

【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29年 9月15日
【発行者名】	あおぞら投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 原田 政明
【本店の所在の場所】	東京都千代田区麹町六丁目 1 番地 1
【事務連絡者氏名】	木村 升昭
【電話番号】	03-6752-1050
【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】	あおぞら・U S トリプルプラス・ファンド（年4回決算型）
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成29年 3月16日から平成30年 3月15日まで） 2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成29年3月15日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の関係情報を更新・追加および訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下の通り更新または訂正します。

下線部_____は訂正箇所を表します。

第一部【証券情報】

<訂正前>

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額*1とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-4520-3401(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

(5)【申込手数料】

本ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.24%*(税抜3%)を上限として販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-4520-3401(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

(6)【申込単位】

申込単位は、販売会社が委託会社の承認を得て定める単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」に基づいて収益分配金を再投資する場合には、1口の整数倍とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-4520-3401(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

(中略)

(8)【申込取扱場所】

申込取扱場所は、原則として販売会社の本支店等とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-4520-3401(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

(以下略)

<訂正後>

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額*1とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-6752-1051(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

(5)【申込手数料】

本ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.24%*(税抜3%)を上限として販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-6752-1051(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

(6)【申込単位】

申込単位は、販売会社が委託会社の承認を得て定める単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」に基づいて収益分配金を再投資する場合には、1口の整数倍とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-6752-1051(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

(中略)

(8)【申込取扱場所】

申込取扱場所は、原則として販売会社の本支店等とします。

(中略)

委託会社の電話番号：03-6752-1051(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

(以下略)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(前略)

ファンドの特色

ファンドの目的

主として、米国の株式によるロング・ショート(買建ておよび売建て)運用ならびに米国の債券に投資を行い、中長期的な投資収益の獲得を目指します。

ファンドの特色

- 1 投資信託証券への投資を通じて米国の株式によるロング(買建て)・ショート(売建て)運用を行い、株式市場に左右されにくい収益の獲得を目指します。
- 2 投資信託証券への投資を通じて米国の債券に投資を行い、定期的な金利収入によるトータル・リターンの安定化を目指します。
- 3 機動的に為替ヘッジを行うことで、為替変動による影響の緩和や為替差益の獲得を目指します。
- 4 年4回決算を行い、決算毎に収益分配方針に基づき分配を行います。

※本ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の運用は、米国株式のロング・ショート戦略と債券運用に強みを持つニューバーガー・バーマングループ(以下「ニューバーガー・バーマン」といいます。)が運用を行います。

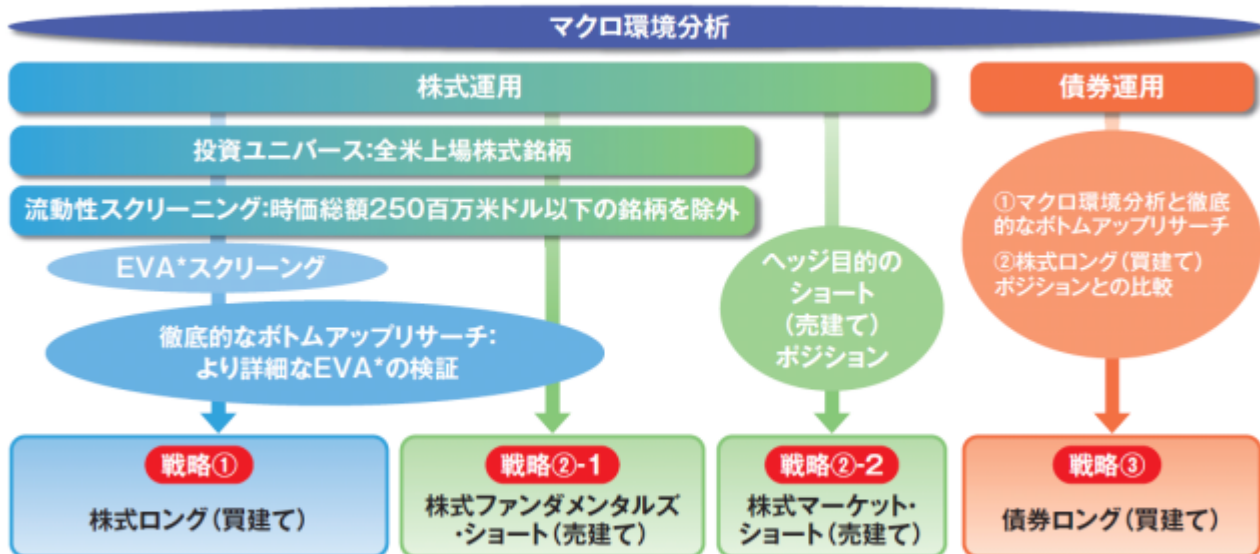
※委託会社は、外国為替予約取引等の運用をシティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッド(以下「投資顧問会社」という場合があります。)に委託します。シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドは、運用の権限の委託を受けて、本ファンドの外国為替予約取引等の運用指図を行います。

※運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

組入れファンドの運用プロセス

組入れファンドの運用は、以下のプロセスで行われます。マクロ環境分析を行い、見通しに応じて①株式ロング(買建て)、②株式ショート(売建て)および③債券ロング(買建て)で構成される、3つの戦略の資産配分を調整します。



(出所)ニューバーガーバーマン

* EVA(Economic Value Added)とは、経済的付加価値のことで、「利ざや(投下資本利益率-資本コスト)×資産(投下資本)」で算出します。

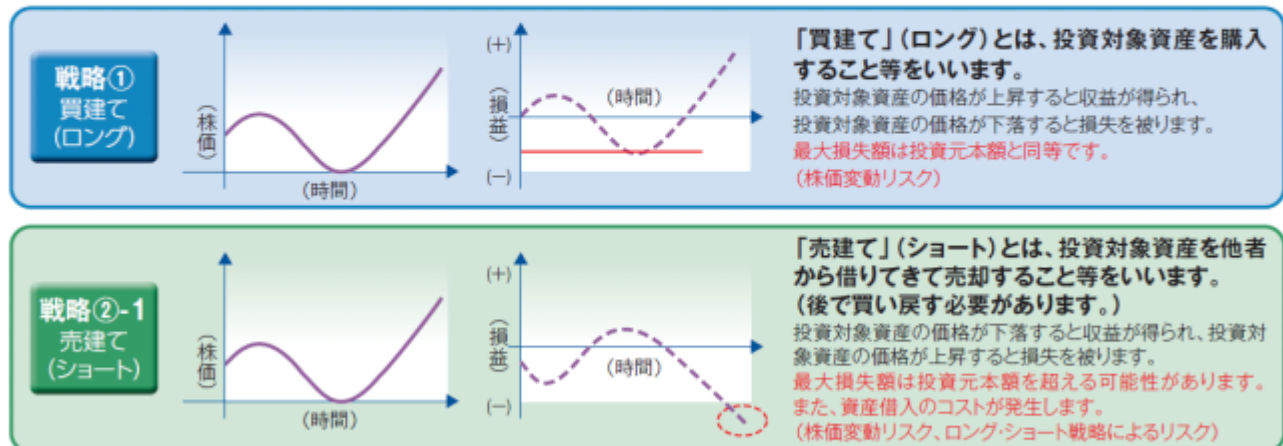
※上記は組入れファンドの運用プロセスを説明したものです。上記の運用プロセスがその目的を達成できる保証はありません。また、上記の運用プロセスは変更される場合があります。

