1,135,172,974
第2計算期間	1,566,971,515	3,813,802,846
第3計算期間	563,942,119	2,992,946,811
平成29年4月21日～ 平成29年10月20日	1,239,018,294	1,153,116,293

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

	設定口数	解約口数
第1計算期間	1,152,885,300	152,254,101
第2計算期間	142,259,613	397,508,153
第3計算期間	6,900,053	162,211,935
平成29年4月21日～ 平成29年10月20日	53,663,538	66,726,915

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

< 参考情報 >

基準日:2017年10月31日

● 基準価額・純資産の推移 2014/04/30～2017/10/31



● 円ヘッジなしコース



- 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。
- 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

● 分配の推移

● 円ヘッジありコース

2015年04月	0円
2016年04月	0円
2017年04月	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

● 円ヘッジなしコース

2015年04月	0円
2016年04月	0円
2017年04月	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

- 1万口当たり、税引前

● 主要な資産の状況

● 円ヘッジありコース

資産別構成	
資産の種類	純資産比
グローバル変動金利債券マザーファンド	97.22%
コール・ローン等	2.78%
合計	100.00%

● 円ヘッジなしコース

資産別構成	
資産の種類	純資産比
グローバル変動金利債券マザーファンド	98.06%
コール・ローン等	1.94%
合計	100.00%

● グローバル変動金利債券マザーファンド

資産別構成	
資産の種類	純資産比
公社債	96.96%
コール・ローン等	3.04%
合計	100.00%

通貨別構成	
通貨	純資産比
アメリカ・ドル	74.6%
ユーロ	22.3%
コール・ローン等	3.0%
合計	100.0%

- 上記の運用実績は、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。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

組入上位10銘柄						
	銘柄名	発行国	業種	通貨	償還日	純資産比
1	CITIGROUP INC FLOAT	アメリカ	銀行	ユーロ	2018/02/10	2.0%
2	DANSKE BANK A/S FLOAT	デンマーク	銀行	ユーロ	2022/04/06	1.9%
3	MITSUB UFJ LEASE FLOAT	アメリカ	各種金融	アメリカ・ドル	2019/07/23	1.8%
4	BANK OF AMER CRP FLOAT	アメリカ	銀行	ユーロ	2019/05/06	1.7%
5	SKANDINAV ENSKIL 5.75%	アメリカ	銀行	アメリカ・ドル	2020/05/13	1.6%
6	SVENSKA HNDLSBKN 5.25%	アメリカ	銀行	アメリカ・ドル	2021/03/01	1.6%
7	MORGAN STANLEY Float	アメリカ	銀行	アメリカ・ドル	2019/01/24	1.5%
8	INTESA SANPAOLO FLOAT	イタリア	銀行	ユーロ	2020/06/15	1.5%
9	FORD MOTOR CRED Float	アメリカ	各種金融	アメリカ・ドル	2019/03/12	1.5%
10	ABN AMRO BANK NV 5.75%	オランダ	銀行	ユーロ	2020/09/22	1.5%
組入銘柄数					128銘柄	

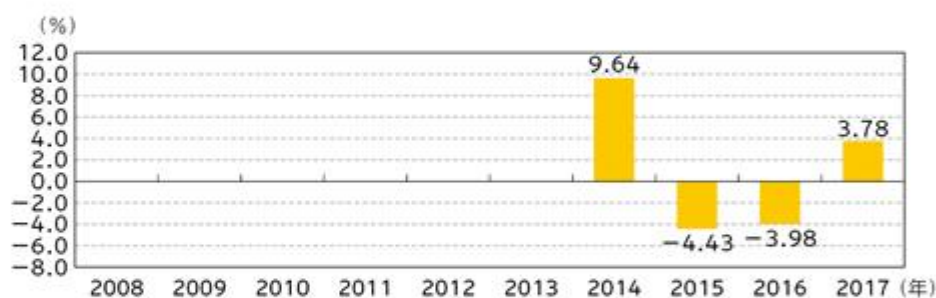
● 償還日は、コール償還がある場合はコール償還日を記載しております。

年間収益率の推移（暦年ベース）

● 円ヘッジありコース



● 円ヘッジなしコース



- ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。
- 2014年は設定日(4月30日)から年末、2017年は年初から基準日までの収益率です。
- 各ファンドはベンチマークを設定していません。

