

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年3月13日

【発行者名】 パインブリッジ・インベストメンツ株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 白勢 菊夫

【本店の所在の場所】 東京都千代田区大手町一丁目3番1号 JAビル

【事務連絡者氏名】 小林 徹也

【電話番号】 03（5208）5947

【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】 パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド＜為替ヘッジあり＞
パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド＜為替ヘッジなし＞

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 各ファンド 1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当なし

1. 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年9月13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。）の記載事項の一部について訂正すべき事項が生じたため、および繰上償還の予定があるため、本訂正届出書によりこれを訂正するものです。

2. 【訂正箇所および訂正事項】

原届出書の該当事項を次の内容に訂正します。

下線部____が訂正箇所を示します。

第一部【証券情報】

（5）【申込手数料】

[訂正前]

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.24%（税抜3.0%）^{*}の率を乗じて得た額を上限として、販売会社が独自に定めるものとします。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

*消費税率が10%になった場合は、3.3%（税抜3.0%）となります。

[訂正後]

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.3%（税抜3.0%）の率を乗じて得た額を上限として、販売会社が独自に定めるものとします。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

（7）【申込期間】

[訂正前]

2019年9月14日（土）から2020年9月14日（月）まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

取得申込日がニューヨーク証券取引所休業日またはニューヨークの銀行休業日のいずれかと同じ日付の場合には、取得申込の受付を行いません。

[訂正後]

2019年9月14日（土）から2020年9月14日（月）まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

ただし、「第一部 証券情報（12）その他」に記載の通り、信託終了（繰上償還）が決定した場合、申込期間は「2020年5月15日（金）まで」となります。

取得申込日がニューヨーク証券取引所休業日またはニューヨークの銀行休業日のいずれかと同じ日付の場合には、取得申込の受付を行いません。

（12）【その他】

[訂正前]

（略）

収益分配金の受取方法により、収益分配時に収益分配金を受取る「分配金受取りコース」と、収益分配金を税引後に自動的に再投資する「分配金再投資コース」の2つのコースがあります。取得申込時にいずれかのコースをご選択ください。なお、原則として、取得申込手続完了後の申込コースの変更はできません。分配金再投資コースをお申込みの場合は、累積投資約款に基づく収益分配金の再投資に関する契約（以下「累積投資契約」または「別に定める契約」ということがあります。）を、販売会社との間で締結していただきます。（販売会社によっては、前記契約と同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定が用いられることがあります。）

[訂正後]

（略）

収益分配金の受取方法により、収益分配時に収益分配金を受取る「分配金受取りコース」と、収益分配金を税引後に自動的に再投資する「分配金再投資コース」の2つのコースがあります。取得申込時にいずれかのコースをご選択ください。なお、原則として、取得申込手続完了後の申込コースの変更はできません。分配金再投資コースをお申込みの場合は、累積投資約款に基づく収益分配金の再投資に関する契約（以下「累積投資契約」または「別に定める契約」ということがあります。）を、販売会社との間で締結していただきます。（販売会社によっては、前記契約と同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定が用いられることがあります。）

信託終了（繰上償還）の予定について

当ファンドは繰上償還を行うための手続きを行っており、2020年5月19日付で繰上償還を行う予定です。ただし、書面決議において、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる賛成が得られない場合には、繰上償還は行いません。

当ファンドのご購入に際しましては、十分にご留意ください。

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]

4. 年4回（3・6・9・12月の各15日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、利子・配当等収益（インカム収入）を中心に分配を行います。なお、将来の分配金が保証されているものではなく、分配対象額が少額の場合等、分配を行わないこともあります。

【分配のイメージ図】



上記はイメージ図であり、将来の分配金のお支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

[訂正後]

4. 年4回（3・6・9・12月の各15日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、利子・配当等収益（インカム収入）を中心に分配を行います。なお、将来の分配金が保証されているものではなく、分配対象額が少額の場合等、分配を行わないこともあります。

【分配のイメージ図】



上記はイメージ図であり、将来の分配金のお支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

繰上償還が決定した場合、償還日は「2020年5月19日（火）」となります。

（2）【ファンドの沿革】

[訂正前]

2015年7月31日 ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

[訂正後]

2015年7月31日 ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

2020年5月19日 信託の終了（予定）

(3)【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

[訂正前]

- ・資本金の額 1,000,000,000円（2019年7月末日現在）
（略）
- ・大株主の状況（2019年7月末日現在）

[訂正後]

- ・資本金の額 1,000,000,000円（2020年1月末日現在）
（略）
- ・大株主の状況（2020年1月末日現在）

2【投資方針】**(3)【運用体制】**

・委託会社の運用体制

[訂正前]

1. 投資判断

運用判断を行うにあたり、下記の図のとおり、各運用チームごと、運用チーム間、各地域内、および各地域間、テーマごと等の各種定例会議において様々な情報共有、意見交換、議論を行います。これらの情報・議論に基づき、運用部門（10名）の担当者は各ファンドの運用基本方針、各運用戦略の投資プロセスに則り、最終的な投資判断を行います。

（略）

2. パフォーマンス評価とリスク管理

・運用業務部（11名）において運用実績の分析・評価を行い、運用評価委員会に上程します。

（略）

4. 当ファンドの運用担当者に係る事項

・パインブリッジ・インベストメンツ・エルエルシー 米国MBS運用チーム

運用担当者：2名、平均運用経験年数：24年

（略）

前記の運用体制等は2019年7月末日現在のものであり、今後変更することがあります。

[訂正後]

1. 投資判断

運用判断を行うにあたり、下記の図のとおり、各運用チームごと、運用チーム間、各地域内、および各地域間、テーマごと等の各種定例会議において様々な情報共有、意見交換、議論を行います。これらの情報・議論に基づき、運用部門（11名）の担当者は各ファンドの運用基本方針、各運用戦略の投資プロセスに則り、最終的な投資判断を行います。

（略）

2. パフォーマンス評価とリスク管理

・運用業務部（9名）において運用実績の分析・評価を行い、運用評価委員会に上程します。

（略）

4. 当ファンドの運用担当者に係る事項

・パインブリッジ・インベストメンツ・エルエルシー 米国MBS運用チーム

運用担当者：2名、平均運用経験年数：25年

（略）

前記の運用体制等は2020年1月末日現在のものであり、今後変更することがあります。

3【投資リスク】

(2) 投資リスクに対する管理体制

(略)