戦略① 戦略②-1:米国株式によるロング・ショート戦略

ロング・ショート戦略とは、将来株価上昇が期待される銘柄を買建て(ロング)、将来株価下落が見込まれる銘柄を売建て(ショート)する投資手法です。

「買建て」銘柄の株価が上昇する場合には、収益を得ることができます。逆に株価が下落すると損失を被ります。

また「売建て」銘柄の株価が下落する場合には、収益を得ることができます。逆に株価が上昇すると損失を被ります。



※上記のイメージ図はロング・ショート戦略をご理解いただくことを目的に委託会社が作成したものであり、本戦略の運用成果等を保証するものではありません。

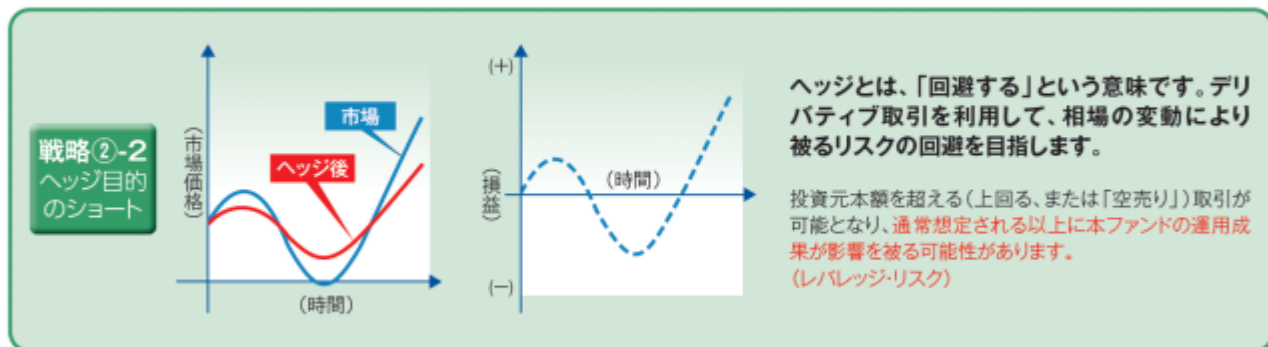
※組入れファンドにおける買建てと売建てに際しては、デリバティブ取引を利用することがあります。その際、デリバティブ取引の相手方となる金融機関の信用リスク(デリバティブ取引の取引先に関するリスク)を負うことになります。

※ロングとショート双方で損失が発生した場合は、通常想定される以上に本ファンドの運用成果に影響を被る可能性があります。

※「株価変動リスク」「ロング・ショート戦略によるリスク」「デリバティブ取引の取引先に関するリスク」の詳細については、後記「投資リスク」をご覧ください。

戦略②-2:米国株式マーケット・ショート戦略(ヘッジ目的の売建て)

米国株式市場における市場変動リスクをヘッジするため、デリバティブ取引やETF(上場投資信託)の「売建て」を行います。これにより、米国株式市場全体の上昇/下落による運用成果への影響を軽減させることを目指します。



※上記のイメージ図はマーケット・ショート戦略をご理解いただくことを目的に委託会社が作成したものであり、本戦略の運用成果等を保証するものではありません。

※組入れファンドにおける買建てと売建てに際しては、デリバティブ取引を利用することがあります。その際、デリバティブ取引の相手方となる金融機関の信用リスク(デリバティブ取引の取引先に関するリスク)を負うことになります。

※「レバレッジ・リスク」「デリバティブ取引の取引先に関するリスク」の詳細については、後記「投資リスク」をご覧ください。

戦略③:米国債券によるロング戦略

米国債券の「買建て」を行うことで、定期的な金利収入により、ファンド全体のトータル・リターン(総合収益)の下支えすることを目指します。本戦略では、投資適格債券も投資対象としますが、マクロ環境見通しが「強気」の場合、ハイ・イールド債券の組入比率を増加させます。

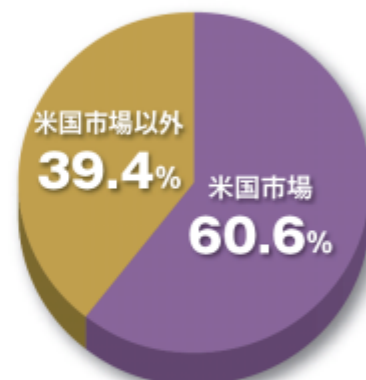
<信用格付>

低	S&P	Moody's	投資適格債券
	AAA	Aaa	
	AA	Aa	
	A	A	
	BBB	Baa	
	BB	Ba	ハイ・イールド債券
	B	B	
	CCC	Caa	
	CC	Ca	
	C	C	
	D		
高			

信用リスク

※S&P、Moody'sは代表的な格付機関です。

ハイ・イールド債券市場の市場別時価総額比率
(2017年6月末現在)



米 国 市 場: バンクオブアメリカ メリルリンチ US ハイ・イールド・キャッシュ・ベイ・インデックスの時価総額

世 界 市 場: バンクオブアメリカ メリルリンチ グローバル・ハイ・イールド・インデックスの時価総額

米 国 市 場 以 外: 「世界市場」の時価総額から「米国市場」の時価総額を差し引いて委託会社が算出

一般的にハイ・イールド債券(BB/Ba格相当以下)は、投資適格債券(BBB/Baa格相当以上)と比較して、債券の元利金の支払いが定められた通りに行われないリスクが高い傾向があります。(信用リスク)
一方、信用力が低い分、高い利回りで発行・取引される傾向があります。

※「信用リスク」の詳細については、後記「投資リスク」をご覧ください。

組入れファンドの運用



NEUBERGER BERMAN

【設立日】
1939年6月22日

【運用資産残高】
約2,707億米ドル(約30.4兆円)

【従業員数】
約1,900名

本社オフィスビル:米国ニューヨーク

組入れファンドの運用は、ニューバーガー・バーマンが行います。ニューバーガー・バーマンは1939年創業の米国の独立系運用会社であり、世界19カ国(30拠点)に拠点を擁しています。株式や債券などの伝統的資産からオルタナティブ資産まで、多様な運用サービスを世界の機関投資家や個人投資家、富裕層、基金・財団等の顧客に提供しています。

出所ニューバーガー・バーマン
従業員数および運用資産残高:
2017年6月末現在、1米ドル=112.36円で換算

為替のアクティブ・ヘッジ

本ファンドは「為替のアクティブ・ヘッジ」を行うことで、米ドル建て資産に対して為替レートの変動に左右されにくい運用を目指します。為替のアクティブ・ヘッジとは、円安傾向と判断する局面においては為替ヘッジを行わないことにより、為替差益の獲得を目指し、円高傾向と判断する局面においては機動的に為替ヘッジすることを目指す戦略です。

円高を招く二大要因

市場リスク:世界金融市場のリスク指標

株式・債券・外国為替・市場流動性・信用市場・新興国市場等を包括的に観察し、金融市場全体のリスク度を計測

2国間金利差:日米金利差の指標

米ドル金利の低下は日本円の相対的な魅力を引き上げ

2つの指標のいずれかでも条件を満たすと為替ヘッジ比率を約100%に調整

- 円高を導きやすい二大要因に焦点をあてたヘッジ戦略で、一定要因を満たすと為替ヘッジを行います。それ以外の場合はヘッジを行いません。
- 特に金融危機のようにリスクが伝播しやすい局面において、資産保全を目指します。
- 為替(米ドル-日本円間)市場における通貨変動リスクをヘッジするため、為替予約取引等を行います。これにより、為替市場全体の通貨高/通貨安による運用成果への影響を軽減させることを目指します。(為替変動リスク)

※上記の為替戦略が、必ずしも円高局面における為替ヘッジを保障するものではありません。また、為替ヘッジを行っている局面においても円安になる可能性があります。将来の金利変動によっては、為替ヘッジのコストが増大する場合があります。為替ヘッジを行わない部分については、為替変動による影響を受けます。

※市況動向や資金動向その他の要因等によっては、上記のような運用ができない場合があります。また、上記運用戦略の決定プロセスは変更される場合があります。

※上記は本ファンドの投資顧問会社の資料に基づいて、委託会社が作成したものです。

※為替のアクティブ・ヘッジに際しては、為替先渡取引を利用することがあります。その際、先渡取引の相手方となる金融機関の信用リスク(デリバティブ取引の取引先に関するリスク)を負うことになります。