- 上記の運用実績は、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。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

平成30年1月15日より、公告の方法は以下のとおり変更される予定です。

() 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.sjnk-am.co.jp/>

() 前記()の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(略)

<訂正後>

(略)

公告

() 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.sjnk-am.co.jp/>

() 前記()の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(略)

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

以下の記載内容を追加いたします。

<追加>

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「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。）ならびに同規則第38条の3および第57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、中間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. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成29年4月21日から平成29年10月20日までの中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けておりません。

【グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 平成29年4月20日現在	第4期中間計算期間末 平成29年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	219,856,818	271,894,381
親投資信託受益証券	5,410,248,694	5,818,829,963
派生商品評価勘定	149,143,686	-
流動資産合計	5,779,249,198	6,090,724,344
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	180,294,499
未払解約金	78,118,258	13,843,183
未払受託者報酬	1,319,535	1,260,800
未払委託者報酬	25,261,814	14,814,920
その他未払費用	133,079	126,811
流動負債合計	104,832,686	210,340,213
負債合計	104,832,686	210,340,213
純資産の部		
元本等		
元本	5,600,242,988	5,686,144,989
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	74,173,524	194,239,142
純資産合計	5,674,416,512	5,880,384,131
負債純資産合計	5,779,249,198	6,090,724,344

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 3 期中間計算期間		第 4 期中間計算期間	
	自	平成28年 4 月21日 至 平成28年10月20日	自	平成29年 4 月21日 至 平成29年10月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		365,155,250		494,581,269
為替差損益		490,227,313		360,180,151
営業収益合計		125,072,063		134,401,118
営業費用				
支払利息		85,652		89,971
受託者報酬		1,615,921		1,260,800
委託者報酬		35,147,434		14,814,920
その他費用		145,996		132,372
営業費用合計		36,995,003		16,298,063
営業利益又は営業損失（ ）		88,077,060		118,103,055
経常利益又は経常損失（ ）		88,077,060		118,103,055
中間純利益又は中間純損失（ ）		88,077,060		118,103,055
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		5,932,202		12,385,728
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		54,286,932		74,173,524
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,310,134		30,763,045
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,259,785		-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		50,349		30,763,045
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		16,414,754
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		16,414,754
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		36,168,060		194,239,142

(3)【中間注記表】

(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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における中間計算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. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 平成29年4月20日現在	第4期中間計算期間末 平成29年10月20日現在
1. 受益権の総数	5,600,242,988口	5,686,144,989口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0132円 (10,132円)	1.0342円 (10,342円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期中間計算期間 自 平成28年4月21日 至 平成28年10月20日	第4期中間計算期間 自 平成29年4月21日 至 平成29年10月20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	7,635,423円	4,572,904円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成29年4月20日現在	第4期中間計算期間末 平成29年10月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 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）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、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。</p>	同左

（その他の注記）

項目	第3期	第4期中間計算期間
	自 平成28年4月21日 至 平成29年4月20日	自 平成29年4月21日 至 平成29年10月20日
期首元本額	8,029,247,680円	5,600,242,988円
期中追加設定元本額	563,942,119円	1,239,018,294円
期中一部解約元本額	2,992,946,811円	1,153,116,293円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第3期 平成29年4月20日現在				第4期中間計算期間末 平成29年10月20日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	5,211,914,862	-	5,062,771,176	149,143,686	5,124,720,361	-	5,305,014,860	180,294,499
アメリカ・ドル	3,378,816,400	-	3,269,065,800	109,750,600	3,900,852,072	-	4,037,935,200	137,083,128
イギリス・ポンド	273,561,700	-	270,782,352	2,779,348	-	-	-	-
ユーロ	1,559,536,762	-	1,522,923,024	36,613,738	1,223,868,289	-	1,267,079,660	43,211,371
合計	5,211,914,862	-	5,062,771,176	149,143,686	5,124,720,361	-	5,305,014,860	180,294,499

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日または中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう
に評価しております。
計算期間末日または中間計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。
計算期間末日または中間計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
（イ）計算期間末日または中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
（ロ）計算期間末日または中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
2. 計算期間末日または中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日または中間計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

【グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第 3 期 平成29年 4 月20日現在	第 4 期中間計算期間末 平成29年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,448,705	20,267,492
親投資信託受益証券	552,688,409	583,780,615
流動資産合計	569,137,114	604,048,107
資産合計	569,137,114	604,048,107
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,035,400
未払受託者報酬	127,377	126,554
未払委託者報酬	2,422,208	1,487,441
その他未払費用	12,787	12,659
流動負債合計	2,562,372	2,662,054
負債合計	2,562,372	2,662,054
純資産の部		
元本等		
元本	590,070,777	577,007,400
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	23,496,035	24,378,653
純資産合計	566,574,742	601,386,053
負債純資産合計	569,137,114	604,048,107

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 3 期中間計算期間		第 4 期中間計算期間	
	自	平成28年 4月21日 至 平成28年10月20日	自	平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		32,373,416		49,682,206
営業収益合計		32,373,416		49,682,206
営業費用				
支払利息		7,834		7,450
受託者報酬		135,157		126,554
委託者報酬		2,940,635		1,487,441
その他費用		15,041		13,188
営業費用合計		3,098,667		1,634,633
営業利益又は営業損失()		35,472,083		48,047,573
経常利益又は経常損失()		35,472,083		48,047,573
中間純利益又は中間純損失()		35,472,083		48,047,573
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()		3,576,076		3,586,879
期首剰余金又は期首欠損金()		30,232,485		23,496,035
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,611,589		3,413,994
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,611,589		2,558,687
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		855,307
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		57,516,903		24,378,653

(3)【中間注記表】

(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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 平成29年4月20日現在	第4期中間計算期間末 平成29年10月20日現在
1. 受益権の総数	590,070,777口	577,007,400口
2. 元本の欠損	23,496,035円	
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9602円 (9,602円)	1.0423円 (10,423円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期中間計算期間 自 平成28年4月21日 至 平成28年10月20日	第4期中間計算期間 自 平成29年4月21日 至 平成29年10月20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	640,581円	456,778円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成29年4月20日現在	第4期中間計算期間末 平成29年10月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しておりません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 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）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 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。	同左

（その他の注記）

項目	第3期		第4期中間計算期間	
	自 平成28年4月21日 至 平成29年4月20日		自 平成29年4月21日 至 平成29年10月20日	
期首元本額		745,382,659円		590,070,777円
期中追加設定元本額		6,900,053円		53,663,538円
期中一部解約元本額		162,211,935円		66,726,915円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

<参考>

「グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース」及び「グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース」は、「グローバル変動金利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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次のとおりです。

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

グローバル変動金利債券マザーファンドの状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	平成29年4月20日現在	平成29年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	190,790,606	14,128,565
コール・ローン	93,081,055	159,205,269
特殊債券	174,333,110	235,983,630
社債券	6,853,729,022	9,161,137,680
派生商品評価勘定	142,500	-
未収入金	-	62,426,653
未収利息	22,745,888	48,915,949
前払費用	6,218,853	1,721,021
流動資産合計	7,341,041,034	9,683,518,767
資産合計	7,341,041,034	9,683,518,767
負債の部		
流動負債		
未払金	33,613,354	62,370,832
その他未払費用	1,708	130
流動負債合計	33,615,062	62,370,962
負債合計	33,615,062	62,370,962
純資産の部		
元本等		
元本	7,408,527,188	8,941,560,604
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	101,101,216	679,587,201
純資産合計	7,307,425,972	9,621,147,805
負債純資産合計	7,341,041,034	9,683,518,767

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	<p>特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、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、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、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>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算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。</p>
3. 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・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末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>
4. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」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。</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年4月20日現在	平成29年10月20日現在
1. 受益権の総数	7,408,527,188口	8,941,560,604口
2. 元本の欠損	101,101,216円	
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9864円 (9,864円)	1.0760円 (10,760円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年4月20日現在	平成29年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 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）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 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。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、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

（その他の注記）

項目	自 平成28年4月21日 至 平成29年4月20日	自 平成29年4月21日 至 平成29年10月20日
本報告書における開示対象 ファンドの期首における当該 親投資信託の元本額	9,213,744,500円	7,408,527,188円
同期中追加設定元本額	1,526,071,813円	1,954,711,253円
同期中一部解約元本額	3,331,289,125円	421,677,837円

