

## 【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】	2019年1月18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（毎月分配型）円ヘッジありコース 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
【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】	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 募集額 各コースの合計で、5,000億円を上限とします。 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 募集額 各コースの合計で、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】

2018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、有価証券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】

<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>の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

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23拠点を展開
- ・ 運用資産額:1,253億スイスフラン(約14兆4,671億円)
- ・ 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23拠点を展開
- ・ 運用資産額:1,284億スイスフラン(約14兆2,369億円)
- ・ 世界の個人投資家・機関投資家に様々な運用戦略を提供

(2018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30年5月末現在)

(略)

( ) 大株主の状況 (平成30年5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 (2018年10月末現在)

(略)

( ) 大株主の状況 (2018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30年5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30年5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)

2018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2018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。

## 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30年5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

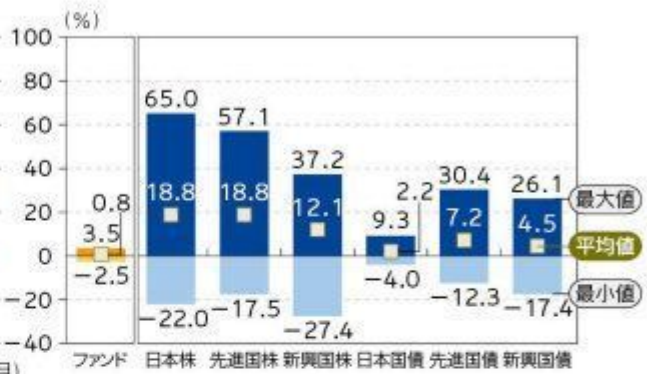
※データは、設定日より掲載しています。

#### 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



2013年6月～2018年5月

ファンド : 2015年7月～2018年5月

代表的な資産クラス: 2013年6月～2018年5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	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	J PモルガンGBI-EM グローバル・ディバースファイド (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、2018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

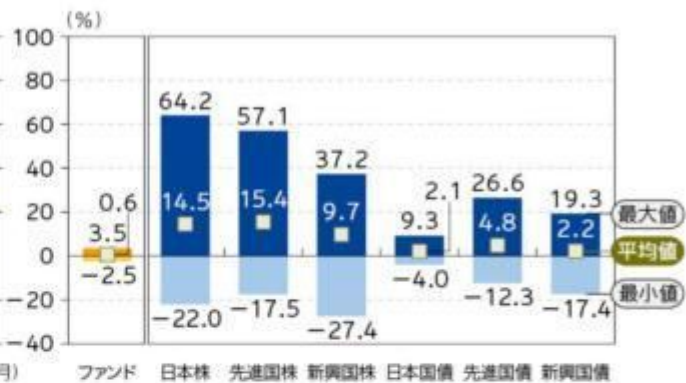
※データは、設定日より掲載しています。

#### 円ヘッジありコース

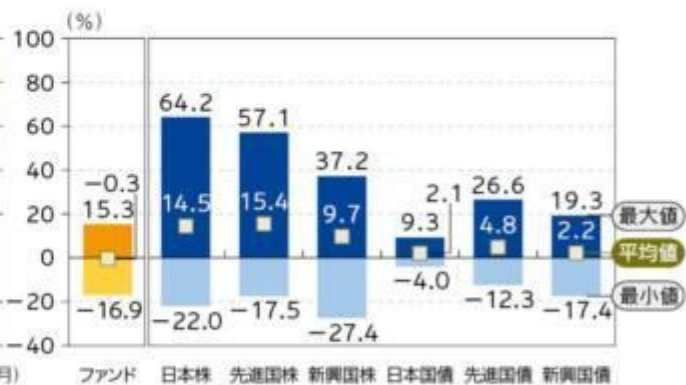
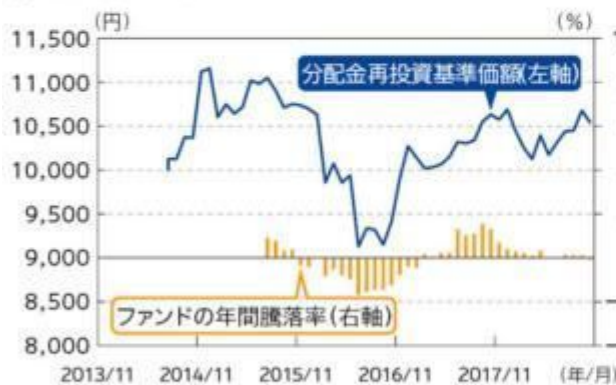


### ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

※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



2013年11月～2018年10月

ファンド : 2015年7月～2018年10月  
代表的な資産クラス: 2013年11月～2018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。

##### 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、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。

##### 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

##### 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。

##### 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。

##### 新興国債:JPMオルガンB I - 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、毎日計上され、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、ファンドの基準価額に反映されます。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)

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

・少額投資非課税制度「愛称：NISA（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。

上記は平成30年5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)

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。

・少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（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および譲渡所得が一定期間非課税となります。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。

上記は2018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】



## （１）【投資状況】

## 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

2018年10月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	33,232,005	97.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		879,524	2.58
純資産総額		34,111,529	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。

## その他資産の投資状況

2018年10月31日現在

資産の種類	建別	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		31,813,133	93.26

（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。

## 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

2018年10月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	30,222,247	97.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		669,438	2.17
純資産総額		30,891,685	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。

## （参考）グローバル変動金利債券マザーファンド

2018年10月31日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	韓国	283,710,297	2.32
社債券	アメリカ	3,346,979,004	27.41
	フランス	1,170,327,003	9.58
	イギリス	1,053,140,189	8.63
	オランダ	910,187,985	7.45

日本	828,780,037	6.79
スウェーデン	815,374,036	6.68
カナダ	668,748,570	5.48
オーストラリア	621,323,771	5.09
スイス	528,219,081	4.33
スペイン	401,396,167	3.29
イタリア	194,059,144	1.59
ノルウェー	193,286,572	1.58
中国	132,094,603	1.08
ドイツ	122,064,019	1.00
ベルギー	102,515,908	0.84
メキシコ	94,362,795	0.77
英ヴァージン諸島	90,694,984	0.74
インド	56,729,103	0.46
デンマーク	54,897,688	0.45
ガーンジー	52,941,971	0.43
	11,438,122,630	93.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	488,158,251	4.00
純資産総額	12,209,991,178	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。

## （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（毎月分配型）円ヘッジありコース

2018年10月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	親投資信託 受益証券	グローバル変動金利債券マザー ファンド	30,816,029	1.0759	33,154,965	1.0784	33,232,005	97.42

（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

2018年10月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.42
合計	97.42

（注1）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（毎月分配型）円ヘッジなしコース

2018年10月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	親投資信託 受益証券	グローバル変動金利債券マザー ファンド	28,025,081	1.0759	30,152,184	1.0784	30,222,247	97.83