< 参考情報 >

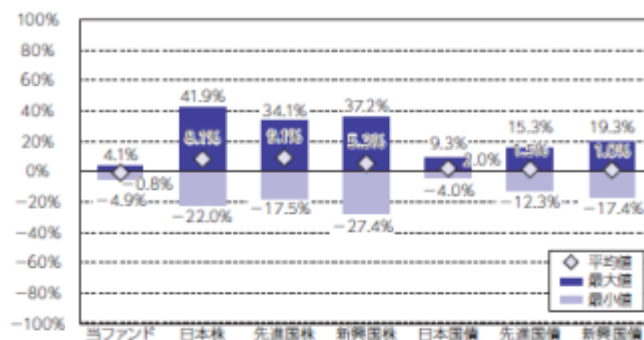
< 参考情報は以下の内容に更新・訂正されます。 >

<年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移>

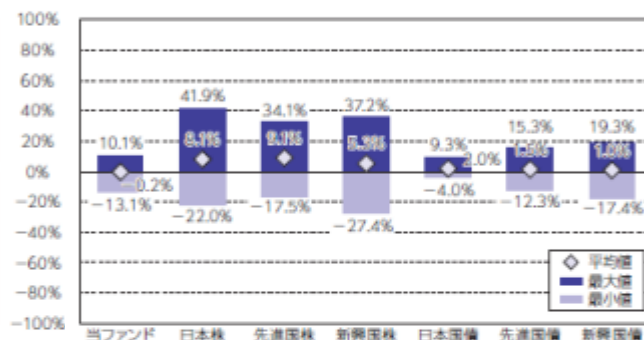
● 為替ヘッジあり



<代表的な資産クラスとの騰落率の比較>



● 為替ヘッジなし



※代表的な資産クラスとの騰落率の比較は、2015年2月～2020年1月の5年間の各月末における1年騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したもので、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。なお、すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※当ファンドは2015年7月31日設定のため、分配金再投資基準価額は2015年7月～2020年1月、当ファンドの年間騰落率および平均値・最大値・最小値は2016年7月～2020年1月の値を記載しています。

※騰落率は税引前の収益分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した騰落率とは異なる場合があります。

● 各資産クラスの指数

日 本 株：東証株価指数(TOPIX)配当込み

先進国株：MSCIコクサイ・インデックス(配当込み・円ベース)

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

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

新興国債：JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ヘッジなし・円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

東証株価指数(TOPIX)配当込みは、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み・円ベース)および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.が開発した指数で、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。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が作成している指数で、同指数に関する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ています。また、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより算出および公表されている債券指数であり、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ヘッジなし・円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出・公表する指数で、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

[訂正前]

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3.0%)^{*}の率を乗じて得た額を上限として、販売会社が独自に定めるものとします。(申込手数料は当該手数料にかかる消費税および地

方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する額を含みます。以下同じ。）詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

* 消費税率が10%になった場合は、3.3%（税抜3.0%）となります。

〔訂正後〕

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.3%（税抜3.0%）の率を乗じて得た額を上限として、販売会社が独自に定めるものとします。（申込手数料は当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する額を含みます。以下同じ。）詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

（3）【信託報酬等】

〔訂正前〕

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.1124%（税抜年1.03%）以内^{*}の率を乗じて得た額とします。信託報酬率は、毎計算期間開始日の前月末における米国の新発10年国債利回り（原則として、ブルームバーグ社発表の米国国債ジェネリック10年の終値）に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。また、委託会社、受託会社および販売会社の配分についての内訳は次の通りです。（信託報酬は当該報酬にかかる消費税等に相当する額を含みます。以下同じ。）

* 消費税率が10%になった場合は、年1.133%（税抜年1.03%）以内となります。なお、以下の内訳についても相応分上がります。

米国の新発10年国債利回り	4%未満の場合	4%以上の場合
信託報酬	0.8964% （税抜0.83%）	1.1124% （税抜1.03%）
（委託会社）	0.4320% （税抜0.40%）	0.5400% （税抜0.50%）
（販売会社）	0.4320% （税抜0.40%）	0.5400% （税抜0.50%）
（受託会社）	0.0324% （税抜0.03%）	0.0324% （税抜0.03%）

〔訂正後〕

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.133%（税抜年1.03%）以内の率を乗じて得た額とします。信託報酬率は、毎計算期間開始日の前月末における米国の新発10年国債利回り（原則として、ブルームバーグ社発表の米国国債ジェネリック10年の終値）に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。また、委託会社、受託会社および販売会社の配分についての内訳は次の通りです。（信託報酬は当該報酬にかかる消費税等に相当する額を含みます。以下同じ。）

米国の新発10年国債利回り	4%未満の場合	4%以上の場合
信託報酬	0.913% （税抜0.83%）	1.133% （税抜1.03%）
（委託会社）	0.44% （税抜0.4%）	0.55% （税抜0.5%）
（販売会社）	0.44% （税抜0.4%）	0.55% （税抜0.5%）
（受託会社）	0.033% （税抜0.03%）	0.033% （税抜0.03%）

（5）【課税上の取扱い】

〔訂正前〕

法人の受益者に対する課税

普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%の所得税が源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。

原則として、配当控除・益金不算入制度の適用はありません。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」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。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算は出来ません。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。

2020年1月1日以降の分配時において、外貨建て資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（ 略 ）

前記は2019年7月末日現在のもので、税法が改正された場合等においては、税率等の課税上の取扱いが変更になることがあります。
税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご相談されることをお勧めします。

[訂正後]

法人の受益者に対する課税

普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%の所得税が源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。

原則として、配当控除・益金不算入制度の適用はありません。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」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。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算は出来ません。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。

外貨建て資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（ 略 ）

前記は2020年1月末日現在のもので、税法が改正された場合等においては、税率等の課税上の取扱いが変更になることがあります。
税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご相談されることをお勧めします。

5【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況」について、以下の内容に更新・訂正いたします。

[更新・訂正後]

〈1〉パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジあり>**(1)【投資状況】**

(2020年1月31日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	22,811,582	97.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		655,674	2.79
合計(純資産総額)		23,467,256	100.00

(注)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合計の比率です。

(2)【投資資産】**【投資有価証券の主要銘柄】**

1.組入銘柄(2020年1月31日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	パインブリッジ 米国MBS マザーファンド	22,963,139	0.9901	22,736,218	0.9934	22,811,582	97.21

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

2.種類別及び業種別投資比率(2020年1月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.21

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】**【純資産の推移】**

	純資産総額(円)		基準価額(円)	
第1特定期間末 (2015年12月15日)	(分配付)	2,001,099	(分配付)	10,005
	(分配落)	2,001,099	(分配落)	10,005
第2特定期間末 (2016年6月15日)	(分配付)	386,112,564	(分配付)	10,222
	(分配落)	385,168,246	(分配落)	10,197
第3特定期間末 (2016年12月15日)	(分配付)	189,947,714	(分配付)	9,851
	(分配落)	188,650,697	(分配落)	9,801
第4特定期間末	(分配付)	153,877,195	(分配付)	9,897

(2017年 6月15日)	(分配落)	152,925,924	(分配落)	9,847
第5特定期間末	(分配付)	131,829,664	(分配付)	9,795
(2017年12月15日)	(分配落)	131,118,272	(分配落)	9,745
第6特定期間末	(分配付)	71,041,107	(分配付)	9,427
(2018年 6月15日)	(分配落)	70,665,564	(分配落)	9,377
第7特定期間末	(分配付)	36,240,475	(分配付)	9,315
(2018年12月17日)	(分配落)	36,000,905	(分配落)	9,265
第8特定期間末	(分配付)	35,987,335	(分配付)	9,492
(2019年 6月17日)	(分配落)	35,794,077	(分配落)	9,442
第9特定期間末	(分配付)	42,096,753	(分配付)	9,484
(2019年12月16日)	(分配落)	41,870,066	(分配落)	9,434
2019年 1月末日		35,326,909		9,347
2月末日		35,531,833		9,349
3月末日		37,151,174		9,424
4月末日		36,429,683		9,367
5月末日		36,682,634		9,432
6月末日		35,970,410		9,483
7月末日		35,985,616		9,487
8月末日		36,231,328		9,552
9月末日		46,046,111		9,497
10月末日		86,558,937		9,479
11月末日		42,011,874		9,466
12月末日		41,860,014		9,421
2020年 1月末日		23,467,256		9,451