元本の内訳*		
ファンド名		
グローバル変動金利債券ファンド（年1回分配型）円ヘッジありコース（適格機関投資家専用）	735,012,382円	1,553,523,448円
グローバル変動金利債券ファンド（年1回分配型）円ヘッジなしコース（適格機関投資家専用）	547,256,274円	1,364,701,069円
グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース	5,484,842,553円	5,407,834,539円
グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース	560,308,607円	542,547,040円
グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）円ヘッジありコース	36,265,935円	31,893,375円
グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）円ヘッジなしコース	44,841,437円	41,061,133円
計	7,408,527,188円	8,941,560,604円

* 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ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年4月20日 現在				平成29年10月20日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	32,569,500	-	32,712,000	142,500	-	-	-	-
アメリカ・ドル	32,569,500	-	32,712,000	142,500	-	-	-	-
合計	32,569,500	-	32,712,000	142,500	-	-	-	-

（注）時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。
 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 （イ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 （ロ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
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。

2【ファンドの現況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコース

平成29年10月31日現在

資産総額	6,247,660,746円
負債総額	198,707,599円
純資産総額（ - ）	6,048,953,147円
発行済数量	5,836,857,017口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0363円

グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコース

平成29年10月31日現在

資産総額	596,634,872円
負債総額	100,600円
純資産総額（ - ）	596,534,272円
発行済数量	571,337,107口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0441円

（参考）マザーファンドの現況

グローバル変動金利債券マザーファンド

平成29年10月31日現在

資産総額	9,741,152,928円
負債総額	28,306,255円
純資産総額（ - ）	9,712,846,673円
発行済数量	9,008,373,954口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0782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】

<訂正前>

(1) 資本金の額（平成29年4月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（平成29年4月末現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（平成29年10月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（平成29年10月末現在）

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

（略）

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は平成29年4月末現在、計142本（追加型株式投資信託118本、単位型株式投資信託14本、単位型公社債投資信託10本）であり、その純資産総額の合計は688,299百万円です。

<訂正後>

（略）

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は平成29年10月末現在、計148本（追加型株式投資信託123本、単位型株式投資信託12本、単位型公社債投資信託13本）であり、その純資産総額の合計は742,141百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1．委託会社である損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という。)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。)、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。

また、委託会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)、ならびに、同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「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。

2．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、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、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

また、委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期中間会計期間(平成29年4月1日から平成29年9月30日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		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)
区分	注記 番号	金額(千円)	金額(千円)
(資産の部)			
流動資産			
1 現金・預金		4,375,837	5,032,858
2 前払費用		81,218	77,585
3 未収委託者報酬		754,788	760,025
4 未収運用受託報酬		521,498	788,836
5 未収収益		149	57
6 繰延税金資産		137,932	63,421
7 その他		421	22,446
流動資産合計		5,871,846	6,745,230
固定資産			
1 有形固定資産			
(1) 建物	* 1	37,899	31,748
(2) 器具備品	* 1	13,712	12,253
有形固定資産合計		51,612	44,002
2 無形固定資産			
(1) 電話加入権		4,535	4,535
無形固定資産合計		4,535	4,535
3 投資その他の資産			
(1) 投資有価証券		128,043	47,562
(2) 長期差入保証金		161,598	161,598
(3) 繰延税金資産		133,008	161,300
(4) その他		29	30
投資その他の資産合計		422,678	370,490
固定資産合計		478,826	419,028
資産合計		6,350,672	7,164,258

区分	注記 番号	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)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金			3,485		82,284
2 未払金					
(1) 未払配当金	* 2	500,000		500,000	
(2) 未払手数料		333,031		340,633	
(3) その他未払金		107,732	940,764	160,613	1,001,247
3 未払費用			429,958		691,223
4 未払消費税等			71,725		10,617
5 未払法人税等			346,936		143,251
6 前受収益			26,746		7,954
7 賞与引当金			58,159		120,025
8 役員賞与引当金			9,600		9,000
流動負債合計			1,887,376		2,065,604
固定負債					
1 退職給付引当金			75,674		90,737
2 資産除去債務			7,898		8,039
固定負債合計			83,572		98,776
負債合計			1,970,949		2,164,380
(純資産の部)					
株主資本					
1 資本金			1,550,000		1,550,000
2 資本剰余金					
(1) 資本準備金			413,280		413,280
資本剰余金合計			413,280		413,280
3 利益剰余金					
(1) その他利益剰余金					
繰越利益剰余金			2,424,248		3,035,695
利益剰余金合計			2,424,248		3,035,695
株主資本合計			4,387,528		4,998,975
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			7,804		902
評価・換算差額等合計			7,804		902
純資産合計			4,379,723		4,999,878
負債・純資産合計			6,350,672		7,164,258