※「為替変動リスク」「デリバティブ取引の取引先に関するリスク」の詳細については、後記「投資リスク」をご覧ください。

為替のアクティブ・ヘッジの委託先について

本ファンドの外国為替予約取引等の運用にあたっては、シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドは、シティグループ・インクの100%子会社であるCitigroup Global Markets Hong Kong Holdings Limited傘下の投資運用会社です。

シティグループ・インクは、世界160以上の国と地域に約2億の顧客口座を有する世界有数のグローバルな銀行です。個人、法人、政府および団体を対象として、個人向け銀行業務やカードビジネス、法人・投資銀行業務、証券業務、トランザクション・サービス、ウェルス・マネジメントの分野において、幅広い金融商品およびサービスを提供する、グローバルな総合金融持株会社です。

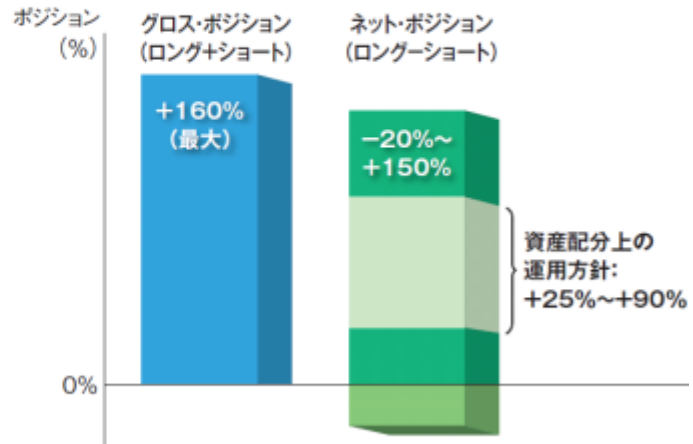
シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッド 運用資産残高:約65.2億米ドル(約7,302億円)

(出所)シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッド
運用資産残高:2017年6月末現在、1米ドル=112.00円で換算

組入れファンドのリスク管理上の運用ガイドライン

米国株式および債券等の買建て（ロング）額から売建て（ショート）額を差し引いた「ネット・ポジション」を、通常時で25%~90%の間で資産配分を変更させる方針です。また、米国株式および債券等の買建て（ロング）額に売建て（ショート）額の絶対値を加えた「グロス・ポジション」を、最大160%とします。

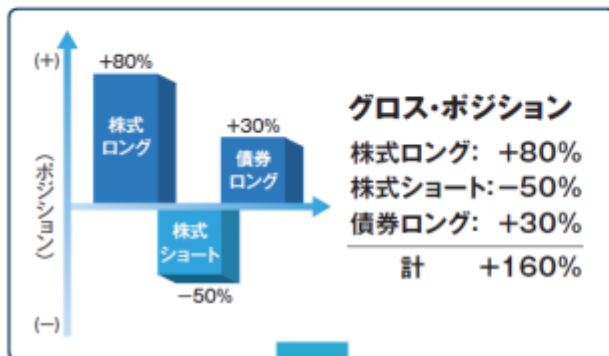
組入れファンドの運用ガイドライン	
グロス・ポジション (ロング+ショート)	上限+160%
ネット・ポジション (ロング-ショート)	-20%~+150%
債券ロング	上限+30%
資産配分上の運用方針	
ネット・ポジション (ロング-ショート)	通常時: +25%~+90%



※ 上記は組入れファンドのリスク管理上の運用ガイドライン等をご理解いただくことを目的に作成したものであり、本戦略の運用成果等を保証するものではありません。

グロス・ポジション／ネット・ポジションのイメージ

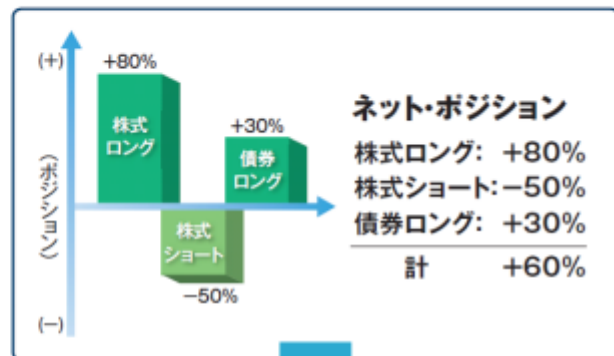
米国株式および債券等の買建て（ロング）額に売建て（ショート）額の絶対値を加えた金額



グロス・ポジションの上限は、実質的な投資対象ファンドの資産総額の+160%です。

なお、組入れファンドの運用ガイドライン上は、買建て額例のみ、投資元本額を上回るポジションが許容されます。
(レバレッジ・リスク)

米国株式および債券等の買建て（ロング）額から売建て（ショート）額を差し引いた金額



ネット・ポジションの範囲は、通常時は、実質的な投資対象ファンドの資産総額の+25%~+90%です。

なお、組入れファンドの運用ガイドライン上は、「レバレッジ」（ネット・ポジション>100%）、「売り越し」（ネット・ポジション<0%）状態が許容されます。
(レバレッジ・リスク)

※ 上記は組入れファンドのリスク管理上の運用ガイドライン等をご理解いただくことを目的に作成したものであり、本戦略の運用成果等を保証するものではありません。

※ 組入れファンドにおける買建てと売建てに際しては、デリバティブ取引を利用することがあります。その際、デリバティブ取引の相手方となる金融機関の信用リスク（デリバティブ取引の取引先に関するリスク）を負うことになります。

※ ロングとショートの双方で損失が発生した場合は、通常想定される以上に本ファンドの運用成果に影響を被る可能性があります。

※ 「レバレッジ・リスク」「デリバティブ取引の取引先に関するリスク」の詳細については、後記「投資リスク」をご覧ください。

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(前略)

委託会社等の概況（本書提出日現在）

- a. 資本金の額 2億2,500万円
- b. 委託会社の沿革
- 平成26年2月4日 会社設立
- 平成26年4月15日 投資運用業登録
- 平成27年7月3日 第二種金融商品取引業登録
- c. 大株主の状況

名称	住所（所在地）	所有株式数 （株）	持株比率 （％）
株式会社あおぞら銀行	東京都千代田区九段南一丁目3番1号	9,000	100

<訂正後>

(前略)

委託会社等の概況（本書提出日現在）

- a. 資本金の額 4億5,000万円
- b. 委託会社の沿革
- 平成26年2月4日 会社設立
- 平成26年4月15日 投資運用業登録
- 平成27年7月3日 第二種金融商品取引業登録
- c. 大株主の状況

名称	住所（所在地）	所有株式数 （株）	持株比率 （％）
株式会社あおぞら銀行	東京都千代田区麹町六丁目1番地1	18,000	100

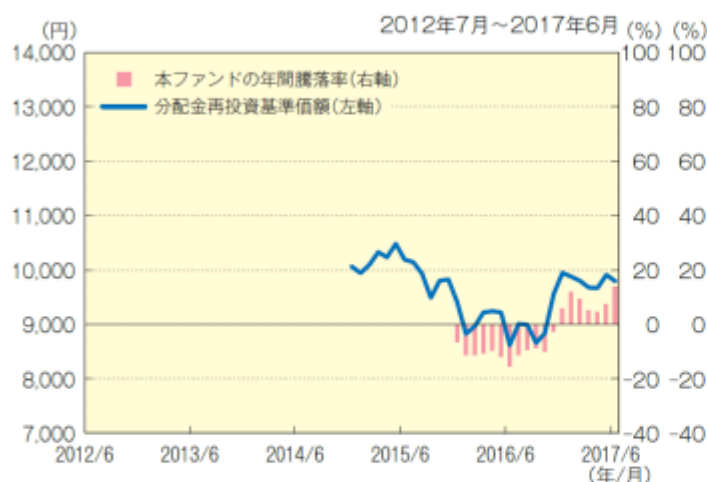
3【投資リスク】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク（参考情報）につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