【分配の推移】

期 間		1万口当たりの分配金
第1特定期間	自 2015年 7月31日	0円
	至 2015年12月15日	
第2特定期間	自 2015年12月16日	25円
	至 2016年 6月15日	
第3特定期間	自 2016年 6月16日	50円
	至 2016年12月15日	
第4特定期間	自 2016年12月16日	50円
	至 2017年 6月15日	
第5特定期間	自 2017年 6月16日	50円
	至 2017年12月15日	
第6特定期間	自 2017年12月16日	50円
	至 2018年 6月15日	
第7特定期間	自 2018年 6月16日	50円
	至 2018年12月17日	
第8特定期間	自 2018年12月18日	50円
	至 2019年 6月17日	

第9特定期間	自 2019年 6月18日	50円
	至 2019年12月16日	

【収益率の推移】

期 間		収益率
第1特定期間	自 2015年 7月31日	0.05%
	至 2015年12月15日	
第2特定期間	自 2015年12月16日	2.17%
	至 2016年 6月15日	
第3特定期間	自 2016年 6月16日	3.39%
	至 2016年12月15日	
第4特定期間	自 2016年12月16日	0.98%
	至 2017年 6月15日	
第5特定期間	自 2017年 6月16日	0.53%
	至 2017年12月15日	
第6特定期間	自 2017年12月16日	3.26%
	至 2018年 6月15日	
第7特定期間	自 2018年 6月16日	0.66%
	至 2018年12月17日	
第8特定期間	自 2018年12月18日	2.45%
	至 2019年 6月17日	
第9特定期間	自 2019年 6月18日	0.44%
	至 2019年12月16日	

（注）収益率は以下の計算式により算出しております。ただし、第1特定期間については前特定期間未分配落基準価額の代わりに1万口当たり当初元本額（10,000円）を用いております。

$$\text{収益率} = (\text{当特定期間未分配付基準価額} - \text{前特定期間未分配落基準価額}) \div \text{前特定期間未分配落基準価額} \times 100$$

（４）【設定及び解約の実績】

期 間		設定口数	解約口数
第1特定期間	自 2015年 7月31日	2,000,000	-
	至 2015年12月15日		
第2特定期間	自 2015年12月16日	405,582,977	29,855,764
	至 2016年 6月15日		
第3特定期間	自 2016年 6月16日	255,396,297	440,633,277
	至 2016年12月15日		
第4特定期間	自 2016年12月16日	55,027,605	92,208,052
	至 2017年 6月15日		
第5特定期間	自 2017年 6月16日	511,867,706	532,634,736
	至 2017年12月15日		
第6特定期間	自 2017年12月16日	2,726,150	61,906,095
	至 2018年 6月15日		
第7特定期間	自 2018年 6月16日	6,020,617	42,528,451
	至 2018年12月17日		

第8特定期間	自 2018年12月18日	3,586,243	4,533,025
	至 2019年 6月17日		
第9特定期間	自 2019年 6月18日	55,550,766	49,078,481
	至 2019年12月16日		

(注1) 上記はすべて本邦内における設定、解約の実績口数です。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

《2》パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジなし>

(1) 投資状況

(2020年1月31日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	20,731,823	98.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		354,447	1.68
合計(純資産総額)		21,086,270	100.00

(注) 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合計の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

1. 組入銘柄(2020年1月31日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	パインブリッジ 米国MBS マザーファンド	20,869,563	0.9901	20,662,954	0.9934	20,731,823	98.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

2. 種類別及び業種別投資比率(2020年1月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(円)	基準価額(円)
第1特定期間末 (2015年12月15日)	(分配付) 979,815 (分配落) 979,815	(分配付) 9,798 (分配落) 9,798
第2特定期間末 (2016年6月15日)	(分配付) 3,584,790 (分配落) 3,574,659	(分配付) 8,845 (分配落) 8,820
第3特定期間末 (2016年12月15日)	(分配付) 16,550,643 (分配落) 16,455,639	(分配付) 9,491 (分配落) 9,441
第4特定期間末 (2017年6月15日)	(分配付) 15,995,484 (分配落) 15,906,813	(分配付) 8,974 (分配落) 8,924
第5特定期間末 (2017年12月15日)	(分配付) 16,869,143 (分配落) 16,778,467	(分配付) 9,165 (分配落) 9,115
第6特定期間末	(分配付) 22,975,438	(分配付) 8,806

(2018年 6月15日)	(分配落)	22,842,438	(分配落)	8,756
第7特定期間末	(分配付)	20,640,058	(分配付)	9,040
(2018年12月17日)	(分配落)	20,526,006	(分配落)	8,990
第8特定期間末	(分配付)	24,042,276	(分配付)	8,983
(2019年 6月17日)	(分配落)	23,908,367	(分配落)	8,933
第9特定期間末	(分配付)	21,253,751	(分配付)	9,231
(2019年12月16日)	(分配落)	21,012,153	(分配落)	9,181
2019年 1月末日		20,024,780		8,758
2月末日		20,452,083		8,931
3月末日		24,249,735		9,039
4月末日		24,256,406		9,071
5月末日		23,979,360		8,963
6月末日		23,867,521		8,907
7月末日		36,372,779		8,991
8月末日		64,034,332		8,957
9月末日		64,725,769		9,049
10月末日		24,536,663		9,141
11月末日		21,120,831		9,208
12月末日		21,054,359		9,192
2020年 1月末日		21,086,270		9,201

分配の推移

期 間		1万口当たりの分配金
第1特定期間	自 2015年 7月31日	0円
	至 2015年12月15日	
第2特定期間	自 2015年12月16日	25円
	至 2016年 6月15日	
第3特定期間	自 2016年 6月16日	50円
	至 2016年12月15日	
第4特定期間	自 2016年12月16日	50円
	至 2017年 6月15日	
第5特定期間	自 2017年 6月16日	50円
	至 2017年12月15日	
第6特定期間	自 2017年12月16日	50円
	至 2018年 6月15日	
第7特定期間	自 2018年 6月16日	50円
	至 2018年12月17日	
第8特定期間	自 2018年12月18日	50円
	至 2019年 6月17日	
第9特定期間	自 2019年 6月18日	50円
	至 2019年12月16日	