（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

2018年10月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.83
合計	97.83

（注1）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）グローバル変動金利債券マザーファンド

2018年10月31日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	利率（%）	償還日	投資 比率 （%）
1	オランダ	社債券	ABN AMRO 5.75 200922	1,500,000	13,931.91	208,978,728	13,415.54	201,233,115	5.7500000	2020/9/22	1.65
2	スイス	社債券	UBS GROUP 5.75 220219	1,300,000	14,409.43	187,322,603	13,926.94	181,050,338	5.7500000	2022/2/19	1.48
3	オランダ	社債券	RABOBANK FRN 210629	1,200,000	14,657.97	175,895,673	14,054.99	168,659,927	6.6250000	2021/6/29	1.38
4	フランス	社債券	BNP PARIBAS 7.625 210330	1,400,000	12,125.93	169,763,149	11,726.48	164,170,823	7.6250000	2021/3/30	1.34
5	アメリカ	社債券	CITIGROUP FRN 230901	1,400,000	11,613.79	162,593,111	11,540.96	161,573,544	3.7507500	2022/9/1	1.32
6	オランダ	社債券	ING GROEP 6.875 220416	1,400,000	11,809.58	165,334,230	11,401.54	159,621,622	6.8750000	2022/4/16	1.31
7	フランス	社債券	BPCE FRN 220309	1,200,000	13,134.40	157,612,891	12,993.26	155,919,156	0.7310000	2022/3/9	1.28
8	アメリカ	社債券	BAC FRN 190506	1,200,000	12,981.19	155,774,287	12,908.75	154,905,073	1.1410000	2019/5/6	1.27
9	フランス	社債券	SGSA 6.75 210407	1,100,000	14,230.06	156,530,741	13,513.53	148,648,863	6.7500000	2021/4/7	1.22
10	アメリカ	社債券	JPM CHASE FRN 220425	1,300,000	11,414.79	148,392,346	11,387.61	148,038,975	3.3898800	2022/4/25	1.21
11	スウェー デン	社債券	SKANDINAV 5.75 200513	1,300,000	11,530.20	149,892,701	11,251.36	146,267,701	5.7500000	2020/5/13	1.20

12	スウェーデン	社債券	SVENSKA 5.25 210301	1,300,000	11,410.37	148,334,923	11,058.59	143,761,711	5.2500000	2021/3/1	1.18
13	スイス	社債券	CS 7.5 231211	1,200,000	12,093.80	145,125,701	11,744.26	140,931,231	7.5000000	2023/12/11	1.15
14	イタリア	社債券	INTESA SANP FRN 200615	1,100,000	13,048.10	143,529,130	12,773.77	140,511,539	0.7310000	2020/6/15	1.15
15	フランス	社債券	CD AGRICOLE FRN 251223	1,100,000	12,717.60	139,893,655	12,118.82	133,307,020	8.1250000	2025/12/23	1.09
16	イギリス	社債券	RBS FRN 220515	1,100,000	11,430.06	125,730,695	11,388.74	125,276,206	3.7837500	2022/5/15	1.03
17	アメリカ	社債券	BAC FRN 230723	1,100,000	11,366.10	125,027,148	11,300.85	124,309,419	3.4371900	2023/7/23	1.02
18	アメリカ	社債券	GS FRN 210909	950,000	12,870.83	122,272,937	12,849.29	122,068,284	0.3110000	2021/9/9	1.00
19	イギリス	社債券	BARCLAYS 7.625 221121	1,000,000	12,337.52	123,375,251	12,077.48	120,774,801	7.6250000	2022/11/21	0.99
20	カナダ	社債券	NATL BK CAD FRN 200512	1,035,000	11,371.41	117,694,168	11,356.24	117,537,088	2.8942500	2020/5/12	0.96
21	日本	社債券	SMBC FRN 220614	900,000	12,850.87	115,657,894	12,827.71	115,449,452	0.1310000	2022/6/14	0.95
22	アメリカ	社債券	BONY Mellon FRN 221030	1,000,000	11,531.34	115,313,404	11,463.04	114,630,446	3.5703800	2022/10/30	0.94
23	オーストラリア	社債券	CBA FRN 210906	1,000,000	11,453.87	114,538,706	11,439.26	114,392,600	3.1527500	2021/9/6	0.94
24	アメリカ	社債券	STANLN FRN 230120	1,000,000	11,364.90	113,649,048	11,328.03	113,280,387	3.5575000	2023/1/20	0.93
25	アメリカ	社債券	CMCSA FRN 240415	1,000,000	11,342.53	113,425,360	11,251.58	112,515,882	3.0382500	2024/4/15	0.92
26	アメリカ	社債券	GS FRN 231129	900,000	11,741.21	105,670,900	11,706.66	105,360,001	3.9172500	2023/11/29	0.86
27	アメリカ	社債券	MORGAN STAN FRN 221024	900,000	11,605.07	104,445,654	11,541.19	103,870,746	3.8873800	2022/10/24	0.85
28	ノルウェー	社債券	DNB BANK FRN 210602	900,000	11,534.17	103,807,547	11,496.11	103,465,049	3.3907500	2021/6/2	0.85
29	アメリカ	社債券	WELLS FARGO FRN 221031	900,000	11,491.69	103,425,296	11,477.54	103,297,878	3.5723800	2022/10/31	0.85
30	フランス	社債券	SGSA FRN 220401	800,000	13,037.82	104,302,627	12,879.08	103,032,711	0.5320000	2022/4/1	0.84

(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。

(注3) 償還年月日が「9999/99/99」の銘柄は償還日の定めのない銘柄です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2018年10月31日現在

種類	投資比率(%)
特殊債券	2.32
社債券	93.68
合計	96.00

(注1) 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】

#### 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

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（毎月分配型）円ヘッジなしコース

該当事項はありません。

（参考）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。

## 【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（毎月分配型）円ヘッジありコース

2018年10月31日現在

種類	通貨	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	ドル	売建	202,000.00	22,656,320	22,830,040	66.93
	ユーロ	売建	69,940.00	9,046,739	8,983,093	26.33

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当銘柄の時価の比率です。

（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（毎月分配型）円ヘッジなしコース

該当事項はありません。

（参考）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（毎月分配型）円ヘッジありコース

直近日（2018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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末	(2014年10月20日)	99,192	99,292	0.9919	0.9929
第2特定期間末	(2015年4月20日)	7,902,354	7,910,296	0.9950	0.9960
第3特定期間末	(2015年10月20日)	42,280,044	42,323,053	0.9830	0.9840
第4特定期間末	(2016年4月20日)	41,709,939	41,753,095	0.9665	0.9675
第5特定期間末	(2016年10月20日)	54,535,897	54,592,044	0.9713	0.9723
第6特定期間末	(2017年4月20日)	37,746,638	37,785,380	0.9743	0.9753

第7特定期間末	(2017年10月20日)	34,610,812	34,645,909	0.9861	0.9871
第8特定期間末	(2018年 4月20日)	34,489,293	34,524,585	0.9772	0.9782
第9特定期間末	(2018年10月22日)	34,131,841	34,167,249	0.9639	0.9649
	2017年10月末日	34,594,855		0.9882	
	11月末日	34,541,104		0.9856	
	12月末日	34,557,477		0.9856	
	2018年 1月末日	34,567,105		0.9854	
	2月末日	34,647,974		0.9816	
	3月末日	34,419,925		0.9753	
	4月末日	34,526,150		0.9778	
	5月末日	34,231,117		0.9690	
	6月末日	34,179,792		0.9670	
	7月末日	34,298,460		0.9698	
	8月末日	34,284,092		0.9688	
	9月末日	34,310,851		0.9690	
	10月末日	34,111,529		0.9628	

#### 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

直近日（2018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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末	(2014年10月20日)	101,532	101,682	1.0153	1.0168
第2特定期間末	(2015年 4月20日)	17,250,919	17,275,778	1.0409	1.0424
第3特定期間末	(2015年10月20日)	56,546,610	56,627,092	1.0539	1.0554
第4特定期間末	(2016年 4月20日)	54,675,085	54,761,335	0.9509	0.9524
第5特定期間末	(2016年10月20日)	43,523,891	43,572,658	0.8925	0.8935
第6特定期間末	(2017年 4月20日)	45,409,652	45,458,174	0.9359	0.9369
第7特定期間末	(2017年10月20日)	45,449,281	45,494,383	1.0077	1.0087
第8特定期間末	(2018年 4月20日)	30,748,768	30,780,458	0.9703	0.9713
第9特定期間末	(2018年10月22日)	30,822,642	30,853,877	0.9868	0.9878
	2017年10月末日	39,698,538		1.0095	
	11月末日	39,455,890		1.0030	
	12月末日	36,985,047		1.0129	
	2018年 1月末日	31,310,402		0.9884	
	2月末日	30,711,976		0.9693	
	3月末日	30,312,660		0.9565	
	4月末日	31,092,813		0.9809	
	5月末日	29,933,460		0.9590	
	6月末日	30,321,000		0.9713	
	7月末日	30,666,881		0.9822	
	8月末日	30,668,872		0.9820	