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	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)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		7,038,975		5,363,843	
2 運用受託報酬		2,535,301	9,574,276	3,816,308	9,180,152
営業費用					
1 支払手数料		3,508,448		2,890,668	
2 広告宣伝費		16,724		15,637	
3 公告費		610		2,970	
4 調査費		2,046,339		2,245,765	
(1) 調査費		622,284		780,172	
(2) 委託調査費		1,420,590		1,461,574	
(3) 図書費		3,465		4,018	
5 営業雑経費		182,596		190,147	
(1) 通信費		17,360		16,450	
(2) 印刷費		151,371		160,333	
(3) 諸会費		13,864	5,754,719	13,363	5,345,189
一般管理費					
1 給料		1,299,501		1,361,632	
(1) 役員報酬		83,689		75,948	
(2) 給料・手当		1,107,914		1,147,148	
(3) 賞与		107,897		138,535	
2 福利厚生費		109,923		134,150	
3 交際費		11,516		9,622	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		38,774		36,626	
6 法人事業税		29,306		41,868	
7 租税公課		7,391		13,856	
8 不動産賃借料		214,575		212,520	
9 退職給付費用		47,701		50,781	
10 賞与引当金繰入		58,159		120,025	

区分	注記 番号	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)	
		金額(千円)		金額(千円)	
11 役員賞与引当金繰入		9,600		9,000	
12 固定資産減価償却費		13,042		10,429	
13 諸経費		205,813	2,045,605	260,939	2,261,753
営業利益			1,773,952		1,573,209
営業外収益					
1 受取配当金		90		90	
2 受取利息		657		280	
3 有価証券売却益		19		-	
4 有価証券償還益		-		745	
5 為替差益		-		9,721	
6 雑益		6,407	7,173	2,066	12,904
営業外費用					
1 有価証券売却損		-		6	
2 為替差損		100		-	
3 雑損		0	100	8	14
経常利益			1,781,026		1,586,098
特別損失					
1 固定資産除却損	* 1	663	663	0	0
税引前当期純利益			1,780,362		1,586,098
法人税、住民税及び事業 税			659,040		428,835
法人税等調整額			52,602		45,816
当期純利益			1,173,924		1,111,446

（ 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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	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	1,550,000	413,280	413,280	1,750,324	1,750,324	3,713,604
当期変動額						
剰余金の配当				500,000	500,000	500,000
当期純利益				1,173,924	1,173,924	1,173,924
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	673,924	673,924	673,924
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	2,424,248	2,424,248	4,387,528

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,462	1,462	3,712,141
当期変動額			
剰余金の配当			500,000
当期純利益			1,173,924
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	6,342	6,342	6,342
当期変動額合計	6,342	6,342	667,582
当期末残高	7,804	7,804	4,379,723

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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	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	1,550,000	413,280	413,280	2,424,248	2,424,248	4,387,528
当期変動額						
剰余金の配当				500,000	500,000	500,000
当期純利益				1,111,446	1,111,446	1,111,446
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	611,446	611,446	611,446
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,035,695	3,035,695	4,998,975

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7,804	7,804	4,379,723
当期変動額			
剰余金の配当			500,000
当期純利益			1,111,446
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	8,707	8,707	8,707
当期変動額合計	8,707	8,707	620,154
当期末残高	902	902	4,999,878

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、売却原価は移動平均法より算定）を採用しております。

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。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法を採用しております。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しています。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	3～20年

3. 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。

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度におけ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要支給額を計上しております。

退職給付債務の計算に当たっては、「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号）に定める簡便法によっております。

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

（会計方針の変更）

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）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得する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。

これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

（追加情報）

「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）を当事業年度から適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

* 1 . 有形固定資産の減価償却累計額は、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)
建物	72,167千円	78,317千円
器具備品	44,838	44,893

* 2 . 関係会社項目

関係会社に対する負債は、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)
未払金		
未払配当金	500,000千円	500,000千円