収益率の推移

期 間		収益率
第1特定期間	自 2015年 7月31日	2.02%
	至 2015年12月15日	
第2特定期間	自 2015年12月16日	9.73%
	至 2016年 6月15日	
第3特定期間	自 2016年 6月16日	7.61%
	至 2016年12月15日	
第4特定期間	自 2016年12月16日	4.95%
	至 2017年 6月15日	
第5特定期間	自 2017年 6月16日	2.70%
	至 2017年12月15日	
第6特定期間	自 2017年12月16日	3.39%
	至 2018年 6月15日	
第7特定期間	自 2018年 6月16日	3.24%
	至 2018年12月17日	
第8特定期間	自 2018年12月18日	0.08%
	至 2019年 6月17日	
第9特定期間	自 2019年 6月18日	3.34%
	至 2019年12月16日	

(注) 収益率は以下の計算式により算出しております。ただし、第1特定期間については前特定期間末分配落基準価額の代わりに1万口当たり当初元本額(10,000円)を用いております。

$$\text{収益率} = (\text{当特定期間末分配付基準価額} - \text{前特定期間末分配落基準価額}) \div \text{前特定期間末分配落基準価額} \times 100$$

(4) 設定及び解約の実績

期 間		設定口数	解約口数
第1特定期間	自 2015年 7月31日	1,000,000	-
	至 2015年12月15日		
第2特定期間	自 2015年12月16日	3,052,679	-
	至 2016年 6月15日		
第3特定期間	自 2016年 6月16日	19,161,322	5,784,566
	至 2016年12月15日		
第4特定期間	自 2016年12月16日	839,056	443,559
	至 2017年 6月15日		
第5特定期間	自 2017年 6月16日	613,536	31,668
	至 2017年12月15日		
第6特定期間	自 2017年12月16日	11,487,016	3,806,865
	至 2018年 6月15日		
第7特定期間	自 2018年 6月16日	2,919,851	6,175,462
	至 2018年12月17日		
第8特定期間	自 2018年12月18日	4,922,390	988,713
	至 2019年 6月17日		

第9特定期間	自 2019年 6月18日	49,304,330	53,183,939
	至 2019年12月16日		

(注1) 上記はすべて本邦内における設定、解約の実績口数です。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(ご参考) パインブリッジ米国MBSマザーファンド

(1) 投資状況

(2020年1月31日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	5,817,434	4.04
特殊債券	アメリカ	133,972,689	93.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,174,294	2.90
合計(純資産総額)		143,964,417	100.00

(注) 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合計の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

1. 組入上位銘柄(2020年1月31日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3035	92,405.43	11,566.90	10,688,446	11,486.34	10,614,004	4.000	2045/8/20	7.37
アメリカ	特殊債券	FREDDIE MAC POOL Q45095	82,409.83	11,334.60	9,340,829	11,370.32	9,370,264	3.500	2046/12/1	6.51
アメリカ	特殊債券	FREDDIE MAC POOL G08676	79,488.62	11,400.04	9,061,735	11,431.47	9,086,721	3.500	2045/11/1	6.31
アメリカ	特殊債券	FREDDIE MAC POOL G07998	59,822.72	11,833.00	7,078,828	11,888.10	7,111,785	4.500	2044/7/1	4.94
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL AL1715	60,864.12	11,217.91	6,827,683	11,237.51	6,839,616	3.000	2027/5/1	4.75
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL BC0326	59,092.93	11,385.86	6,728,240	11,416.99	6,746,635	3.500	2045/12/1	4.69
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL MA3612	58,634.85	11,350.96	6,655,621	11,397.89	6,683,136	4.000	2039/3/1	4.64
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3375	54,096.38	11,282.25	6,103,292	11,318.65	6,122,983	3.000	2046/1/20	4.25
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,000	10,712.58	5,677,670	10,976.29	5,817,434	1.625	2029/8/15	4.04
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3523	47,257.02	11,625.79	5,494,005	11,719.16	5,538,126	4.500	2046/3/20	3.85
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3736	47,904.56	11,361.87	5,442,854	11,374.34	5,448,828	3.500	2046/6/20	3.78
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL AL7685	42,304.95	12,092.57	5,115,756	12,140.88	5,136,196	4.500	2045/8/1	3.57
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL MA3058	43,848.24	11,413.12	5,004,456	11,483.04	5,035,112	4.000	2047/7/1	3.50
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3376	42,939.34	11,386.95	4,889,483	11,431.81	4,908,745	3.500	2046/1/20	3.41
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3310	42,001.97	11,409.85	4,792,365	11,432.44	4,801,854	3.500	2045/12/20	3.34
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3309	41,329.16	11,268.07	4,657,002	11,305.18	4,672,338	3.000	2045/12/20	3.25

アメリカ	特殊債券	FREDDIE MAC POOL G08687	37,225.77	11,400.04	4,243,753	11,431.22	4,255,360	3.500	2046/1/1	2.96
アメリカ	特殊債券	FREDDIE MAC POOL A85070	33,529.37	11,937.70	4,002,637	11,982.43	4,017,634	4.500	2039/3/1	2.79
アメリカ	特殊債券	FREDDIE MAC POOL Q34871	32,670.43	11,444.75	3,739,050	11,511.95	3,761,006	3.500	2045/7/1	2.61
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3243	31,036.93	11,268.07	3,497,265	11,305.45	3,508,865	3.000	2045/11/20	2.44
アメリカ	特殊債券	FREDDIE MAC POOL G08700	23,558.97	11,574.53	2,726,842	11,629.22	2,739,726	4.500	2046/3/1	1.90
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA5817	21,568.26	11,314.96	2,440,442	11,292.64	2,435,628	4.000	2049/3/20	1.69
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL MA3496	19,641.65	11,516.73	2,262,076	11,571.75	2,272,883	4.500	2048/10/1	1.58
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA2960	18,820.08	11,268.07	2,120,661	11,348.63	2,135,822	3.000	2045/7/20	1.48
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL MA3155	18,013.44	11,232.09	2,023,286	11,287.92	2,033,343	3.000	2032/10/1	1.41
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL AS4377	15,975	11,717.40	1,871,856	11,811.08	1,886,821	4.000	2045/2/1	1.31
アメリカ	特殊債券	FGLMC POOL G60145	14,372.21	11,497.09	1,652,387	11,548.25	1,659,739	3.500	2045/8/1	1.15
アメリカ	特殊債券	FANNIE MAE POOL MA2956	12,722.07	11,209.31	1,426,057	11,251.29	1,431,397	3.000	2047/4/1	0.99
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA3175	8,611.9	11,651.96	1,003,456	11,784.24	1,014,847	4.500	2045/10/20	0.70
アメリカ	特殊債券	GINNIE MAE POOL MA5192	7,685.15	11,365.12	873,427	11,346.28	871,979	4.000	2048/5/20	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価額の比率です。