9月末日	31,311,866		1.0024
10月末日	30,891,685		0.9888

## 【分配の推移】

## 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

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0040
第2特定期間	0.0060
第3特定期間	0.0060
第4特定期間	0.0060
第5特定期間	0.0060
第6特定期間	0.0060
第7特定期間	0.0060
第8特定期間	0.0060
第9特定期間	0.0060

## 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

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0045
第2特定期間	0.0090
第3特定期間	0.0090
第4特定期間	0.0090
第5特定期間	0.0085
第6特定期間	0.0060
第7特定期間	0.0060
第8特定期間	0.0060
第9特定期間	0.0060

## 【収益率の推移】

## 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

	収益率（％）
第1特定期間	0.4
第2特定期間	0.9
第3特定期間	0.6
第4特定期間	1.1
第5特定期間	1.1

第6特定期間	0.9
第7特定期間	1.8
第8特定期間	0.3
第9特定期間	0.7

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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（毎月分配型）円ヘッジなしコース

	収益率（％）
第1特定期間	2.0
第2特定期間	3.4
第3特定期間	2.1
第4特定期間	8.9
第5特定期間	5.2
第6特定期間	5.5
第7特定期間	8.3
第8特定期間	3.1
第9特定期間	2.3

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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（毎月分配型）円ヘッジありコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	100,000	
第2特定期間	7,942,253	100,000
第3特定期間	35,067,415	
第4特定期間	146,677	
第5特定期間	20,881,360	7,890,030
第6特定期間	3,345,522	20,751,193
第7特定期間	293,344	3,937,810
第8特定期間	319,559	124,232
第9特定期間	115,889	

（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（毎月分配型）円ヘッジなしコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	100,000	
第2特定期間	17,463,634	990,954
第3特定期間	48,528,066	11,445,593
第4特定期間	6,599,517	2,754,062
第5特定期間	597,896	9,331,173
第6特定期間	116,411	361,708
第7特定期間	416,796	3,836,689
第8特定期間	61,701	13,473,449
第9特定期間	35,464	490,299

（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:2018年10月31日

## ● 基準価額・純資産の推移 2014/07/18～2018/10/31

### ● 円ヘッジありコース



### ● 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ものとして計算しています。

● 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

2018年06月	10円
2018年07月	10円
2018年08月	10円
2018年09月	10円
2018年10月	10円
直近1年間累計	120円
設定来累計	520円

### ● 円ヘッジなしコース

2018年06月	10円
2018年07月	10円
2018年08月	10円
2018年09月	10円
2018年10月	10円
直近1年間累計	120円
設定来累計	640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	97.42%
コール・ローン等	2.58%
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	97.83%
コール・ローン等	2.17%
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	96.00%
コール・ローン等	4.00%
合計	100.00%

通貨別構成	
通貨	純資産比
アメリカ・ドル	69.6%
ユーロ	26.4%
コール・ローン等	4.0%
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。

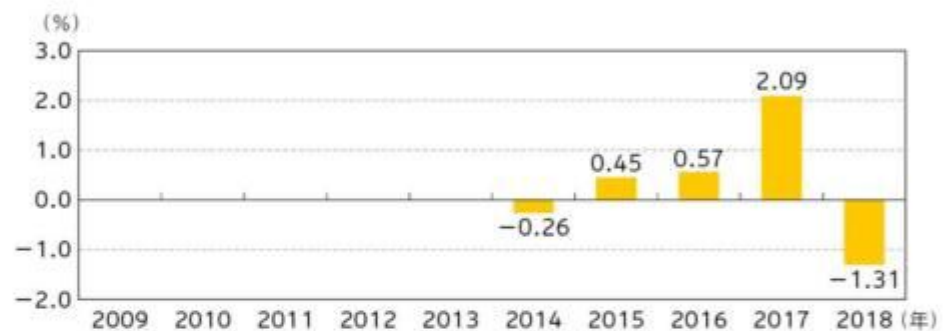
## 組入上位10銘柄

	銘柄名	発行国	業種	通貨	償還日	純資産比
1	ABN AMRO 5.75 200922	オランダ	銀行	ユーロ	2020/09/22	1.7%
2	UBS GROUP 5.75 220219	スイス	銀行	ユーロ	2022/02/19	1.5%
3	RABOBANK FRN 210629	オランダ	銀行	ユーロ	2021/06/29	1.4%
4	BNP PARIBAS 7.625 210330	アメリカ	銀行	アメリカ・ドル	2021/03/30	1.3%
5	CITIGROUP FRN 220901	アメリカ	銀行	アメリカ・ドル	2022/09/01	1.3%
6	ING GROEP 6.875 220416	アメリカ	銀行	アメリカ・ドル	2022/04/16	1.3%
7	BPCE FRN 220309	フランス	銀行	ユーロ	2022/03/09	1.3%
8	BAC FRN 190506	アメリカ	銀行	ユーロ	2019/05/06	1.3%
9	SGSA 6.75 210407	フランス	銀行	ユーロ	2021/04/07	1.2%
10	JPM CHASE FRN 220425	アメリカ	銀行	アメリカ・ドル	2022/04/25	1.2%
組入銘柄数					152銘柄	

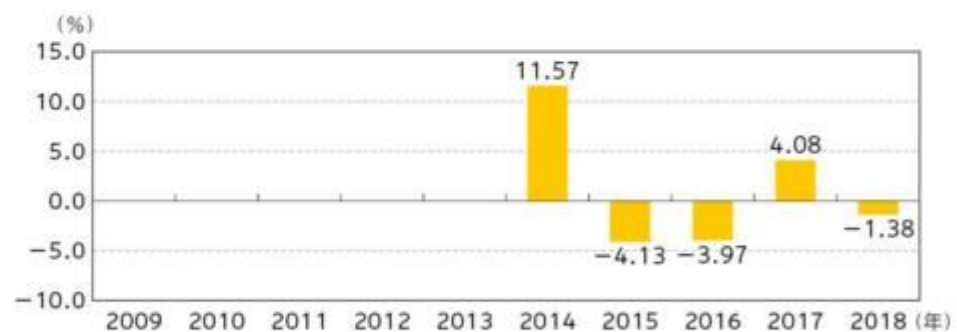
● 償還日は、コール償還日がある場合はコール償還日を記載しております。

## 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（7月18日）から年末、2018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）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第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ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごと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、2018年4月21日から2018年10月22日までの財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

##### 【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】

#### （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	916,716	1,402,598
親投資信託受益証券	33,890,818	33,154,965
流動資産合計	34,807,534	34,557,563
資産合計	34,807,534	34,557,563
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	257,201	363,919
未払収益分配金	35,292	35,408
未払受託者報酬	1,254	1,292
未払委託者報酬	24,331	24,959
その他未払費用	163	144
流動負債合計	318,241	425,722
負債合計	318,241	425,722
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	35,292,865	35,408,754
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	803,572	1,276,913
元本等合計	34,489,293	34,131,841
純資産合計	34,489,293	34,131,841
負債純資産合計	34,807,534	34,557,563