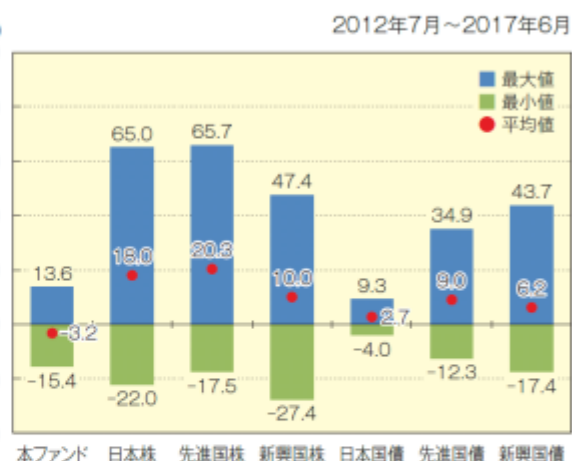
<更新・訂正後>

(参考情報)

本ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移



本ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



※本ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算されており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※本ファンドの設定日が2014年12月19日のため、本ファンドの年間騰落率は2015年12月以降のデータを、分配金再投資基準価額は2014年12月以降のデータをそれぞれ表示しています。

※上記グラフは、本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本ファンドの投資対象とは限りません。

※上記5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、本ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示したものです。ただし、本ファンドの設定日が2014年12月19日のため、本ファンドについては2015年12月～2017年6月の各月末の直近1年間の騰落率を表示しています。

※本ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

(代表的な各資産クラスの指数)

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

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

※MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

※NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表してい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指数です。なお、NOMURA-BPIに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

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

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

4【手数料等及び税金】

<訂正前>

(1)【申込手数料】

(中略)

申込手数料の詳細については、販売会社にお問い合わせください。販売会社については、下記の照会先までお問い合わせください。

<照会先（あおぞら投信株式会社）>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-4520-3401（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。

(以下略)

<訂正後>

(1)【申込手数料】

(中略)

申込手数料の詳細については、販売会社にお問い合わせください。販売会社については、下記の照会先までお問い合わせください。

<照会先（あおぞら投信株式会社）>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-6752-1051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。

(以下略)

5【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

以下は平成29年7月31日現在の運用状況であります。

投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

また、各投資比率の合計は端数処理の関係上、100%にならない場合があります。

(1)【投資状況】

あおぞら・U Sトリプルプラス・ファンド（年4回決算型）

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アイルランド	573,288,637	100.78
親投資信託受益証券	日本	99,880	0.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,551,308	0.80
合計(純資産総額)		568,837,209	100.04

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		571,462,816	100.46

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考)あおぞら・マネー・マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		100,277,872	100.00
合計(純資産総額)		100,277,872	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

あおぞら・U Sトリプルプラス・ファンド（年4回決算型）

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アイルランド	投資証券	ニューバーガー・バーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー - U S・ロング・ショート・エクイティ・ファンド	480,146.465	1,170.81	562,161,963	1,193.98	573,288,637	100.78
2	日本	親投資信託 受益証券	あおぞら・マネー・マザーファンド	100,000	0.9990	99,900	0.9988	99,880	0.01

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

投資証券	100.78
親投資信託受益証券	0.01
合計	100.80

（参考）あおぞら・マネー・マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

あおぞら・USトリプルプラス・ファンド（年4回決算型）

該当事項はありません。

（参考）あおぞら・マネー・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】

あおぞら・USトリプルプラス・ファンド（年4回決算型）

資産の種類	通貨	買建/ 売建	数量	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	5,185,581.82	571,320,888	571,462,816	100.46

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（参考）あおぞら・マネー・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】

平成29年7月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末 （平成27年 6月15日）	1,779,516,934	1,814,645,040	1.0132	1.0332
第2特定期間末 （平成27年12月15日）	1,249,752,502	1,249,752,502	0.9103	0.9103
第3特定期間末 （平成28年 6月15日）	975,878,406	975,878,406	0.8564	0.8564
第4特定期間末 （平成28年12月15日）	781,066,817	781,066,817	0.9764	0.9764

第5特定期間末 (平成29年 6月15日)	646,200,902	646,200,902	0.9511	0.9511
平成28年 7月末日	928,143,152		0.8749	
8月末日	892,371,923		0.8733	
9月末日	831,857,882		0.8410	
10月末日	777,161,701		0.8581	
11月末日	765,438,666		0.9280	
12月末日	743,912,170		0.9657	
平成29年 1月末日	742,989,934		0.9593	
2月末日	733,315,285		0.9516	
3月末日	713,935,544		0.9397	
4月末日	697,684,058		0.9387	
5月末日	663,175,125		0.9622	
6月末日	627,402,036		0.9511	
7月末日	568,837,209		0.9462	

(注)分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	平成26年12月19日～平成27年 6月15日	0.0300
第2特定期間	平成27年 6月16日～平成27年12月15日	0.0000
第3特定期間	平成27年12月16日～平成28年 6月15日	0.0000
第4特定期間	平成28年 6月16日～平成28年12月15日	0.0000
第5特定期間	平成28年12月16日～平成29年 6月15日	0.0000

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（％）
第1特定期間	平成26年12月19日～平成27年 6月15日	4.3
第2特定期間	平成27年 6月16日～平成27年12月15日	10.2
第3特定期間	平成27年12月16日～平成28年 6月15日	5.9
第4特定期間	平成28年 6月16日～平成28年12月15日	14.0
第5特定期間	平成28年12月16日～平成29年 6月15日	2.6

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）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（分配落ち。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】

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1特定期間	平成26年12月19日～平成27年 6月15日	1,795,907,131	39,501,805	1,756,405,326
第2特定期間	平成27年 6月16日～平成27年12月15日	47,040,354	430,603,844	1,372,841,836
第3特定期間	平成27年12月16日～平成28年 6月15日	729,974	234,073,556	1,139,498,254
第4特定期間	平成28年 6月16日～平成28年12月15日	27,459	339,603,071	799,922,642
第5特定期間	平成28年12月16日～平成29年 6月15日	45,439,769	165,903,536	679,458,875

(注) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

< 参考情報 >

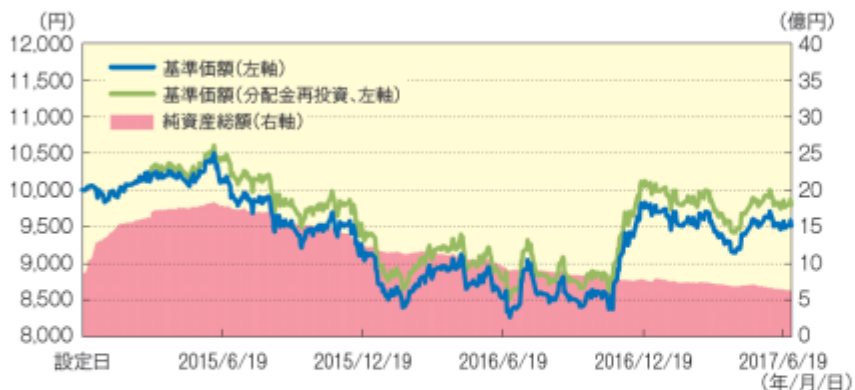
本ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

2017年6月30日現在

基準価額・純資産の推移

2014年12月19日（設定日）～2017年6月30日



- 基準価額の推移は、本ファンドの信託報酬控除後の価額です。
- 基準価額（分配金再投資）は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しています。
- 上記は過去の実績を示したものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

主要な資産の状況

■資産構成比*

組入れファンド・資産	比率
ニューバーガー・パーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー -US・ロング・ショート・エクイティ・ファンド	100.5%
あおぞら・マネー・マザーファンド	0.0%
現預金・その他	-0.5%
合計	100.0%

*比率は純資産総額に対する割合です。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

決算日	2016年6月	2016年9月	2016年12月	2017年3月	2017年6月	直近1年間累計	設定来累計
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	300円