2. 種類別投資比率（2020年1月31日現在）

種類	投資比率（%）
国債証券	4.04
特殊債券	93.06
合計	97.10

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

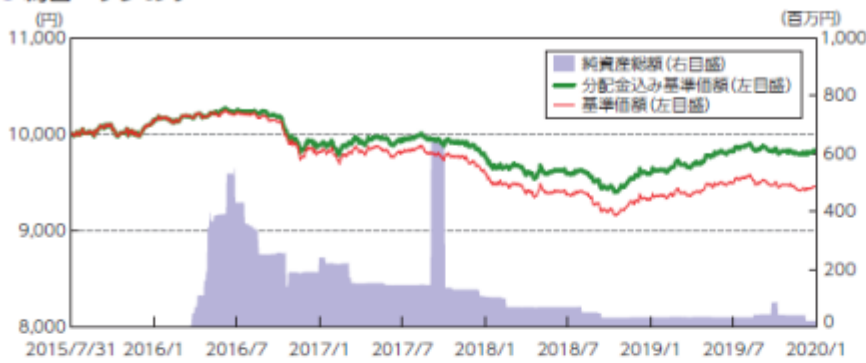
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

基準価額・純資産の推移 (設定日～2020年1月末)

● 為替ヘッジあり



(2020年1月末現在)

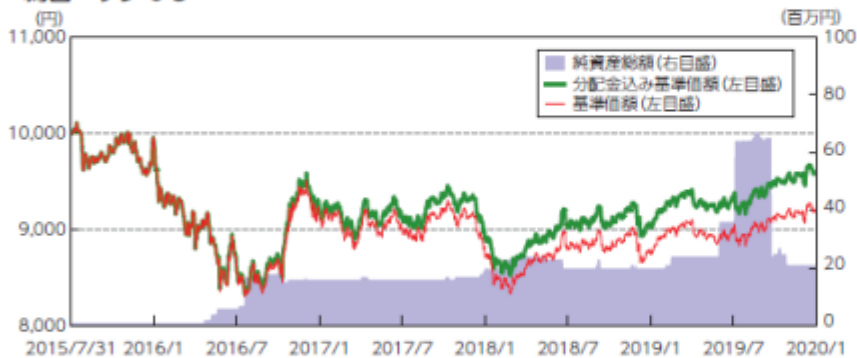
基準価額

9,451円

純資産総額

23百万円

● 為替ヘッジなし



(2020年1月末現在)

基準価額

9,201円

純資産総額

21百万円

※上記の分配金込み基準価額は、過去に支払われた分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

分配の推移 (1万口あたり、課税前)

● 為替ヘッジあり

2019年12月	25円	2019年6月	25円	2018年12月	25円
2019年9月	25円	2019年3月	25円	設定来累計	375円

● 為替ヘッジなし

2019年12月	25円	2019年6月	25円	2018年12月	25円
2019年9月	25円	2019年3月	25円	設定来累計	375円

主要な資産の状況

(2020年1月末現在)

● 為替ヘッジあり

パインブリッジ米国 MBS マザーファンド	97.21%
キャッシュ等	2.79%

● 為替ヘッジなし

パインブリッジ米国 MBS マザーファンド	98.32%
キャッシュ等	1.68%

● パインブリッジ米国 MBS マザーファンドの主要な資産の状況

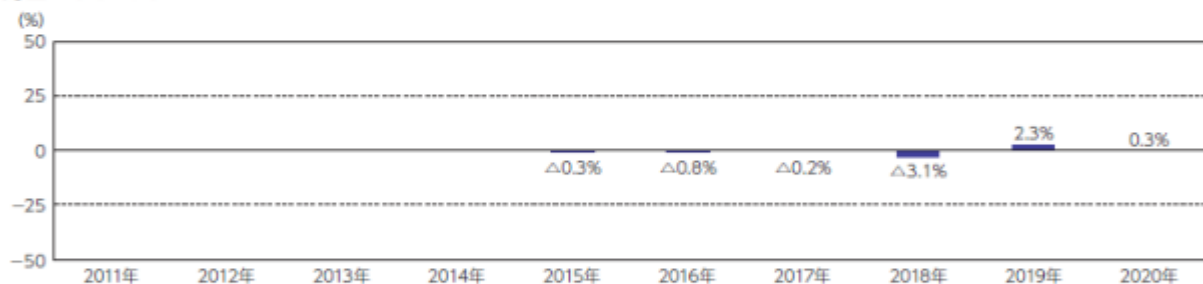
国名	銘柄名	クーポン(%)	償還日	投資比率 (%)
アメリカ	GINNIE MAE POOL MA3035	4.000	2045/ 8 /20	7.37
アメリカ	FREDDIE MAC POOL Q45095	3.500	2046/12/ 1	6.51
アメリカ	FREDDIE MAC POOL G08676	3.500	2045/11/ 1	6.31
アメリカ	FREDDIE MAC POOL G07998	4.500	2044/ 7 / 1	4.94
アメリカ	FANNIE MAE POOL AL1715	3.000	2027/ 5 / 1	4.75
アメリカ	FANNIE MAE POOL BC0326	3.500	2045/12/ 1	4.69
アメリカ	FANNIE MAE POOL MA3612	4.000	2039/ 3 / 1	4.64
アメリカ	GINNIE MAE POOL MA3375	3.000	2046/ 1 /20	4.25
アメリカ	US TREASURY N/B	1.625	2029/ 8 /15	4.04
アメリカ	GINNIE MAE POOL MA3523	4.500	2046/ 3 /20	3.85

※投資比率はマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

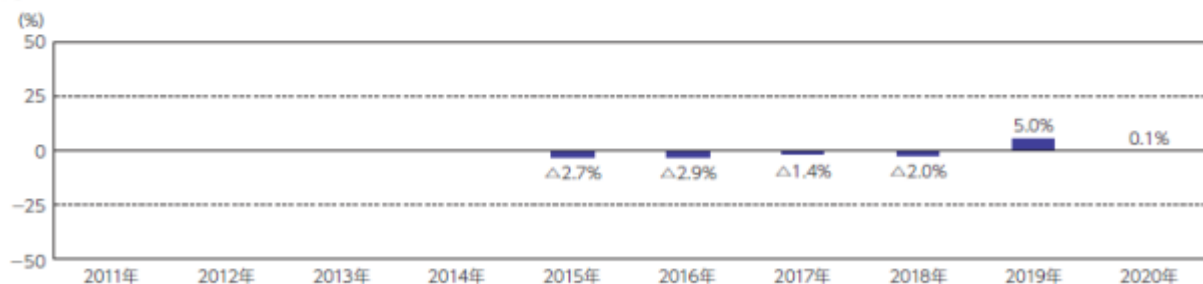
年間収益率の推移

(過去10年間/暦年ベース)

● 為替ヘッジあり



● 為替ヘッジなし



※ファンドの収益率は分配金込み基準価額を基に算出しています。また、2015年は設定日(7月31日)から年末まで、2020年は年初から1月末までの騰落率を表示しています。なお、当ファンドにはベンチマークはありません。

**前記は過去の実績であり、将来の投資成果等をお約束するものではありません。
最新の運用状況は、委託会社または販売会社のホームページ等でご確認いただけます。**

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

[訂正前]

1) 取得申込の受付

取得申込期間：2019年9月14日（土）から2020年9月14日（月）まで

取得申込は、取得申込期間中の販売会社の営業日に受付けます。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所休業日またはニューヨークの銀行休業日のいずれかと同じ日付の場合には取得申込の受付を行いません。