#### （2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	当 期 自 2018年4月21日 至 2018年10月22日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	926,453	964,147
為替差損益	976,074	1,068,761
営業収益合計	49,621	104,614
<b>営業費用</b>		
支払利息	290	300

	前 期 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	当 期 自 2018年4月21日 至 2018年10月22日
受託者報酬	7,416	7,455
委託者報酬	143,191	144,594
その他費用	827	850
営業費用合計	151,724	153,199
営業利益又は営業損失( )	102,103	257,813
経常利益又は経常損失( )	102,103	257,813
当期純利益又は当期純損失( )	102,103	257,813
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( )	122	-
期首剰余金又は期首欠損金( )	486,726	803,572
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,811	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,811	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,652	3,386
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,652	3,386
分配金	210,780	212,142
期末剰余金又は期末欠損金( )	803,572	1,276,913

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月20日及び10月20日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を2018年10月22日としております。

( 貸借対照表に関する注記 )

期別	前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22日現在
1. 受益権の総数	35,292,865口	35,408,754口
2. 元本の欠損	803,572円	1,276,913円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9772円 (9,772円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9639円 (9,639円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	前 期 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	当 期 自 2018年4月21日 至 2018年10月22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	26,924円	親投資信託受益証券の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の16の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。
2. 分配金の計算過程	<p>（自2017年10月21日 至2017年11月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（57,942円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（330,768円）及び分配準備積立金（349,315円）より分配対象収益は738,025円（1万口当たり210.68円）であり、うち35,029円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2017年11月21日 至2017年12月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（57,270円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（331,101円）及び分配準備積立金（372,228円）より分配対象収益は760,599円（1万口当たり217.03円）であり、うち35,045円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2017年12月21日 至2018年1月22日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（64,184円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（331,443円）及び分配準備積立金（394,453円）より分配対象収益は790,080円（1万口当たり225.34円）であり、うち35,061円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年1月23日 至2018年2月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（48,849円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（331,797円）及び分配準備積立金（423,576円）より分配対象収益は804,222円（1万口当たり229.27円）であり、うち35,077円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2018年4月21日 至2018年5月21日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（66,527円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（337,300円）及び分配準備積立金（477,014円）より分配対象収益は880,841円（1万口当たり249.46円）であり、うち35,309円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年5月22日 至2018年6月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（60,425円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（337,707円）及び分配準備積立金（508,232円）より分配対象収益は906,364円（1万口当たり256.57円）であり、うち35,325円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年6月21日 至2018年7月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（63,888円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（338,233円）及び分配準備積立金（533,332円）より分配対象収益は935,453円（1万口当たり264.65円）であり、うち35,346円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年7月21日 至2018年8月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（64,048円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（338,779円）及び分配準備積立金（561,874円）より分配対象収益は964,701円（1万口当たり272.77円）であり、うち35,367円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>

<p>（自2018年2月21日 至2018年3月20日）          計算期間末における経費控除後の配当等収益（50,391円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（336,533円）及び分配準備積立金（437,095円）より分配対象収益は824,019円（1万口当たり233.59円）であり、うち35,276円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年3月21日 至2018年4月20日）          計算期間末における経費控除後の配当等収益（60,096円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（336,912円）及び分配準備積立金（452,210円）より分配対象収益は849,218円（1万口当たり240.62円）であり、うち35,292円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2018年8月21日 至2018年9月20日）          計算期間末における経費控除後の配当等収益（67,117円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（339,344円）及び分配準備積立金（590,555円）より分配対象収益は997,016円（1万口当たり281.74円）であり、うち35,387円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年9月21日 至2018年10月22日）          計算期間末における経費控除後の配当等収益（67,396円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（339,922円）及び分配準備積立金（622,285円）より分配対象収益は1,029,603円（1万口当たり290.76円）であり、うち35,408円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
---	--

## （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 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	当 期 自 2018年4月21日 至 2018年10月22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、信託約款に基づき金融商品を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	<p>（1）金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、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（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左

3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク  金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク  各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク  必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	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	<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。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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>	同左



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
------------	--	----

（関連当事者との取引に関する注記）

前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	前 期 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	当 期 自 2018年4月21日 至 2018年10月22日
期首元本額	35,097,538円	35,292,865円
期中追加設定元本額	319,559円	115,889円
期中一部解約元本額	124,232円	- 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 2018年4月20日現在 最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当 期 2018年10月22日現在 最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
	親投資信託受益証券	502,206
合計	502,206	160,244

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	前 期 2018年4月20日 現在				当 期 2018年10月22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								
売建	30,597,791	-	30,854,992	257,201	31,339,140	-	31,703,059	363,919
ドル	21,577,604	-	21,776,944	199,340	22,301,325	-	22,656,320	354,995
ユーロ	9,020,187	-	9,078,048	57,861	9,037,815	-	9,046,739	8,924
合計	30,597,791	-	30,854,992	257,201	31,339,140	-	31,703,059	363,919

## (注) 時価の算定方法

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。

特定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）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）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います。

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。

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。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2018年10月22日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	グローバル変動金利債券マザーファンド	30,816,029	33,154,965	
合計		30,816,029	33,154,965	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引等に関する注記）において表示した表は、「投資信託財産計算規則」附属明細表別紙様式第1号第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、省略いたします。

### 【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】

#### （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	891,515	725,645
親投資信託受益証券	29,911,664	30,152,184
流動資産合計	30,803,179	30,877,829
資産合計	30,803,179	30,877,829
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	31,690	31,235
未払受託者報酬	1,111	1,175
未払委託者報酬	21,486	22,665
その他未払費用	124	112
流動負債合計	54,411	55,187
負債合計	54,411	55,187
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	31,690,393	31,235,558
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	941,625	412,916
元本等合計	30,748,768	30,822,642
純資産合計	30,748,768	30,822,642
負債純資産合計	30,803,179	30,877,829

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	当 期 自 2018年4月21日 至 2018年10月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	790,115	840,520
営業収益合計	790,115	840,520
営業費用		
支払利息	488	280
受託者報酬	7,483	6,702
委託者報酬	144,774	129,563
その他費用	758	673
営業費用合計	153,503	137,218
営業利益又は営業損失( )	943,618	703,302
経常利益又は経常損失( )	943,618	703,302
当期純利益又は当期純損失( )	943,618	703,302
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( )	81,193	7,310
期首剰余金又は期首欠損金( )	347,140	941,625
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	6,615
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	6,615
剰余金減少額又は欠損金増加額	56,560	704
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	56,361	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	199	704
分配金	207,394	187,814
期末剰余金又は期末欠損金( )	941,625	412,916

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月20日及び10月20日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を2018年10月22日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22日現在
1. 受益権の総数	31,690,393口	31,235,558口
2. 元本の欠損	941,625円	412,916円
3. 1口当たり純資産額	0.9703円	0.9868円

計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(9,703円)	(1万口当たり純資産額)	(9,868円)
-------------------------	--------------	----------	--------------	----------

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	前 期		当 期	
	自 2017年10月21日	至 2018年4月20日	自 2018年4月21日	至 2018年10月22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	26,906円		親投資信託受益証券の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の16の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	
2. 分配金の計算過程	<p>(自2017年10月21日 至2017年11月20日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(62,995円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,673,081円)及び分配準備積立金(755,241円)より分配対象収益は5,491,317円(1万口当たり1,396.35円)であり、うち39,326円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自2017年11月21日 至2017年12月20日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(78,094円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,337,925円)及び分配準備積立金(722,750円)より分配対象収益は5,138,769円(1万口当たり1,407.75円)であり、うち36,503円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自2017年12月21日 至2018年1月22日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(62,687円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,339,444円)及び分配準備積立金(764,341円)より分配対象収益は5,166,472円(1万口当たり1,414.92円)であり、うち36,514円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>		<p>(自2018年4月21日 至2018年5月21日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(78,137円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,767,476円)及び分配準備積立金(751,922円)より分配対象収益は4,597,535円(1万口当たり1,450.48円)であり、うち31,696円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自2018年5月22日 至2018年6月20日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(53,259円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,710,095円)及び分配準備積立金(786,016円)より分配対象収益は4,549,370円(1万口当たり1,457.54円)であり、うち31,212円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自2018年6月21日 至2018年7月20日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(75,915円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,710,940円)及び分配準備積立金(808,063円)より分配対象収益は4,594,918円(1万口当たり1,471.86円)であり、うち31,218円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	