（損益計算書関係）

* 1 . 固定資産除却損の内容は、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	663千円	0千円

（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．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	24,085株	- 株	- 株	24,085株

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たり 配当額	基準日	効力発生日
平成28年 3月29日 取締役会	普通株式	500,000千円	20,759円	平成27年 3月31日	平成28年 3月31日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	24,085株	- 株	- 株	24,085株

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3．新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4．剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たり 配当額	基準日	効力発生日
平成29年3月28日 取締役会	普通株式	500,000千円	20,759円	平成28年3月31日	平成29年3月31日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。

(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

当社では、主として短期的な預金及び一部の有価証券によって運用しており、経営として許容できる範囲内にリスクを制御するよう、適切に資産運用を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、そのほとんどが信託財産から支払われるため、回収リスクは僅少であります。

投資有価証券は、主に投資信託を保有しており、今後の基準価額の下落によっては、売却損・評価損計上による利益減少や、評価差額金の減少により純資産が減少するなど、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、短期的な預金について、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

価格変動リスクについては、四半期ごとに時価の状況等を把握し、当該状況については資産運用管理規程に従い、経理担当部が取締役会等へ報告し、適切に管理を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

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めておりません（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・預金	4,375,837	4,375,837	-
(2) 未収委託者報酬	754,788	754,788	-
(3) 未収運用受託報酬	521,498	521,498	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	112,293	112,293	-
資産計	5,764,418	5,764,418	-

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・預金	5,032,858	5,032,858	-
(2) 未収委託者報酬	760,025	760,025	-
(3) 未収運用受託報酬	788,836	788,836	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	31,812	31,812	-
資産計	6,613,532	6,613,532	-

注1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

時価については、公表されている基準価額または取引金融機関等から提示された基準価額によっております。

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(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	15,750	15,750

非上場株式は、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、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」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
(1) 預金	4,375,515	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	754,788	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	521,498	-	-	-
(4) 投資有価証券				
その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	96	112,197	-
合計	5,651,803	96	112,197	-

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
(1) 預金	5,032,643	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	760,025	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	788,836	-	-	-
(4) 投資有価証券				
その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	15,266	-	16,545
合計	6,581,505	15,266	-	16,545

注4．社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1．売買目的有価証券

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

4．その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	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	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	-	-	-
	小 計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	112,293	120,098	7,804
	小 計	112,293	120,098	7,804
合計		112,293	120,098	7,804

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	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	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	16,545	15,200	1,345
	小 計	16,545	15,200	1,345
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	15,266	15,306	40
	小 計	15,266	15,306	40
合計		31,812	30,506	1,305

5．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	-	-	-
(3) その他	1,419	22	2
合計	1,419	22	2

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	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	3,993	-	6
合計	3,993	-	6

（デリバティブ取引関係）

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（出向受入者に対する出向元への退職金負担額を除く。）

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	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)	
	退職給付引当金の期首残高	64,308	千円	75,674
退職給付費用	17,374		21,913	
退職給付の支払額	6,008		6,850	
退職給付引当金の期末残高	75,674		90,737	

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

	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)	
	非積立型制度の退職給付債務	75,674	千円	90,737
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674		90,737	
退職給付引当金	75,674		90,737	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	75,674		90,737	

(3) 退職給付費用

	前事業年度		当事業年度	
	(自 至	平成27年4月1日 平成28年3月31日)	(自 至	平成28年4月1日 平成29年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用		17,374 千円		21,913 千円

3. 確定拠出制度

	前事業年度		当事業年度	
	(自 至	平成27年4月1日 平成28年3月31日)	(自 至	平成28年4月1日 平成29年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額		10,921 千円		12,945 千円

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	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		
ソフトウェア損金算入限度超過額	110,523千円	127,409千円
賞与引当金	17,947	37,039
退職給付引当金	23,200	27,800
未払費用否認	88,021	18,239
繰延資産損金算入限度超過額	7,634	7,090
未払事業税	22,641	6,351
その他	6,579	4,335
繰延税金資産小計	276,547	228,266
評価性引当額	4,900	2,554
繰延税金資産合計	271,647	225,712
繰延税金負債		
固定資産除去価額	707	588
その他有価証券評価差額金	-	402
繰延税金負債合計	707	990
繰延税金資産の純額	270,940	224,721