- 収益分配金実績は、将来の分配金の水準を示唆あるいは保証するものではありません。
- 運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合や、分配金が支払われない場合があります。

年間収益率の推移（1万口当たり、税引前）



- 本ファンドの年間収益率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しています。
- 本ファンドは、ベンチマークを設定しておりませんので、本ファンド設定前の年間騰落率についての情報は記載しておりません。
- 2014年は設定日から年末までの騰落率、2017年は6月末までの騰落率です。

基準価額・純資産総額

基準価額	9,511円
純資産総額	6.27億円

期間騰落率（年率換算前）

期間	ファンド
1ヶ月	-1.2%
3ヶ月	1.2%
6ヶ月	-1.5%
1年	13.6%
3年	-
設定来	-2.1%

- 本ファンドの期間騰落率は信託報酬控除後のものです。なお、換金時の費用、税金等を考慮しておりません。
- 本ファンドの期間騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しています。また、実際の投資家利回りとは異なります。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

2017年6月30日現在

主要な資産の状況

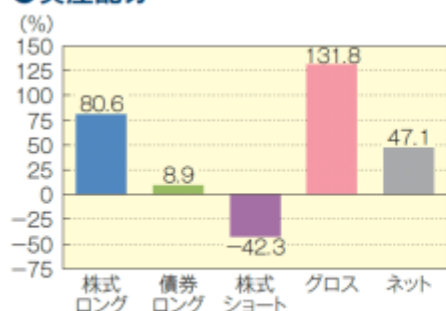
■ポートフォリオの状況

本ファンドが主要投資対象とする「ニューバーガー・バーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー -US・ロング・ショート・エクイティ・ファンド」の運用状況です。

※当頁はニューバーガー・バーマンのデータを基に委託会社で作成しています。

※各項目の比率は、組入れファンドの資産総額に対する割合です。また、各項目の比率は小数点以下第2位を四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。

●資産配分



- ポートフォリオの内容は市場環境を勘案し、機動的に変更されます。

●株式セクター配分

株式ロング(比率)	セクター	株式ショート(比率)
5.3%	エネルギー	-1.3%
2.0%	素材	0.0%
13.8%	資本財・サービス	-1.0%
13.4%	一般消費財・サービス	-7.1%
7.9%	生活必需品	-0.7%
8.7%	ヘルスケア	-0.8%
10.4%	金融	-2.9%
12.3%	情報技術	-2.1%
0.0%	電気通信サービス	0.0%
5.0%	公益事業	-1.9%
1.7%	不動産	-0.5%
0.0%	その他(先物・オプション・ETF等)	-23.9%

●株式ロング・組入上位10銘柄

(株式ロング銘柄数:83銘柄)

銘柄名	国名	業種	比率
1 ダヴィータ・ヘルスケア・パートナーズ	米国	ヘルスケア	2.6%
2 ホールフーズ・マーケット	米国	生活必需品	2.5%
3 デンツプライ・シロナ	米国	ヘルスケア	2.4%
4 ブロックフィールド・インフラストラクチャー・パートナーズ	米国	公益事業	2.3%
5 エンブリッジ	カナダ	エネルギー	2.3%
6 ホーム・デポ	米国	一般消費財・サービス	2.2%
7 VISA	米国	情報技術	2.2%
8 IHSマークイット	米国	資本財・サービス	2.0%
9 JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	米国	金融	2.0%
10 PVHコープ	米国	一般消費財・サービス	1.8%

- 国名はリスク所在国を記載しています。
- ポートフォリオの内容は市場環境を勘案し、機動的に変更されます。個別の銘柄を推奨するものではありません。

●株式ショート部分の戦略比率

戦略	比率
株式ショート	-42.3%
(ファンダメンタルズ・ショート)	-13.3%
(マーケット・ショート)	-29.0%

- 「ファンダメンタルズ・ショート」：個別銘柄を売建てる取引で、株価下落による収益獲得を目指す戦略です。
- 「マーケット・ショート」：先物、オプション、ETF等を売建てる取引で、相場全体の下落の影響を軽減することを目指す戦略です。

●債券ロング部分の戦略比率

戦略	比率
債券ロング	8.9%
(投資適格債券)	0.0%
(ハイ・イールド債券)	8.9%

●債券ロング・特性値

最低利回り	6.82%	平均残存年数	6.44年
平均格付(S&P)	B+/B	修正デュレーション	3.49年

- 最低利回りは、早期償還条項等、債券に内包されたオプション等を考慮して計算した利回りのうち、最も低いものです。
- 各種利回りは、実際の投資家利回りとは異なります。
- 修正デュレーションとは、金利の変化に対する債券の価格感応度を示す指標で、単位は「年」で表示されます。この値が長い(短い)ほど、金利の変化に対する債券価格の変動率が大きく(小さく)なります。
- 平均格付とは、基準日時点での保有債券に係る信用格付を加重平均したものであり、組入れファンドに係る信用格付ではありません。

第2【管理及び運営】

<訂正前>

1【申込（販売）手続等】

（中略）

（6）販売会社の申込手数料および申込単位の詳細については、販売会社にお問い合わせください。販売会社については、下記の照会先までお問い合わせください。

<照会先（あおぞら投信株式会社）>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-4520-3401（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

（以下略）

2【換金（解約）手続等】

（中略）

（5）解約価額および販売会社の解約単位の詳細については、販売会社にお問い合わせください。販売会社については、下記の照会先までお問い合わせください。

<照会先（あおぞら投信株式会社）>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-4520-3401（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

（以下略）

3【資産管理等の概要】

（中略）

基準価額は、原則として委託会社の営業日に日々算出され、下記の照会先または販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

なお、基準価額は便宜上、1万口当たりをもって表示されることがあります。

<照会先（あおぞら投信株式会社）>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-4520-3401（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

上記委託会社の電話番号は、平成29年5月8日より「03-6752-1051」に変更となります。

（以下略）

<訂正後>

1【申込（販売）手続等】

（中略）

（6）販売会社の申込手数料および申込単位の詳細については、販売会社にお問い合わせください。販売会社については、下記の照会先までお問い合わせください。

<照会先（あおぞら投信株式会社）>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-6752-1051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

（以下略）

2【換金（解約）手続等】

（中略）

(5) 解約価額および販売会社の解約単位の詳細については、販売会社にお問い合わせください。販売会社については、下記の照会先までお問い合わせください。

<照会先(あおぞら投信株式会社)>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-6752-1051(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

(以下略)

3【資産管理等の概要】

(中略)

基準価額は、原則として委託会社の営業日に日々算出され、下記の照会先または販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

なお、基準価額は便宜上、1万口当たりをもって表示されることがあります。

<照会先(あおぞら投信株式会社)>

委託会社のホームページアドレス：<http://www.aozora-im.co.jp/>

委託会社の電話番号：03-6752-1051(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

(以下略)

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況につきましては、以下の内容が追加されます。

<追加後>

(1) 本ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 本ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 本ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5特定期間（平成28年12月16日から平成29年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【あおぞら・USTリプルプラス・ファンド（年4回決算型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4特定期間 平成28年12月15日現在	第5特定期間 平成29年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,288,200	6,774,480
投資証券	771,520,903	639,245,320
親投資信託受益証券	99,950	99,900
未収入金	11,183,400	4,741,255
流動資産合計	789,092,453	650,860,955
資産合計		
	789,092,453	650,860,955
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	241,775	54,184
未払解約金	4,622,492	1,850,541
未払受託者報酬	54,129	47,176
未払委託者報酬	2,706,310	2,358,724
未払利息	17	18
その他未払費用	400,913	349,410
流動負債合計	8,025,636	4,660,053
負債合計		
	8,025,636	4,660,053
純資産の部		
元本等		
元本	799,922,642	679,458,875
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,855,825	33,257,973
（分配準備積立金）	10,238,899	8,212,138
元本等合計	781,066,817	646,200,902
純資産合計		
	781,066,817	646,200,902
負債純資産合計		
	789,092,453	650,860,955