<p>（自2018年1月23日 至2018年2月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（44,378円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,764,783円）及び分配準備積立金（685,672円）より分配対象収益は4,494,833円（1万口当たり1,418.93円）であり、うち31,677円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年2月21日 至2018年3月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（45,018円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,765,672円）及び分配準備積立金（698,373円）より分配対象収益は4,509,063円（1万口当たり1,423.13円）であり、うち31,684円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年3月21日 至2018年4月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（71,905円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,766,576円）及び分配準備積立金（711,707円）より分配対象収益は4,550,188円（1万口当たり1,435.83円）であり、うち31,690円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2018年7月21日 至2018年8月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（56,305円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,711,775円）及び分配準備積立金（852,760円）より分配対象収益は4,620,840円（1万口当たり1,479.90円）であり、うち31,224円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年8月21日 至2018年9月20日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（79,358円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,712,634円）及び分配準備積立金（877,841円）より分配対象収益は4,669,833円（1万口当たり1,495.31円）であり、うち31,229円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年9月21日 至2018年10月22日）            計算期間末における経費控除後の配当等収益（61,363円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,713,481円）及び分配準備積立金（925,970円）より分配対象収益は4,700,814円（1万口当たり1,504.94円）であり、うち31,235円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
--	---

## （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 自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	当 期 自 2018年4月21日 至 2018年10月22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、信託約款に基づき金融商品を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	<p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、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（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	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。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22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	<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 該当事項はありません。</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

## （関連当事者との取引に関する注記）

前 期 2018年4月20日現在	当 期 2018年10月22日現在
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

項目	前 期	当 期
	自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	自 2018年4月21日 至 2018年10月22日
期首元本額	45,102,141円	31,690,393円
期中追加設定元本額	61,701円	35,464円
期中一部解約元本額	13,473,449円	490,299円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	前 期	当 期
	2018年4月20日現在	2018年10月22日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	443,241	145,731
合計	443,241	145,731



## （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。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## （１）株式

該当事項はありません。

## （２）株式以外の有価証券

2018年10月22日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	グローバル変動金利債券マザーファンド	28,025,081	30,152,184	
合計		28,025,081	30,152,184	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません

## （参考）

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／円ヘッジなしコースの主要投資対象の状況は以下のとおりです。

\* 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

### 貸借対照表

科 目	2018年4月20日現在	2018年10月22日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	52,769,773	375,128,836
金銭信託	229,559,485	187,023,463
特殊債券	225,395,878	281,768,551
社債券	10,747,275,155	11,486,297,975
未収入金	-	45,063,134
未収利息	46,367,342	65,168,533
前払費用	2,050,759	4,311,103
流動資産合計	11,303,418,392	12,444,761,595
資産合計	11,303,418,392	12,444,761,595
負債の部		
流動負債		
未払金	43,169,557	112,805,872
その他未払費用	13,793	2,212
流動負債合計	43,183,350	112,808,084
負債合計	43,183,350	112,808,084
純資産の部		
元本等		
元本	10,764,752,765	11,461,755,980
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	495,482,277	870,197,531
元本等合計	11,260,235,042	12,331,953,511
純資産合計	11,260,235,042	12,331,953,511
負債純資産合計	11,303,418,392	12,444,761,595

### 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．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>
3．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> <p>外貨建取引等の処理基準</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)

期別	2018年4月20日現在		2018年10月22日現在	
1. 受益権の総数	10,764,752,765口		11,461,755,980口	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0460円 (10,460円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0759円 (10,759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	自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	自 2018年4月21日 至 2018年10月22日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。</p>	
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>同左</p> <p>同左</p> <p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、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(有価証券に関する注記)に記載しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。 為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク  金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク  各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク  必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	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	<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。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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2018年4月20日現在	2018年10月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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ぬ。</p>	同左

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 該当事項はありません。</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
------------	--	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

2018年4月20日現在	2018年10月22日現在
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

項目	自 2017年10月21日 至 2018年4月20日	自 2018年4月21日 至 2018年10月22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	8,941,560,604円	10,764,752,765円
同期中追加設定元本額	1,900,999,337円	1,544,963,261円
同期中一部解約元本額	77,807,176円	847,960,046円
元本の内訳*		
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）	2,160,915,488円	2,865,469,876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）	1,873,323,131円	2,712,829,510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	5,982,514,308円	5,178,082,295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	687,003,200円	645,630,695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	32,400,400円	30,816,029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	28,596,238円	28,025,081円
グローバル変動金利債券ファンド（為替ヘッジあり）<ラップ>	- 円	902,494円
計	10,764,752,765円	11,461,755,980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）

## 売買目的有価証券

種類	2018年4月20日現在	2018年10月22日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
特殊債券	278,158	404,082
社債券	24,324,543	122,253,871
合計	24,046,385	121,849,789

(注)「当計算期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

(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。

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2018年10月22日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	ドル	EIBK KR FRN 191021	500,000	500,220.00	
		EIBK KR FRN 221101	400,000	403,260.00	
		KR DEV BANK FRN 220227	800,000	800,776.00	
		KR NATL OIL FRN 200327	800,000	800,576.00	
	ドル 小計		2,500,000	2,504,832.00 (281,768,551)	
特殊債券 合計				281,768,551 (281,768,551)	
社債券	ドル	ABN AMRO FRN 210827	700,000	701,386.00	
		AIG GLOBAL F1 FRN 200702	200,000	200,514.00	
		ALLSTATE FRN 210329	300,000	301,056.00	
		AMERI HONDA F FRN 211105	400,000	400,328.00	
		AMEX FRN 230803	800,000	797,608.00	