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

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15年と見積り、割引率は1.7%～1.8%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	7,760千円	7,898千円
時の経過による調整額	137	140
期末残高	7,898	8,039

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、投資運用事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

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

(1) 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%を超えているため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、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）

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

(1) 営業収益

(単位：千円)

日本	欧州	アジア	合計
7,945,745	1,208,415	25,991	9,180,152

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益
A社(注)	1,038,124

(注) A社との間で守秘義務契約を負っているため、社名の公表は控えております。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等
記載すべき重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	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	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任（注1）	運用受託報酬の受取り	189,203	未収運用受託報酬	101,258
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等（注2）	投資信託代行手数料の支払い	407,134	未払手数料	86,317

注1．上記金額のうち、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．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注1） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注2） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	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	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用の一任（注1）	運用受託報酬の受取り	157,531	未収運用受託報酬	86,309
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等（注2）	投資信託代行手数料の支払い	400,493	未払手数料	97,637

注1．上記金額のうち、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．取引条件ないし取引条件の決定方針等

（注1） 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（注2） 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等との取引はありません。

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

SOMP Oホールディングス株式会社（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

関連会社はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	181,844.45円	207,593.03円
1株当たり当期純利益金額	48,740.88円	46,146.84円

(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、潜在株式が存在しないため記載して
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)
当期純利益(千円)	1,173,924	1,111,446
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,173,924	1,111,446
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(資産の部)		
流動資産		
1 現金・預金		4,215,136
2 前払費用		91,698
3 未収委託者報酬		881,780
4 未収運用受託報酬		951,939
5 未収収益		63
6 繰延税金資産		52,329
7 その他		2,373
流動資産合計		6,195,319
固定資産		
1 有形固定資産	1	40,489
2 無形固定資産		4,535
3 投資その他の資産		
(1) 投資有価証券		60,681
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		185,920
(4) その他		30
投資その他の資産合計		408,229
固定資産合計		453,254
資産合計		6,648,573

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(負債の部)		
流動負債		
1 預り金		13,359
2 未払金		
(1) 未払手数料		337,424
(2) その他未払金		174,571
未払金合計		511,996
3 未払費用		592,557
4 未払法人税等		121,912
5 前受収益		3,747
6 賞与引当金		80,017
7 役員賞与引当金		1,800
8 その他	2	27,057
流動負債合計		1,352,448
固定負債		
1 退職給付引当金		100,600
2 資産除去債務		8,110
固定負債合計		108,711
負債合計		1,461,159

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
(純資産の部)		
株主資本		
1 資本金		1,550,000
2 資本剰余金		
(1) 資本準備金		413,280
資本剰余金合計		413,280
3 利益剰余金		
(1) その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		3,221,690
利益剰余金合計		3,221,690
株主資本合計		5,184,970
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		2,443
評価・換算差額等合計		2,443
純資産合計		5,187,414
負債・純資産合計		6,648,573

(2) 中間損益計算書

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業収益			
1 委託者報酬		2,469,535	
2 運用受託報酬		1,462,281	3,931,816
営業費用			
1 支払手数料		1,187,891	
2 広告宣伝費		8,934	
3 公告費		1,770	
4 調査費		1,175,544	
(1) 調査費		442,104	
(2) 委託調査費		731,058	
(3) 図書費		2,381	
5 営業雑経費		99,171	
(1) 通信費		2,991	
(2) 印刷費		83,337	
(3) 諸会費		12,842	2,473,312
一般管理費			
1 給料		696,733	
(1) 役員報酬		40,340	
(2) 給料・手当		601,168	
(3) 賞与		55,224	
2 福利厚生費		82,614	
3 交際費		3,239	
4 旅費交通費		20,153	
5 法人事業税		18,186	
6 租税公課		3,619	
7 不動産賃借料		103,565	
8 退職給付費用		21,725	
9 賞与引当金繰入		80,017	
10 役員賞与引当金繰入		1,800	
11 固定資産減価償却費	1	3,512	
12 諸経費		149,357	1,184,525
営業利益			273,978

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業外収益			
1 受取配当金		91	
2 受取利息		164	
3 有価証券売却益		15	
4 為替差益		3,183	
5 雑益		1,146	4,601
営業外費用			
1 雑損		71	71
経常利益			278,509
税引前中間純利益			278,509
法人税、住民税及び事業税			106,718
法人税等調整額			14,204
中間純利益			185,995