（略）

2) 申込単位・申込価額

申込単位は販売会社が定めるものとします。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

受益権の申込価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、当該基準価額に3.24%（税抜

3.0%）^{*}を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める申込手数料を加算した価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

*消費税率が10%になった場合は、3.3%（税抜3.0%）となります。

[訂正後]

1) 取得申込の受付

取得申込期間：2019年9月14日（土）から2020年9月14日（月）まで

取得申込は、取得申込期間中の販売会社の営業日に受付けます。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所休業日またはニューヨークの銀行休業日のいずれかと同じ日付の場合には取得申込の受付を行いません。

「第一部 証券情報（12）その他」に記載の通り、信託終了（繰上償還）が決定した場合、取得申込の受付は「2020年5月15日（金）まで」となります。

（略）

2) 申込単位・申込価額

申込単位は販売会社が定めるものとします。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

受益権の申込価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、当該基準価額に3.3%（税抜3.0%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める申込手数料を加算した価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

3【資産管理等の概要】

(3)【信託期間】

[訂正前]

2015年7月31日（金）から2025年7月31日（木）までとします。

[訂正後]

2015年7月31日（金）から2025年7月31日（木）までとします。

「第一部 証券情報（12）その他」に記載の通り、信託終了（繰上償還）が決定した場合、信託期間は「2020年5月19日（火）まで」となります。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

[更新・訂正後]

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9特定期間（2019年6月18日から2019年12月16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】

【パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジあり>】

(1)【貸借対照表】

区分	注記 事項	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,363,578	576,673
親投資信託受益証券		34,793,551	41,393,188
派生商品評価勘定		-	111,510
未収入金		-	13,140
流動資産合計		36,157,129	42,094,511
資産合計		36,157,129	42,094,511
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		184,000	-
未払収益分配金		94,770	110,951
未払受託者報酬		3,043	4,110
未払委託者報酬		81,238	109,384
未払利息		1	-
流動負債合計		363,052	224,445
負債合計		363,052	224,445
純資産の部			
元本等			
元本		37,908,195	44,380,480
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		2,114,118	2,510,414
(分配準備積立金)		718,488	492,596
元本等合計		35,794,077	41,870,066
純資産合計		35,794,077	41,870,066
負債純資産合計		36,157,129	42,094,511

(2)【損益及び剰余金計算書】

区分	注記 事項	第8特定期間	第9特定期間
		自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日
		金額（円）	金額（円）
営業収益			
有価証券売買等損益		138,273	1,579,637
為替差損益		901,810	1,181,052
営業収益合計		1,040,083	398,585
営業費用			
支払利息		324	150
受託者報酬		5,820	7,090
委託者報酬		155,361	188,664
その他費用		-	10,800
営業費用合計		161,505	206,704
営業利益又は営業損失（ ）		878,578	191,881
経常利益又は経常損失（ ）		878,578	191,881
当期純利益又は当期純損失（ ）		878,578	191,881
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（ ）		31,669	36,077
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,854,072	2,114,118
剰余金増加額又は欠損金減少額		320,037	2,605,113
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		320,037	2,605,113
剰余金減少額又は欠損金増加額		233,734	2,930,526
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		233,734	2,930,526
分配金		193,258	226,687
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,114,118	2,510,414

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	
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、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 為替予約の評価は、原則として、我が国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前特定期間末日を2019年6月17日としており、2019年12月15日が休日のため、当特定期間末日を2019年12月16日としており、このため当特定期間は182日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
1. 期首元本額	38,854,977円	37,908,195円
期中追加設定元本額	3,586,243円	55,550,766円
期中一部解約元本額	4,533,025円	49,078,481円
2. 受益権の総数	37,908,195口	44,380,480口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,114,118円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,510,414円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8特定期間	第9特定期間
	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日
1. 投資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場合における当該委託に要する費用	58,869円	64,612円
2. 分配金の計算過程	[2018年12月18日から 2019年 3月15日まで の計算期間]	[2019年6月18日から 2019年9月17日まで の計算期間]
費用控除後の配当等収益額	244,951円	204,459円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	0円
収益調整金額	1,397,036円	1,848,188円
分配準備積立金額	440,015円	686,651円
当ファンドの分配対象収益額	2,082,002円	2,739,298円
当ファンドの期末残存口数	39,395,292口	46,294,628口
1万口当たり収益分配対象額	528.49円	591.70円
1万口当たり分配金額	25.00円	25.00円
収益分配金金額	98,488円	115,736円
	[2019年3月16日から 2019年6月17日まで の計算期間]	[2019年 9月18日から 2019年12月16日まで の計算期間]
費用控除後の配当等収益額	249,321円	226,705円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	0円
収益調整金額	1,344,715円	2,177,264円
分配準備積立金額	563,937円	376,842円
当ファンドの分配対象収益額	2,157,973円	2,780,811円
当ファンドの期末残存口数	37,908,195口	44,380,480口
1万口当たり収益分配対象額	569.26円	626.58円
1万口当たり分配金額	25.00円	25.00円
収益分配金金額	94,770円	110,951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	第8特定期間 自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	第9特定期間 自 2019年 6月18日 至 2019年12月16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、投資信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対する投資として運用することを目的としています。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する主な金融資産は、親投資信託受益証券、金銭債権及びデリバティブ取引により生じる正味の債権等であり、金融負債は、金銭債務及びデリバティブ取引により生じる正味の債務等であります。 当該金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクがあります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<ul style="list-style-type: none"> ・ 運用業務部において運用実績の分析・評価を行い、運用評価委員会に上程します。 ・ 法務コンプライアンス部において運用業務の考査および諸法令等の遵守状況に関する監理を行い、必要に応じて指導、勧告を行うとともに、内部統制委員会に報告します。 ・ 運用評価委員会および内部統制委員会において、パフォーマンス評価と法令等の遵守状況の審査が行われます。 	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」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) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、「（デリバティブ取引等に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左
4. 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	貸借対照表に計上している金銭債権は、その全額が1年以内に償還されます。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
	最終の計算期間の損益 に含まれた評価差額	最終の計算期間の損益 に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	188,780	668,912
合計	188,780	668,912

（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

区分	種類	第8特定期間(2019年6月17日現在)			
		契約額等 (円)	うち1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米国ドル	34,523,200	-	34,707,200	184,000
合計		34,523,200	-	34,707,200	184,000

区分	種類	第9特定期間(2019年12月16日現在)			
		契約額等 (円)	うち1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米国ドル	41,385,330	-	41,273,820	111,510
合計		41,385,330	-	41,273,820	111,510

(注)時価の算定方法

1. 特定期間末日に対顧客先物売買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います。

特定期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買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います。

特定期間末日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
- ・ 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物売買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売買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売買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電信売買相場の仲値で評価しています。
3. 換算において円未満の端数は切り捨てています。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

項目	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
1口当たり純資産額	0.9442円	0.9434円
(1万口当たり純資産額)	(9,442円)	(9,434円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表（2019年12月16日現在）