ANHEER-BCH FRN 210201	600,000	613,344.00	
ANHEUSER-BUSCH FRN240112	250,000	250,200.00	
ANZ FRN 210601	500,000	507,145.00	
ANZ FRN 220519	750,000	753,382.50	
AT&T INC FRN 240612	500,000	501,460.00	
BAC FRN 230723	1,100,000	1,098,823.00	
BANQ FED CRD FRN 220720	800,000	800,816.00	
BANQ FED CRD FRN 230720	800,000	804,112.00	
BARCLAYS 7.625 221121	1,000,000	1,072,570.00	
BARCLAYS BK FRN 201211	400,000	400,176.00	
BARCLAYS FRN 220110	830,000	840,956.00	
BAT CAPITAL FRN 200814	700,000	702,296.00	
BECTON DICK FRN 220606	650,000	652,099.50	
BK CHINA/HK FRN 190711	300,000	300,300.00	
BK CHINA/SG FRN 210417	300,000	300,126.00	
BNP PARIBAS 7.625 210330	1,400,000	1,451,436.00	
BONYMellon FRN 221030	1,000,000	1,012,910.00	
BP CAPITAL FRN 210916	300,000	305,235.00	
BPCE FRN 220522	800,000	806,656.00	
CAPITAL ONE FRN 220130	600,000	604,116.00	
CBA FRN 210906	1,000,000	1,010,790.00	
CD AGRICOLE FRN 251223	1,100,000	1,185,008.00	
CITIBANK NA FRN 210623	400,000	401,004.00	
CITIGROUP FRN 230901	1,400,000	1,426,530.00	
CITIGROUP FRN 240601	500,000	500,500.00	
CMCSA FRN 240415	1,000,000	996,240.00	
COM BK AUS FRN 220310	400,000	402,012.00	
CONOCOPHIL FRN 220515	400,000	405,960.00	
COOP RAB UA/N FRN 210426	300,000	300,396.00	
CS 7.5 231211	1,200,000	1,247,628.00	
CS FRN 2022/12/14	900,000	906,138.00	
CS FRN 210416	1,000,000	1,040,360.00	
CVS HEALTH FRN 210309	800,000	803,888.00	
DANSKE BANK FRN 230912	500,000	485,895.00	
DEUTSCHE BK FRN 190510	850,000	853,740.00	
DNB BANK 5.75 200326	800,000	794,888.00	
DNB BANK FRN 210602	900,000	913,770.00	
ENBRIDGE INC FRN 200615	250,000	250,580.00	
FORD CRED FRN 211012	900,000	884,790.00	
FORD CREDIT FRN 200612	500,000	500,230.00	
GENERAL MILL FRN 210416	700,000	700,077.00	
GS FRN 231129	900,000	931,842.00	
	600,000	600,324.00	

HALFMOON FRN 210917		
HNDLSBKN FRN 200908	250,000	250,352.50
HP ENTERPRISE FRN 211005	600,000	599,868.00
HSBC HOLD 6.875 210601	550,000	567,924.50
HSBC HOLDINGS FRN 220105	650,000	665,762.50
HYUNDAI CAP FRN 210708	800,000	800,920.00
ING GROEP 6.875 220416	1,400,000	1,407,714.00
ING GROEP FRN 220329	600,000	607,584.00
JPM CHASE FRN 210507	300,000	304,515.00
JPM CHASE FRN 220425	1,300,000	1,306,825.00
JPM CHASE FRN 240723	700,000	698,635.00
MITSUB UFJ FIN F 230726	600,000	601,146.00
MIZUHO FG FRN 210412	400,000	408,480.00
MIZUHO FG FRN 210913	850,000	862,036.00
MIZUHO FG FRN 220911	700,000	703,234.00
MONTREAL BK FRN 210827	900,000	909,666.00
MORGAN STAN FRN 221024	900,000	918,720.00
MS FRN 240508	600,000	607,716.00
MUFG FRN 210913	700,000	709,534.00
MUFG FRN 220222	300,000	302,622.00
MUFG FRN 220725	500,000	501,740.00
NAB FRN 210712	500,000	507,670.00
NAB FRN 220522	750,000	753,532.50
NATL BK CAD FRN 200512	1,035,000	1,038,922.65
NORDEA BANK 5.5 190923	300,000	296,364.00
NORDEA BANK 6.125 240923	500,000	481,135.00
NORDEA BANK FRN 210527	500,000	506,435.00
NORDEA BANK FRN 230830	500,000	498,890.00
NOVA SCOTIA FRN 220307	700,000	704,207.00
PEMEX FRN 220311	800,000	847,536.00
PHILLIPS 66 FRN 190301	700,000	699,958.00
RABOBANK FRN 220110	500,000	505,690.00
RBC FRN 220201	700,000	706,734.00
RBS 8.625 210815	500,000	526,530.00
RBS FRN 220515	1,100,000	1,106,336.00
SANTANDER FRN 220411	600,000	611,820.00
SANTANDER UK FRN 201103	250,000	249,642.50
SINOPEC FRN 190410	800,000	800,992.00
SKANDINAV 5.75 200513	1,300,000	1,295,970.00
SKANDINAV ENS FRN 210517	600,000	600,300.00
SMBC FRN 210309	750,000	770,235.00
SMBC FRN 230719	600,000	601,944.00
ST BK INDIA FRN 200406	500,000	500,910.00



	STANLN FRN 230120	1,000,000	1,000,600.00
	SUMIBK 3.2	500,000	499,510.00
	SVENSKA 5.25 210301	1,300,000	1,274,676.00
	SVENSKA FRN 210524	900,000	900,972.00
	SWEDBANK FRN 220314	200,000	201,516.00
	TD BANK FRN 210407	750,000	762,772.50
	TD BANK FRN 210611	850,000	852,754.00
	TYSON FOODS FRN 200602	250,000	250,665.00
	UBS GROUP FRN 220201	400,000	410,084.00
	UBS GROUP FRN 220523	500,000	505,875.00
	UNITEDHEALTH FRN 210615	500,000	499,975.00
	VERIZON COM FRN 250515	500,000	502,780.00
	VODAFONE FRN 240116	500,000	500,275.00
	WBC FRN 210819	700,000	708,519.00
	WBC FRN 220111	500,000	505,190.00
	WELLS FARGO FRN 210304	400,000	408,228.00
	WELLS FARGO FRN 221031	900,000	914,310.00
	WFC FRN 211022	400,000	399,876.00
ドル	小計	72,415,000	73,166,966.65 (8,230,552,078)
ユーロ	ABN AMRO 5.75 200922	1,500,000	1,572,825.00
	AT&T FRN 230905	400,000	404,912.00
	BAC FRN 190506	1,200,000	1,207,104.00
	BAYER CAP CO FRN 220626	600,000	601,932.00
	BBVA 8.875 210414	600,000	662,832.00
	BBVA FRN 220412	600,000	601,656.00
	BBVA FRN 230309	200,000	196,084.00
	BK CHN/PARIS FRN 201122	500,000	499,060.00
	BNP PARIBAS FRN 230522	600,000	596,580.00
	BNP PARIBAS FRN 240607	200,000	199,550.00
	BPCE FRN 220309	1,200,000	1,214,664.00
	CD AGRICOLE FRN 220420	700,000	702,982.00
	COM BK AUS FRN 230308	300,000	301,590.00
	DEUTSCHE BK FRN 201207	200,000	197,796.00
	FCE BANK FRN 200826	300,000	295,188.00
	GS FRN 210909	950,000	951,377.50
	GS FRN 230926	200,000	198,200.00
	HSBC HOLDINGS FRN 231005	400,000	397,828.00
	INTESA SANP FRN 200615	1,100,000	1,095,402.00
	INTESA SANPAO FRN 270111	200,000	204,732.00
	INTNED 0.5	500,000	499,495.00
	KBC GROUP NV FRN 221124	800,000	798,736.00

	LLOYDS BK 6.375 200627	600,000	630,384.00	
	LLOYDS BK FRN 240621	700,000	694,253.00	
	MIZUHO FG FRN 230410	300,000	300,138.00	
	MONTREAL BK FRN 220314	600,000	603,468.00	
	MORGAN STAN FRN 200521	600,000	599,922.00	
	RABOBANK FRN 210629	1,200,000	1,316,652.00	
	SANTANDER FRN 200304	700,000	702,898.00	
	SANTANDER FRN 220425	400,000	423,712.00	
	SANTANDER UK FRN 220518	500,000	496,035.00	
	SCANIA 0.1	500,000	499,315.00	
	SCANIA CV AB FRN 201019	300,000	300,180.00	
	SGSA 6.75 210407	1,100,000	1,167,111.00	
	SGSA FRN 220401	800,000	802,688.00	
	SKY PLC FRN 200401	200,000	201,350.00	
	SMBC FRN 220614	900,000	899,415.00	
	UBS GROUP 5.75 220219	1,300,000	1,417,975.00	
	UNICREDIT SPA FRN 220603	200,000	214,354.00	
	WFC FRN 220131	500,000	501,620.00	
	ユーロ 小計	24,650,000	25,171,995.50 (3,255,745,897)	
社債券 合計			11,486,297,975 (11,486,297,975)	
合計			11,768,066,526 (11,768,066,526)	