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第4特定期間 自 平成28年 6月16日 至 平成28年12月15日	第5特定期間 自 平成28年12月16日 至 平成29年 6月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	10,114,302	45,868,338
為替差損益	99,509,279	59,411,984
営業収益合計	109,623,581	13,543,646
営業費用		
支払利息	7,638	3,221
受託者報酬	115,976	97,348
委託者報酬	5,798,801	4,867,407
その他費用	921,452	721,136
営業費用合計	6,843,867	5,689,112
営業利益又は営業損失（ ）	102,779,714	19,232,758
経常利益又は経常損失（ ）	102,779,714	19,232,758
当期純利益又は当期純損失（ ）	102,779,714	19,232,758
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	7,555,456	1,718,107
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	163,619,848	18,855,825
剰余金増加額又は欠損金減少額	49,543,456	4,691,856
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	49,543,456	4,691,856
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,691	1,579,353
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,691	1,579,353
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,855,825	33,257,973

(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	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券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 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物売買取相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

第4特定期間 平成28年12月15日現在	第5特定期間 平成29年 6月15日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 799,922,642口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 679,458,875口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 18,855,825円	2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 33,257,973円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9764円 (10,000口当たり純資産額) (9,764円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9511円 (10,000口当たり純資産額) (9,511円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4特定期間 自 平成28年 6月16日 至 平成28年12月15日	第5特定期間 自 平成28年12月16日 至 平成29年 6月15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 644,256円	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 540,764円
2. 分配金の計算過程 第7期 平成28年 6月16日 平成28年 9月15日 費用控除後の配当等 A 0円 収益額 費用控除後・繰越欠 B 0円 損金補填後の有価証券等損益額 収益調整金額 C 354,614円 分配準備積立金額 D 12,661,128円 本ファンドの分配対 E=A+B+C+D 13,015,742円 象収益額 本ファンドの期末残 F 989,151,216口 存口数 10,000口当たり収益 G=E/F×10,000 131円 分配対象額 10,000口当たり分配 H 0円 金額 収益分配金金額 I=F×H/10,000 0円	2. 分配金の計算過程 第9期 平成28年12月16日 平成29年 3月15日 費用控除後の配当等 A 0円 収益額 費用控除後・繰越欠 B 0円 損金補填後の有価証券等損益額 収益調整金額 C 808,710円 分配準備積立金額 D 9,194,746円 本ファンドの分配対 E=A+B+C+D 10,003,456円 象収益額 本ファンドの期末残 F 760,225,302口 存口数 10,000口当たり収益 G=E/F×10,000 131円 分配対象額 10,000口当たり分配 H 0円 金額 収益分配金金額 I=F×H/10,000 0円
第8期 平成28年 9月16日 平成28年12月15日 費用控除後の配当等 A 0円 収益額	第10期 平成29年 3月16日 平成29年 6月15日 費用控除後の配当等 A 0円 収益額

費用控除後・繰越欠	B	0円	費用控除後・繰越欠	B	0円
損金補填後の有価証券等損益額			損金補填後の有価証券等損益額		
収益調整金額	C	286,905円	収益調整金額	C	728,528円
分配準備積立金額	D	10,238,899円	分配準備積立金額	D	8,212,138円
本ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,525,804円	本ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,940,666円
本ファンドの期末残存口数	F	799,922,642口	本ファンドの期末残存口数	F	679,458,875口
10,000口当たり収益	G=E/F × 10,000	131円	10,000口当たり収益	G=E/F × 10,000	131円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0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	期別	第4特定期間 自 平成28年 6月16日 至 平成28年12月15日	第5特定期間 自 平成28年12月16日 至 平成29年 6月15日
1. 金融商品に対する取組方針		本ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク		本ファンドが保有する金融商品の種類は、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。これらは、株価変動リスク、投資証券の価格変動リスク、為替変動リスク及び金利変動等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制		委託会社では、投信管理部門において、運用パフォーマンスの評価・分析及び運用に係るリスクのモニタリングならびに関係法令・運用の基本方針等の遵守状況のモニタリングを行っております。モニタリングの結果はコンプライアンス部及び社内に設置されたリスク管理委員会に報告されます。リスク管理委員会は投信管理部門からの報告事項に対して、必要な報告聴取、調査、リスクの評価分析及び是正勧告等の監督を行っております。運用の外部委託を行う場合は、当該外部運用委託先に対し定期的に前述と同等程度の報告を義務付けることにより、リスク管理を実施しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	期別	第4特定期間 平成28年12月15日現在	第5特定期間 平成29年 6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価の差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法		有価証券 売買目的有価証券 (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。 デリバティブ取引 (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。	有価証券 売買目的有価証券 同左 デリバティブ取引 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	上記以外の金融商品	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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 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 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第4特定期間	第5特定期間
	自 平成28年 6月16日 至 平成28年12月15日	自 平成28年12月16日 至 平成29年 6月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,139,498,254円	799,922,642円
期中追加設定元本額	27,459円	45,439,769円
期中一部解約元本額	339,603,071円	165,903,536円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4特定期間	第5特定期間
	自 平成28年 6月16日 至 平成28年12月15日	自 平成28年12月16日 至 平成29年 6月15日
	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)
投資証券	13,943,149	19,882,277
親投資信託受益証券	20	20
合計	13,943,129	19,882,257

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

第4特定期間（平成28年12月15日現在）

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	10,937,825	-	11,179,600	241,775
	アメリカドル	10,937,825	-	11,179,600	241,775
合計		10,937,825	-	11,179,600	241,775

第5特定期間（平成29年 6月15日現在）

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	638,666,783	-	638,720,967	54,184
	アメリカドル	638,666,783	-	638,720,967	54,184
合計		638,666,783	-	638,720,967	54,184

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

- ・ 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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おります。
- ・ 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

(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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
日本円	親投資信託受益証券	あおぞら・マネー・マザーファンド	100,000	99,900	
日本円小計			100,000	99,900	
アメリカドル	投資証券	ニューバーガー・パーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー -US・ロング・ショート・エクイティ・ファンド	549,118.879	5,826,151.30	
アメリカドル小計			549,118.879	5,826,151.30 (639,245,320)	
合計				639,345,220 (639,245,320)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄は邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)通貨の表示は外貨については、その通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率(注)	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 1銘柄	100.0%	100.0%

(注)通貨ごとの有価証券の合計金額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及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

（参考）

本ファンドは「あおぞら・マネー・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

あおぞら・マネー・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年12月15日現在	平成29年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	100,341,148	100,290,758
流動資産合計	100,341,148	100,290,758
資産合計	100,341,148	100,290,758
負債の部		
流動負債		
未払利息	274	274
流動負債合計	274	274
負債合計	274	274
純資産の部		
元本等		
元本	100,394,643	100,394,219
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	53,769	103,735
元本等合計	100,340,874	100,290,484
純資産合計	100,340,874	100,290,484
負債純資産合計	100,341,148	100,290,758

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

平成28年12月15日現在		平成29年 6月15日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,394,643口	1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,394,219口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額		2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	
元本の欠損	53,769円	元本の欠損	103,735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		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	0.9995円	1口当たり純資産額	0.9990円
(10,000口当たり純資産額)	(9,995円)	(10,000口当たり純資産額)	(9,990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	期別	自 平成28年 6月16日 至 平成28年12月15日	自 平成28年12月16日 至 平成29年 6月15日
1. 金融商品に対する取組方針		本ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク		本ファンドが保有する金融商品の種類は、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。これらは、価格変動リスク、金利変動等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制		委託会社では、投信管理部門において、運用パフォーマンスの評価・分析及び運用に係るリスクのモニタリングならびに関係法令・運用の基本方針等の遵守状況のモニタリングを行っております。モニタリングの結果はコンプライアンス部及び社内に設置されたリスク管理委員会に報告されます。リスク管理委員会は投信管理部門からの報告事項に対して、必要な報告聴取、調査、リスクの評価分析及び是正勧告等の監督を行っております。運用の外部委託を行う場合は、当該外部運用委託先に対し定期的に前述と同等程度の報告を義務付けることにより、リスク管理を実施しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	期別	平成28年12月15日現在	平成29年 6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価の差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法		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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の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
----------------------------	---	----