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	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	1,550,000	413,280	413,280	3,035,695	3,035,695	4,998,975
当中間期変動額						
中間純利益				185,995	185,995	185,995
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	185,995	185,995	185,995
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,221,690	3,221,690	5,184,970

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	902	902	4,999,878
当中間期変動額			
中間純利益			185,995
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）	1,540	1,540	1,540
当中間期変動額合計	1,540	1,540	187,536
当中間期末残高	2,443	2,443	5,187,414

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

中間会計期間末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、売却原価は移動均法より算定）を採用しております。

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。

2．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	3～20年

3．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、中間会計期間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。

4．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間負担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、当中間会計期間末における要支給額を計上しております。

退職給付債務の計算に当たっては、「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号）に定める簡便法によっております。

5．消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

（減価償却方法の変更）

当社は、有形固定資産の減価償却方法について、従来、定率法（ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法に変更しております。

これは、当社の属するSOMP Oホールディングスグループの有形固定資産の減価償却方法に関する会計方針が変更されることを契機として、当社における有形固定資産の使用実態を改めて検討した結果、耐用年数にわたり安定的に使用されると見込まれ、耐用年数にわたって均等に費用配分することが実態をより適正に表すものと判断したことによるものであります。

この変更による当中間会計期間の経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
1	有形固定資産の減価償却累計額	126,348千円
2	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「その他」に含めて表示して おります。

（中間損益計算書関係）

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1	減価償却実施額 有形固定資産	3,512千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	当事業年度期首 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）
発行済株式				
普通株式	24,085	-	-	24,085
合計	24,085	-	-	24,085
自己株式				
普通株式	-	-	-	-
合計	-	-	-	-

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間の末日後となるもの

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、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めておりません（注2.参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,215,136	4,215,136	-
(2) 未収委託者報酬	881,780	881,780	-
(3) 未収運用受託報酬	951,939	951,939	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	44,931	44,931	-
資産計	6,093,786	6,093,786	-

注1. 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

時価については、公表されている基準価額または取引金融機関等から提示された基準価額によっております。

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額
非上場株式	15,750

非上場株式は、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、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

3．その他有価証券

（単位：千円）

	種 類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差 額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	43,657	40,100	3,557
	小 計	43,657	40,100	3,557
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	1,273	1,308	35
	小 計	1,273	1,306	35
合計		44,931	41,408	3,522

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（ストック・オプション等関係）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

第33期中間会計期間（平成29年9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	8,039千円
時の経過による調整額	71千円
中間期末残高	8,110千円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30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中間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

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えているため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で中間損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（ 1株当たり情報）

	第33期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
1株当たり純資産額	215,379.46円
1株当たり中間純利益金額	7,722.45円
	なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	185,995千円
普通株主に帰属しない金額	-千円
普通株式に係る中間純利益	185,995千円
普通株式の期中平均株式数	24,085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】

以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社）

資本金の額

247,369百万円（平成29年9月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（平成29年9月末現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
いちよし証券株式会社	14,577	「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。

資本金の額は、平成29年9月末現在

(3) 投資顧問会社

名称

ユニオン バンケール プリヴェ ユービーピー エスエー

資本金の額

3億スイスフラン（平成28年12月末現在）

34,263百万円（1スイスフラン = 114.21円換算）

事業の内容

ジュネーブに本店を置く欧州大手金融機関。投資運用業務を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月19日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 小澤裕治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコースの平成29年4月21日から平成29年10月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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な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、グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジありコースの平成29年10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中間計算期間（平成29年4月21日から平成29年10月20日まで）の損益の状況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

損保ジャパン日本興亜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、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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月19日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 小澤裕治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコースの平成29年4月21日から平成29年10月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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な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、グローバル変動金利債券ファンド 円ヘッジなしコースの平成29年10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中間計算期間（平成29年4月21日から平成29年10月20日まで）の損益の状況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

損保ジャパン日本興亜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、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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年6月1日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 小澤裕治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保 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」に掲げられている損保ジャパン日本興亜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32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、損保ジャパン日本興亜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. XBR L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29年11月22日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 裕治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保 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」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9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、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の平成29年9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29年4月1日から平成29年9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、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。