- (注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額です。  
2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。  
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	特殊債券 4銘柄	2.28%	72.33%
	社債券 108銘柄	66.74%	
ユーロ	社債券 40銘柄	26.40%	27.67%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 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

2018年10月31日現在

資産総額	34,647,687円
負債総額	536,158円
純資産総額（ - ）	34,111,529円
発行済数量	35,429,661口
1単位当りの純資産額（ / ）	0.9628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

2018年10月31日現在

資産総額	30,898,362円
負債総額	6,677円
純資産総額（ - ）	30,891,685円
発行済数量	31,241,285口
1単位当りの純資産額（ / ）	0.9888円

## （参考）グローバル変動金利債券マザーファンド

2018年10月31日現在

資産総額	12,209,996,128円
負債総額	4,950円
純資産総額（ - ）	12,209,991,178円
発行済数量	11,322,099,634口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0784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30年5月末現在）  
（略）
- (2) 会社の機構（平成30年5月末現在）  
（略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2018年10月末現在）  
（略）
- (2) 会社の機構（2018年10月末現在）  
（略）

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびに証券投資信託の募集又は私募（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基づく運用（投資運用業）および投資助言業務を行っています。

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2018年10月末現在、計158本（追加型株式投資信託124本、単位型株式投資信託12本、単位型公社債投資信託22本）であり、その純資産総額の合計は727,811百万円です。

##### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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(2017年4月1日から2018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34期中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY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。

なお、新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日をもって、EY新日本有限責任監査法人に名称を変更しております。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
<b>(資産の部)</b>					
流動資産					
1		現金・預金		4,606,103	
2		前払費用		69,417	
3		未収委託者報酬		919,027	
4		未収運用受託報酬		1,371,086	
5		未収収益		57	
6		繰延税金資産		55,224	
7		その他		3,144	
流動資産合計		6,745,230		7,024,060	
固定資産					
1 有形固定資産					
(1)	1	建物		27,525	
(2)	1	器具備品		19,460	
有形固定資産合計		44,002		46,986	
2 無形固定資産					
(1)		電話加入権		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		66,370	
(2)		長期差入保証金		161,598	
(3)		繰延税金資産		218,591	
(4)		その他		31	
投資その他の資産合計		370,490		446,591	
固定資産合計		419,028		498,113	
資産合計		7,164,258		7,522,173	

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
1		預り金		15,053	
2 未払金					
(1)	2	未払配当金		200,000	
(2)		未払手数料		332,515	
(3)		その他未払金		168,587	
		1,001,247		701,102	

3	未払費用		691,223		1,106,809
4	未払消費税等		10,617		44,927
5	未払法人税等		143,251		71,550
6	前受収益		7,954		-
7	賞与引当金		120,025		104,908
8	役員賞与引当金		9,000		5,400
	流動負債合計		2,065,604		2,049,753
	固定負債				
1	退職給付引当金		90,737		112,624
2	資産除去債務		8,039		8,181
	固定負債合計		98,776		120,805
	負債合計		2,164,380		2,170,558
	(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		3,035,695		3,385,956
	利益剰余金合計		3,035,695		3,385,956
	株主資本合計		4,998,975		5,349,236
	評価・換算差額等				
1	その他有価証券評価差額金		902		2,378
	評価・換算差額等合計		902		2,378
	純資産合計		4,999,878		5,351,614
	負債・純資産合計		7,164,258		7,522,173

## (2) 【損益計算書】

区分	注記番号	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1	委託者報酬	5,363,843		5,004,466	
2	運用受託報酬	3,816,308	9,180,152	3,372,949	8,377,416
営業費用					
1	支払手数料	2,890,668		2,340,455	
2	広告宣伝費	15,637		40,406	
3	公告費	2,970		2,265	
4	調査費	2,245,765		2,634,404	
(1)	調査費	780,172		891,711	
(2)	委託調査費	1,461,574		1,738,613	
(3)	図書費	4,018		4,078	
5	営業雑経費	190,147		183,871	

(1) 通信費		16,450		6,147	
(2) 印刷費		160,333		162,442	
(3) 諸会費 一般管理費		13,363	5,345,189	15,281	5,201,402
1 給料		1,361,632		1,460,280	
(1) 役員報酬		75,948		74,540	
(2) 給料・手当		1,147,148		1,210,435	
(3) 賞与		138,535		175,304	
2 福利厚生費		134,150		161,706	
3 交際費		9,622		10,338	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		36,626		49,534	
6 法人事業税		41,868		34,078	
7 租税公課		13,856		15,243	
8 不動産賃借料		212,520		206,575	
9 退職給付費用		50,781		45,062	
10 賞与引当金繰入		120,025		104,908	
11 役員賞与引当金繰入		9,000		5,400	
12 固定資産減価償却費		10,429		7,609	
13 諸経費		260,939	2,261,753	297,581	2,398,617
営業利益			1,573,209		777,396
営業外収益					
1 受取配当金		90		93	
2 受取利息		280		309	
3 有価証券売却益		-		654	
4 有価証券償還益		745		-	
5 為替差益		9,721		1,906	
6 雑益		2,066	12,904	2,023	4,987
営業外費用					
1 有価証券売却損		6		-	
2 雑損		8	14	121	121
経常利益			1,586,098		782,261
特別損失					
1 固定資産除却損	1	0	0	0	0
税引前当期純利益			1,586,098		782,261
法人税・住民税及び事業 税			428,835		281,742
法人税等調整額			45,816		49,741
当期純利益			1,111,446		550,260

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		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

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		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
当期変動額						
剰余金の配当				200,000	200,000	200,000
当期純利益				550,260	550,260	550,260
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	350,260	350,260	350,260
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236

	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
当期変動額			



剰余金の配当			200,000
当期純利益			550,260
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,475	1,475	1,475
当期変動額合計	1,475	1,475	351,736
当期末残高	2,378	2,378	5,351,614

## 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	2～20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、2016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）を採用していましたが、当事業年度より定額法に変更しております。

これは、当社の属するSOMPO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。

この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

## 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。

(単位：千円)

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
建物	78,317	82,540
器具備品	44,893	47,055

- 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。

(単位：千円)

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
未払金		
未払配当金	500,000	200,000

### (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。

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
器具備品	0	0

### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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 期末株式数
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
2017年3月28日 取締役会	普通 株式	500,000千円	20,759円	2016年3月31日	2017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 2017年4月1日 至 2018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 期末株式数
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
2018年3月27日 取締役会	普通 株式	200,000千円	8,303円	2017年3月31日	2018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（2017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 その他有価証券	31,812	31,812	-
資産計	6,613,532	6,613,532	-

当事業年度（2018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	4,606,103	4,606,103	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	919,027	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	1,371,086	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	50,620	50,620	-
資産計	6,946,838	6,946,838	-
(1) 未払費用	1,106,809	1,106,809	-
負債計	1,106,809	1,106,809	-

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。

負 債

(1) 未払費用

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018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 その他有価証券」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（2017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
----	-----------	--------	---	--------

当事業年度(2018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	4,605,909	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	-	-	-
(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	-	37,688	1,126	11,806
合計	6,896,023	37,688	1,126	11,806

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(2017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

当事業年度(2018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	40,528	36,993	3,534
	小計	40,528	36,993	3,534
	(1) 株式	-	-	-

貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	10,092	10,199	106
	小計	10,092	10,199	106
合計		50,620	47,193	3,427

## 5. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017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

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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	6,160	668	14
合計	6,160	668	14