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	自 平成28年 6月16日 至 平成28年12月15日	自 平成28年12月16日 至 平成29年 6月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首	平成28年 6月16日	平成28年12月16日
期首元本額	100,395,071円	100,394,643円
期末元本額	100,394,643円	100,394,219円
期中追加設定元本額	-円	-円
期中一部解約元本額	428円	424円
元本の内訳*		
あおぞら・短期ハイ・イールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	100,000円	100,000円
あおぞら・短期ハイ・イールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	100,000円	100,000円
あおぞら・U Sトリプルプラス・ファンド(年4回決算型)	100,000円	100,000円
あおぞら・世界配当成長株ベガ・ファンド(毎月分配型)	99,991円	99,991円
あおぞら・マネーファンド(適格機関投資家専用)	99,994,652円	99,994,228円

(注)*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(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)

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

該当事項はありません。

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】

あおぞら・USトリプルプラス・ファンド（年4回決算型）

平成29年7月31日現在

資産総額	1,147,938,874円
負債総額	579,101,665円
純資産総額（ - ）	568,837,209円
発行済口数	601,165,725口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9462円
（1万口当たり純資産額）	（9,462円）

（参考）あおぞら・マネー・マザーファンド

平成29年7月31日現在

資産総額	100,278,146円
負債総額	274円
純資産総額（ - ）	100,277,872円
発行済口数	100,394,219口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9988円
（1万口当たり純資産額）	（9,988円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

<訂正前>

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額	2億2,500万円
会社が発行する株式の総数	45,000株
発行済株式総数	9,000株
最近5年間における主な資本金の額の増減	
該当事項はありません。	

（中略）

2【事業の内容及び営業の概況】

（中略）

なお、平成29年1月末日現在、委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです（親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額（円）
追加型株式投資信託	19	49,689,369,866
単位型株式投資信託	5	61,877,930,237
合計	24	111,567,300,103

<訂正後>

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額	4億5,000万円
会社が発行する株式の総数	45,000株
発行済株式総数	18,000株
最近5年間における主な資本金の額の増減	
設立	平成26年2月4日
資本金	2億2,500万円
平成29年5月26日	資本金4億5,000万円に増資

（中略）

2【事業の内容及び営業の概況】

（中略）

なお、平成29年7月末日現在、委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです（親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額（円）
追加型株式投資信託	23	54,845,023,536
単位型株式投資信託	8	69,560,152,257
合計	31	124,405,175,793

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社の概況 3 委託会社等の経理状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）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。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期事業年度（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、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

期別	注記 番号	前事業年度末 (平成28年 3月31日現在)		当事業年度末 (平成29年 3月31日現在)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金	2		128,778		118,471
前払費用			2,713		3,524
未収入金	2		43,422		27,124
未収委託者報酬			57,504		61,419
流動資産計			232,418		210,540
固定資産					
有形固定資産	1		4,376		1,666
建物		4,176		44	
器具備品		199		78	
建設仮勘定		-		1,543	
固定資産計			4,376		1,666
資産合計			236,794		212,206
(負債の部)					
流動負債					
未払金			71,044		70,206
未払手数料	2	27,651		29,617	
その他未払金	2	43,392		40,588	
未払費用			2,974		2,875
未払法人税等			643		1,920
未払消費税等			5,097		12,472
預り金			9,955		26,576
資産除去債務			-		5,692
流動負債計			89,715		119,743
固定負債					
資産除去債務			7,542		-
繰延税金負債			1,169		-
固定負債計			8,712		-
負債合計			98,427		119,743
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			225,000		225,000
資本剰余金			225,000		225,000
資本準備金		225,000		225,000	
利益剰余金			311,633		357,537
その他利益剰余金					
繰越利益剰余金		311,633		357,537	
純資産合計			138,366		92,462
負債・純資産合計			236,794		212,206

(2) 【損益計算書】

期別	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)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業収益					
委託者報酬		298,400		503,215	
営業収益計			298,400		503,215
営業費用					
支払手数料	1	136,077		226,222	
支払投資顧問料		28,216		51,503	
広告宣伝費		12,139		9,128	
調査費		7,960		8,208	
委託計算費		9,736		20,181	
営業雑経費		16,346		20,432	
通信費		1,503		1,772	
印刷費		14,292		17,544	
協会費		551		1,115	
営業費用計			210,476		335,677
一般管理費					
給料	1	191,112		187,226	
役員報酬		49,442		49,327	
給料・手当		111,675		113,899	
賞与		29,994		23,999	
法定福利費	1	19,963		20,486	
交際費		783		462	
旅費交通費		7,994		9,491	
租税公課		1,446		2,819	
不動産賃借料	1	9,093		9,093	
賃借料	1	3,648		3,826	
固定資産減価償却費		3,753		2,299	
資産除去債務利息費用		109		103	
支払報酬料		7,252		7,879	
消耗品費		584		368	
保守修理費		50		55	
会議費		819		194	
保険料		250		274	
送金手数料		512		692	
一般管理費計			247,373		245,275
営業損失			159,449		77,737
営業外収益					
受取利息	1	32		5	
雑収入		5		5,097	
営業外収益計			38		5,103
經常損失			159,410		72,634
税引前当期純損失			159,410		72,634
法人税、住民税及び事業税	1		43,039		25,559
法人税等調整額			613		1,169
当期純損失			115,758		45,904

(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	純資産 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	225,000	225,000	225,000	195,874	195,874	254,125	254,125
当期変動額							
当期純損失				115,758	115,758	115,758	115,758
当期変動額合計	-	-	-	115,758	115,758	115,758	115,758
当期末残高	225,000	225,000	225,000	311,633	311,633	138,366	138,366

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	純資産 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	225,000	225,000	225,000	311,633	311,633	138,366	138,366
当期変動額							
当期純損失				45,904	45,904	45,904	45,904
当期変動額合計	-	-	-	45,904	45,904	45,904	45,904
当期末残高	225,000	225,000	225,000	357,537	357,537	92,462	92,462

重要な会計方針

1. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

建物については、定額法を採用しております。器具備品については、主に定率法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	3年
器具備品	3～5年

2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

親会社である株式会社あおぞら銀行を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

(3) 会計上の見積りの変更

当事業年度において、当社は、オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として計上していた資産除去債務について、新たな情報の入手に伴い、見積額の変更を行っております。

この見積りの変更による減少額1,954千円を、変更前の資産除去債務残高から減算しております。

なお、この変更による、当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

追加情報

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当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

	前事業年度 (平成28年 3月31日現在)	当事業年度 (平成29年 3月31日現在)
有形固定資産の減価償却累計額	4,412千円	6,711千円

2．関係会社に対する資産・負債

	前事業年度 (平成28年 3月31日現在)	当事業年度 (平成29年 3月31日現在)
流動資産		
預金	90,633千円	74,354千円
未収入金	43,422	27,124
流動負債		
未払手数料	23,974	23,101
その他未払金	35,343	31,474

（損益計算書関係）

1．関係会社に対する事項

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
支払手数料	99,921千円	129,864千円
給料	191,112	187,226
法定福利費	19,764	20,047
不動産賃借料	9,093	9,093
賃借料	2,674	2,692
受取利息	32	5
法人税、住民税及び事業税	43,422	27,124

当該金額は、連結法人税額のうち、当社の個別帰属額であり、連結納税親会社から受領する金額であります。

（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）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	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	9,000株	-	-	9,000株

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	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	9,000株	-	-	9,000株

（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

当社が事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、また、資金調達については、借入によらず、株式の発行により行う方針です。なお、デリバティブ取引は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬の基礎となる投資信託財産は、信託法により信託銀行の固有資産と分別管理されており、当該報酬は、計理上毎日の未払費用として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクはありません。また、未収入金に係る顧客の信用リスクについては、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、リスク低減を図っております。