(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	パインブリッジ米国MBSマザーファンド	41,807,079	41,393,188	
合計			41,807,079	41,393,188	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額の数値は証券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

「(3)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。

【パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジなし>】

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 事項	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		161,275	497,210
親投資信託受益証券		23,869,477	20,662,954
流動資産合計		24,030,752	21,160,164
資産合計		24,030,752	21,160,164
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		66,912	57,213
未払受託者報酬		1,995	3,282
未払委託者報酬		53,478	87,516
流動負債合計		122,385	148,011
負債合計		122,385	148,011
純資産の部			
元本等			
元本		26,765,017	22,885,408
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		2,856,650	1,873,255
(分配準備積立金)		1,504,254	590,262
元本等合計		23,908,367	21,012,153
純資産合計		23,908,367	21,012,153
負債純資産合計		24,030,752	21,160,164

(2)【損益及び剰余金計算書】

区分	注記 事項	第8特定期間	第9特定期間
		自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日
		金額（円）	金額（円）
営業収益			
有価証券売買等損益		75,496	1,393,477
営業収益合計		75,496	1,393,477
営業費用			
支払利息		8	59
受託者報酬		3,586	7,213
委託者報酬		95,882	192,395
営業費用合計		99,476	199,667
営業利益又は営業損失（ ）		23,980	1,193,810
経常利益又は経常損失（ ）		23,980	1,193,810
当期純利益又は当期純損失（ ）		23,980	1,193,810
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（ ）		1,722	202,172
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,305,334	2,856,650
剰余金増加額又は欠損金減少額		99,464	5,092,005
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		99,464	5,092,005
剰余金減少額又は欠損金増加額		491,169	4,858,650
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		491,169	4,858,650
分配金		133,909	241,598
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,856,650	1,873,255

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	
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、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. 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 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前特定期間末日を2019年6月17日としており、2019年12月15日が休日のため、当特定期間末日を2019年12月16日としており、このため当特定期間は182日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
1. 期首元本額	22,831,340円	26,765,017円
期中追加設定元本額	4,922,390円	49,304,330円
期中一部解約元本額	988,713円	53,183,939円
2. 受益権の総数	26,765,017口	22,885,408口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,856,650円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,873,255円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8特定期間	第9特定期間
	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日
1. 投資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場合における当該委託に要する費用	37,790円	65,998円
2. 分配金の計算過程	[2018年12月18日から 2019年 3月15日まで の計算期間]	[2019年6月18日から 2019年9月17日まで の計算期間]
費用控除後の配当等収益額	139,395円	337,950円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	0円
収益調整金額	2,021,827円	8,290,924円
分配準備積立金額	1,350,204円	1,503,551円
当ファンドの分配対象収益額	3,511,426円	10,132,425円
当ファンドの期末残存口数	26,798,812口	73,754,080口
1万口当たり収益分配対象額	1,310.29円	1,373.81円
1万口当たり分配金額	25.00円	25.00円
収益分配金金額	66,997円	184,385円
	[2019年3月16日から 2019年6月17日まで の計算期間]	[2019年 9月18日から 2019年12月16日まで の計算期間]
費用控除後の配当等収益額	153,864円	125,735円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	47,508円
収益調整金額	2,022,857円	2,616,400円
分配準備積立金額	1,417,302円	474,232円
当ファンドの分配対象収益額	3,594,023円	3,263,875円
当ファンドの期末残存口数	26,765,017口	22,885,408口
1万口当たり収益分配対象額	1,342.80円	1,426.18円
1万口当たり分配金額	25.00円	25.00円
収益分配金金額	66,912円	57,213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	第8特定期間 自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	第9特定期間 自 2019年 6月18日 至 2019年12月16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、投資信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対する投資として運用することを目的としています。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する主な金融資産は、親投資信託受益証券、金銭債権及びデリバティブ取引により生じる正味の債権等であり、金融負債は、金銭債務及びデリバティブ取引により生じる正味の債務等であります。 当該金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクがあります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<ul style="list-style-type: none"> ・ 運用業務部において運用実績の分析・評価を行い、運用評価委員会に上程します。 ・ 法務コンプライアンス部において運用業務の考査および諸法令等の遵守状況に関する監理を行い、必要に応じて指導、勧告を行うとともに、内部統制委員会に報告します。 ・ 運用評価委員会および内部統制委員会において、パフォーマンス評価と法令等の遵守状況の審査が行われます。 	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」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) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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
4. 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	貸借対照表に計上している金銭債権は、その全額が1年以内に償還されます。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
	最終の計算期間の損益 に含まれた評価差額	最終の計算期間の損益 に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	129,510	396,521
合計	129,510	396,521

(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。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

項目	第8特定期間 (2019年6月17日現在)	第9特定期間 (2019年12月16日現在)
1口当たり純資産額	0.8933円	0.9181円
(1万口当たり純資産額)	(8,933円)	(9,181円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表（2019年12月16日現在）

(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	パインブリッジ米国MBSマザーファンド	20,869,563	20,662,954	
合計			20,869,563	20,662,954	

(注)親投資信託受益証券における券面総額の数値は証券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。

[次へ](#)

（参考）

当ファンドは「パインブリッジ米国MBSマザーファンド」の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、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、同マザーファンドの状況は次の通りです。

「パインブリッジ米国MBSマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外です。

(1) 貸借対照表

区分	注記事項	(2019年6月17日現在)	(2019年12月16日現在)
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		1,550,106	295,491
コール・ローン		471,651	793,495
国債証券		4,888,178	6,728,968
特殊債券		153,631,723	153,747,923
未収入金		1,761,309	3,537,736
未収利息		583,790	536,010
前払費用		14,565	13,800
流動資産合計		162,901,322	165,653,423
資産合計		162,901,322	165,653,423
負債の部			
流動負債			
未払利息		-	1
流動負債合計		-	1
負債合計		-	1
純資産の部			
元本等			
元本		169,976,476	167,302,658
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		7,075,154	1,649,236
元本等合計		162,901,322	165,653,422
純資産合計		162,901,322	165,653,422
負債純資産合計		162,901,322	165,653,423

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年6月16日から12月15日まで、および12月16日から翌年6月15日までであります。

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・特殊債券 個別法に基づき、原則として金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない。）または価格情報会社の提供する価額で時価評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、我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.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年6月17日現在)	(2019年12月16日現在)
1.期首元本額	192,197,387円	169,976,476円
期中追加設定元本額	5,229,726円	97,583,769円
期中一部解約元本額	27,450,637円	100,257,587円
元本の内訳		
ファンド名		
パインブリッジ・イレブンプラス<毎月決算型>	108,767,139円	104,626,016円
パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジあり>	36,303,789円	41,807,079円
パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジなし>	24,905,548円	20,869,563円
合計	169,976,476円	167,302,658円
2.受益権の総数	169,976,476口	167,302,658口
3.元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,075,154円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,649,236円であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16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、投資信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対する投資として運用することを目的としています。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する主な金融資産は、国債証券、特殊債券、金銭債権及びデリバティブ取引により生じる正味の債権等であり、金融負債は、金銭債務及びデリバティブ取引により生じる正味の債務等であります。 当該金融商品は、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクがあります。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	<ul style="list-style-type: none"> ・運用業務部において運用実績の分析・評価を行い、運用評価委員会に上程します。 ・法務コンプライアンス部において運用業務の考査および諸法令等の遵守状況に関する監理を行い、必要に応じて指導、勧告を行うとともに、内部統制委員会に報告します。 ・運用評価委員会および内部統制委員会において、パフォーマンス評価と法令等の遵守状況の審査が行われます。 	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2019年6月17日現在)	(2019年12月16日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」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) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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
4. 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	貸借対照表に計上している金銭債権は、その全額が1年以内に償還されます。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	(2019年6月17日現在)	(2019年12月16日現在)
	当計算期間の損益 に含まれた評価差額	当計算期間の損益 に含まれた評価差額
国債証券	95,271	1,307
特殊債券	4,611,422	1,772,662
合計	4,706,693	1,771,355