## （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

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）	当事業年度 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	75,674	90,737
退職給付費用	21,913	24,091
退職給付の支払額	6,850	2,204
退職給付引当金の期末残高	90,737	112,624

## （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

（単位：千円）

	前事業年度 （2017年3月31日）	当事業年度 （2018年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	90,737	112,624
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,737	112,624
退職給付引当金	90,737	112,624
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	90,737	112,624

## (3) 退職給付費用

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	21,913	24,091

## 3. 確定拠出制度

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	12,945	14,515

(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

(単位：千円)

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018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	127,409	172,841
退職給付引当金	27,800	34,485
賞与引当金	37,039	32,123
未払費用否認	18,239	17,276
繰延資産損金算入限度超過額	7,090	6,561
未払事業税	6,351	6,393
その他	4,335	8,285
繰延税金資産 小計	228,266	277,965
評価性引当額	2,554	2,595
繰延税金資産 合計	225,712	275,370
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	402	1,049
固定資産除去価額	588	505
繰延税金負債 合計	990	1,554
繰延税金資産の純額	224,721	273,815

## 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

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
期首残高	7,898	8,039
時の経過による調整額	140	142
期末残高	8,039	8,181

## (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 2016年4月1日 至 2017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。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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

(単位: 千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益
B社(注)	972,353

(注) B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 2016年4月1日 至 2017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	運用受託報酬の受取り (注1)	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	投資信託代行手数料の支払 (注2)	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。

注2. 取引条件及び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 2017年4月1日 至 2018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	運用受託報酬の受取り (注1)	165,124	未収運用受託報酬	89,703
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	投資信託代行手数料の支払 (注2)	468,486	未払手数料	107,721

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。

注2. 取引条件及び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  
SOMPO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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	207,593.03	222,196.99
1株当たり当期純利益金額(円)	46,146.84	22,846.62

(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。

(注) 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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当期純利益(千円)	1,111,446	550,260
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)	1,111,446	550,260
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34期中間会計期間 (2018年9月30日)
区分	注記 番号	金額(千円)
<b>(資産の部)</b>		
流動資産		
1 現金・預金		4,473,545
2 前払費用		88,572
3 未収委託者報酬		1,057,891
4 未収運用受託報酬		1,254,463
5 未収収益		53
6 その他		3,511
流動資産合計		6,878,038
固定資産		
1 有形固定資産	1	50,170
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		59,373
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		296,100
(4) その他		32
投資その他の資産合計		517,103
固定資産合計		571,809
資産合計		7,449,848

		第34期中間会計期間 (2018年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
<b>(負債の部)</b>			
流動負債			
1	預り金		14,806
2	未払金		
	(1)未払手数料		357,874
	(2)その他未払金		180,750
	未払金合計		538,625
3	未払費用		809,516
4	未払法人税等		170,820
5	賞与引当金		89,525
6	役員賞与引当金		2,700
7	その他	2	53,154
	流動負債合計		1,679,147
固定負債			
1	退職給付引当金		122,911
2	資産除去債務		8,254
	固定負債合計		131,166
	負債合計		1,810,313
<b>(純資産の部)</b>			
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		3,675,331
	利益剰余金合計		3,675,331
	株主資本合計		5,638,611
評価・換算差額等			
1	その他有価証券評価差額金		922
	評価・換算差額等合計		922
	純資産合計		5,639,534
	負債・純資産合計		7,449,848

## (2) 中間損益計算書

		第34期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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	2,430,056	
2	運用受託報酬	1,834,500	4,264,557
営業費用			
1	支払手数料	1,087,830	
2	広告宣伝費	13,247	
3	公告費	200	
4	調査費	1,394,033	
	(1)調査費	476,478	
	(2)委託調査費	914,955	
	(3)図書費	2,599	
5	営業雑経費	95,789	
	(1)通信費	2,932	
	(2)印刷費	80,533	
	(3)諸会費	12,323	
			2,591,101

一般管理費				
1 給料			728,444	
(1) 役員報酬			40,840	
(2) 給料・手当			631,811	
(3) 賞与			55,792	
2 福利厚生費			95,862	
3 交際費			3,126	
4 旅費交通費			18,253	
5 法人事業税			20,304	
6 租税公課			3,566	
7 不動産賃借料			103,211	
8 退職給付費用			28,588	
9 賞与引当金繰入			89,525	
10 役員賞与引当金繰入			2,700	
11 固定資産減価償却費	1		5,729	
12 諸経費			162,828	1,262,140
営業利益				411,315
営業外収益				
1 受取配当金			98	
2 受取利息			144	
3 有価証券売却益			12,030	
4 為替差益			3,301	
5 雑益			1,266	16,840
営業外費用				
1 雑損			4,179	4,179
経常利益				423,976
特別損失				
1 固定資産除却損			0	0
税引前中間純利益				423,976
法人税、住民税及び事業税				156,243
法人税等調整額				21,643
中間純利益				289,375

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236
当中間期変動額						
中間純利益				289,375	289,375	289,375
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	-	-	-	289,375	289,375	289,375
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,331	3,675,331	5,638,611

	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	2,378	2,378	5,351,614
当中間期変動額			

中間純利益			289,375
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	1,455	1,455	1,455
当中間期変動 額合計	1,455	1,455	287,920
当中間期末残高	922	922	5,639,534

## 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、売却原価は移動平均法により算定）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 2～20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。

## （表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

## 注記事項

### （中間貸借対照表関係）

	第34期中間会計期間 (2018年9月30日)
--	----------------------------

1 有形固定資産の減価償却累計額	133,835千円
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34期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
1 減価償却実施額 有形固定資産	5,729千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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34期中間会計期間 (2018年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

2018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	4,473,545	4,473,545	-
(2) 未収委託者報酬	1,057,891	1,057,891	-
(3) 未収運用受託報酬	1,254,463	1,254,463	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	58,623	58,623	-
資産計	6,844,524	6,844,524	-
(1) 未払費用	809,516	809,516	-
負債計	809,516	809,516	-

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。

負債

(1) 未払費用

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
非上場株式	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。

(有価証券関係)

第34期中間会計期間（2018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	27,747	26,193	1,553
	小計	27,747	26,193	1,553
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	30,876	31,099	222
	小計	30,876	31,099	222
合計		58,623	57,292	1,330

(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34期中間会計期間（2018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 8,181千円

時の経過による調整額 73千円

中間期末残高 8,254千円

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

第34期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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34期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益
C社（注）	552,513

（注）C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せん。

## （1株当たり情報）

	第34期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
1株当たり純資産額	234,151.32 円
1株当たり中間純利益金額	12,014.75 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34期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
中間純利益	289,375 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	289,375 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。



## 独立監査人の監査報告書

2018年12月  
12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

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員指定有限責任社員  
業務執行社員公認  
会計  
士 小 澤  
裕 治  
公認  
会計  
士 伊 藤  
志 保

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（毎月分配型）円ヘッジありコースの2018年4月21日から2018年10月22日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）円ヘッジありコースの2018年10月22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

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、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](#)

# 独立監査人の監査報告書

2018年12月12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

EY新日本有限責任監査法  
人指定有限責任社員  
業務執行社員指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 裕治

公認会計士 伊藤 志保

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（毎月分配型）円ヘッジなしコースの2018年4月21日から2018年10月22日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）円ヘッジなしコースの2018年10月22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

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、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](#)

# 独立監査人の監査報告書

2018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  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
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2017年4月1日から2018年3月31日までの第33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、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2018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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2018年11月26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

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 蒲 谷 剛 史  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保  
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2018年4月1日から2019年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間(2018年4月1日から2018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、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2018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(2018年4月1日から2018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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。