(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には、当該価額が異なる場合もあります。

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。

前事業年度（平成28年 3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	128,778	128,778	-
(2) 未収入金	43,422	43,422	-
(3) 未収委託者報酬	57,504	57,504	-
資産計	229,704	229,704	-
(1) 未払手数料	27,651	27,651	-
(2) その他未払金	43,392	43,392	-
負債計	71,044	71,044	-

当事業年度（平成29年 3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	118,471	118,471	-
(2) 未収入金	27,124	27,124	-
(3) 未収委託者報酬	61,419	61,419	-
資産計	207,015	207,015	-
(1) 未払手数料	29,617	29,617	-
(2) その他未払金	40,588	40,588	-
負債計	70,206	70,206	-

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収入金、並びに(3) 未収委託者報酬

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

負債

(1) 未払手数料、並びに(2) その他未払金

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年 3月31日現在）（単位：千円）

	1年以内	1年超
(1) 現金・預金	128,778	-
(2) 未収入金	43,422	-
(3) 未収委託者報酬	57,504	-
合計	229,704	-

当事業年度（平成29年 3月31日現在）（単位：千円）

	1年以内	1年超
(1) 現金・預金	118,471	-
(2) 未収入金	27,124	-
(3) 未収委託者報酬	61,419	-
合計	207,015	-

(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日現在)	当事業年度 (平成29年 3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	917	887
未払賞与	10,832	9,638
資産除去債務	2,327	1,756
未払事業税	109	503
未払事業所税	42	42
繰越欠損金	30,136	36,259
減価償却超過額	70	140
繰延資産償却超過額	951	642
繰延税金資産小計	45,388	49,871
評価性引当額	45,388	49,871
繰延税金資産合計	-	-
繰延税金負債		
資産除去債務に対応する除去費用	1,169	-
繰延税金負債合計	1,169	-
繰延税金資産(負債)の純額	1,169	-

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

税引前当期純損失を計上したため記載を省略しております。

(資産除去債務関係)

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

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

オフィス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26箇月と見積り、割引率は1.471%を使用して資産除去債務の金額を算定しております。

(3) 資産除去債務の総額の増減 (単位：千円)

前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
期首残高	5,906
時の経過による調整額	109
見積りの変更による増加額	1,527
期末残高	7,542

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

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

オフィス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26箇月と見積り、割引率は1.471%を使用して資産除去債務の金額を算定しております。

(3) 資産除去債務の総額の増減 (単位：千円)

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	7,542
時の経過による調整額	103
見積りの変更による減少額	1,954
期末残高	5,692

(4) 資産除去債務の見積りの変更の内容及び影響額

オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として計上していた資産除去債務について、新たな情報の入手に伴い、見積額の変更を行っております。これによる資産除去債務の減少額は1,954千円であります。

(セグメント情報等)

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

1. セグメント情報

当社は金融商品取引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。

2. 関連情報

(1) 商品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。

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

投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。

- 3．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。
- 4．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。
- 5．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

- 1．セグメント情報
当社は金融商品取引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。
- 2．関連情報
 - (1) 商品及びサービスごとの情報
単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
 - (2) 地域ごとの情報
営業収益
投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。

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
投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。
- 3．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。
- 4．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。
- 5．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

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	資本金又は出資金 (億円)	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)
親会社	㈱あおぞら銀行	東京都千代田区	1,000	銀行業	被所有 直接 100%	従業員の受入 出向者の受入 事務代行	税額のうち連結納税親会社からの受入	43,422	未収入金	43,422
							出向者負担金	210,877	その他未払金	35,343
							代行手数料	99,921	未払手数料	23,974

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	資本金又は出資金 (億円)	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)
親会社	㈱あおぞら銀行	東京都千代田区	1,000	銀行業	被所有 直接 100%	従業員の受入 出向者の受入 事務代行	税額のうち連結納税親会社からの受入	27,124	未収入金	27,124
							出向者負担金	207,274	その他未払金	31,474
							代行手数料	129,864	未払手数料	23,101

(イ) 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	資本金又は出資金 (億円)	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	あおぞら証券㈱	東京都千代田区	30	金融商品取引業	なし	事務代行	代行手数料	34,523	未払手数料	2,984

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	資本金又は出資金 (億円)	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	あおぞら証券㈱	東京都千代田区	30	金融商品取引業	なし	事務代行	代行手数料	93,687	未払手数料	5,694

- (注) 1. 上記(ア)～(イ)の金額のうち、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. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 出向者負担金については、親会社の給料基準に基づいて金額を決定しております。
- (2) 代行手数料については、一般の取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

(株)あおぞら銀行 (東京証券取引所に上場)

(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	15,374.10円	10,273.62円
1株当たり当期純損失金額	12,862.04円	5,100.49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、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純損失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)
当期純損失(千円)	115,758	45,904
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純損失(千円)	115,758	45,904
普通株式の期中平均株式数(株)	9,000	9,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

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)

当社は、平成29年4月17日開催の臨時株主総会において、親会社である株式会社あおぞら銀行を引受先として、下記要領で募集株式を発行することを決議いたしました。

1. 募集株式の数

9,000株

2. 募集株式の払込金額

募集株式1株につき金5万円(払込総額金4億5,000万円)

3. 増加する資本金及び資本準備金に関する事項

増加する資本金の額: 2億2,500万円

増加する資本準備金の額: 2億2,500万円

4. 募集株式と引換えにする金銭の払込みの期日

平成29年5月26日(金曜日)

5. 資金の用途

資金の用途については、財務体質の強化並びに事業拡大のための戦略的な投資に充当する予定であります。

5【その他】

<訂正前>

(1) 定款の変更

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

平成28年6月14日付で、定款の目的について業務の範囲を明確にするための変更および役員任期を2年から1年とする変更を行いました。

(以下略)

<訂正後>

(1) 定款の変更

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(以下略)

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

(中略)

342,037百万円（平成28年9月末現在）

(中略)

<（ご参考）再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成28年9月末現在）

(中略)

(2) 販売会社

(平成28年9月末現在)

名 称	資本金の額	事業の内容
株式会社あおぞら銀行	100,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495百万円	

(3) 投資顧問会社

(中略)

資本金の額

2,000,200香港ドル（平成28年9月末現在）

(以下略)

<訂正後>

(1) 受託会社

(中略)

342,037百万円（平成29年3月末現在）

(中略)

<（ご参考）再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成29年3月末現在）

(中略)

(2) 販売会社

(平成29年3月末現在)

名 称	資本金の額	事業の内容
株式会社あおぞら銀行	100,000百万円	銀行法により、銀行業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495百万円	

(3) 投資顧問会社

(中略)

資本金の額

2,000,200香港ドル (平成29年3月末現在)

(以下略)

3【資本関係】

<訂正前>

(前略)

(2) 販売会社

販売会社である株式会社あおぞら銀行は、委託会社の株式を9,000株（持株比率100.0%）保有しています。

(以下略)

<訂正後>

(前略)

(2) 販売会社

販売会社である株式会社あおぞら銀行は、委託会社の株式を18,000株（持株比率100.0%）保有しています。

(以下略)

独立監査人の監査報告書

平成29年8月4日

あおぞら投信株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

公認会計士

山

田

信

之

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」に掲げられているあおぞら・USTリプルプラス・ファンド（年4回決算型）の平成28年12月16日から平成29年6月15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、あおぞら・USTリプルプラス・ファンド（年4回決算型）の平成29年6月15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

あおぞら投信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、当社が、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5月12日

あおぞら投信株式会社
取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 平 木 達 也 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 山 田 信 之 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」に掲げられているあおぞら投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第4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、あおぞら投信株式会社の平成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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成29年4月17日開催の臨時株主総会において、親会社である株式会社あおぞら銀行を引受先として、募集株式を発行することを決議した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

（注）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。