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における監査対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

（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。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

項目	(2019年6月17日現在)	(2019年12月16日現在)
1口当たり純資産額	0.9584円	0.9901円
(1万口当たり純資産額)	(9,584円)	(9,901円)

(3)附属明細表

第1 有価証券明細表（2019年12月16日現在）

(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
米国ドル	国債証券	US TREASURY N/B 2.3750% 05/15/2029	9,000.00	9,431.01	
		US TREASURY N/B 1.6250% 08/15/2029	53,000.00	52,060.07	
	計		62,000.00	61,491.08	
				(6,728,968)	
	特殊債券	FANNIE MAE POOL AL1715 3.0000% 05/01/2027	63,048.67	64,857.25	
		FANNIE MAE POOL AL7685 4.5000% 08/01/2045	42,940.44	47,613.55	
		FANNIE MAE POOL AS4377 4.0000% 02/01/2045	16,244.51	17,454.35	
		FANNIE MAE POOL AS6005 3.5000% 10/01/2045	3,646.28	3,847.61	
		FANNIE MAE POOL BC0326 3.5000% 12/01/2045	60,095.53	62,742.31	
		FANNIE MAE POOL MA3058 4.0000% 07/01/2047	45,007.06	47,100.53	
		FANNIE MAE POOL MA3155 3.0000% 10/01/2032	18,358.19	18,907.48	
		FANNIE MAE POOL MA3496 4.5000% 10/01/2048	20,398.90	21,542.69	
		FANNIE MAE POOL MA3612 4.0000% 03/01/2039	60,307.87	62,772.44	
		FANNIE MAE POOL MA3663 3.5000% 05/01/2049	61,379.12	63,108.51	
		FG POOL G08583 4.5000% 04/01/2044	5,686.93	6,120.49	
		FGLMC POOL G60145 3.5000% 08/01/2045	14,629.72	15,423.23	
		FREDDIE MAC POOL A85070 4.5000% 03/01/2039	33,808.42	37,008.15	
		FREDDIE MAC POOL G07998 4.5000% 07/01/2044	60,396.77	65,536.01	
		FREDDIE MAC POOL G08653 3.0000% 07/01/2045	100,534.71	103,144.07	
		FREDDIE MAC POOL G08676 3.5000% 11/01/2045	80,887.92	84,559.60	
		FREDDIE MAC POOL G08687 3.5000% 01/01/2046	38,006.49	39,730.86	
		FREDDIE MAC POOL G08700 4.5000% 03/01/2046	24,011.25	25,485.14	
		FREDDIE MAC POOL Q34871 3.5000% 07/01/2045	32,916.60	34,544.48	
		FREDDIE MAC POOL Q45095 3.5000% 12/01/2046	83,915.82	87,215.78	
		GINNIE MAE POOL MA2960 3.0000% 07/20/2045	19,156.88	19,794.20	
		GINNIE MAE POOL MA2962 4.0000% 07/20/2045	6,630.41	7,032.74	
		GINNIE MAE POOL MA3035 4.0000% 08/20/2045	94,570.86	100,309.39	
		GINNIE MAE POOL MA3175 4.5000% 10/20/2045	8,776.51	9,377.53	
		GINNIE MAE POOL MA3243 3.0000% 11/20/2045	31,522.24	32,570.94	
		GINNIE MAE POOL MA3309 3.0000% 12/20/2045	42,091.33	43,491.64	
		GINNIE MAE POOL MA3310 3.5000% 12/20/2045	42,938.11	44,926.05	
	GINNIE MAE POOL MA3375 3.0000% 01/20/2046	55,039.64	56,939.51		
	GINNIE MAE POOL MA3376 3.5000% 01/20/2046	43,947.67	45,890.09		
	GINNIE MAE POOL MA3523 4.5000% 03/20/2046	48,563.44	51,769.77		
	GINNIE MAE POOL MA3736 3.5000% 06/20/2046	49,072.49	51,126.44		
	GINNIE MAE POOL MA5192 4.0000% 05/20/2048	8,053.10	8,392.72		
	GINNIE MAE POOL MA5817 4.0000% 03/20/2049	23,760.75	24,653.24		
	計		1,340,344.63	1,404,988.79	
				(153,747,923)	
小計				1,466,479.87	
				(160,476,891)	
合計				160,476,891	
				(160,476,891)	

- (注)1.通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計欄の記載は邦貨額であり、()内は外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米国ドル	国債証券	2銘柄	100.0%
	特殊債券	33銘柄	

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】

〈1〉パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジあり>

(2020年1月31日現在)

資産総額	45,841,769 円
負債総額	22,374,513 円
純資産総額 (-)	23,467,256 円
発行済数量 (口)	24,830,388 口
1口当たり純資産額 (/)	0.9451 円
(1万口当たりの純資産額)	(9,451 円)

(注) の資産には、有価証券の評価損益が含まれています。(以下同じ。)

〈2〉パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジなし>

(2020年1月31日現在)

資産総額	21,110,435 円
負債総額	24,165 円
純資産総額 (-)	21,086,270 円
発行済数量 (口)	22,917,574 口
1口当たり純資産額 (/)	0.9201 円
(1万口当たりの純資産額)	(9,201 円)

(ご参考)パインブリッジ米国MBSマザーファンド

(2020年1月31日現在)

資産総額	143,964,418 円
負債総額	1 円
純資産総額 (-)	143,964,417 円
発行済数量 (口)	144,923,721 口
1口当たり純資産額 (/)	0.9934 円
(1万口当たりの純資産額)	(9,934 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]

(2019年7月末日現在)

[訂正後]

(2020年1月末日現在)

2【事業の内容及び営業の概況】

[訂正前]

委託会社の運用する証券投資信託は、2019年7月末日現在、次の通りです。（ただし、親投資信託を除きます。）

種類	本数	純資産総額
単位型株式投資信託	<u>30</u>	<u>72,399</u> 百万円
追加型株式投資信託	<u>62</u>	<u>262,333</u> 百万円
合計	<u>92</u>	<u>334,732</u> 百万円

[訂正後]

委託会社の運用する証券投資信託は、2020年1月末日現在、次の通りです。（ただし、親投資信託を除きます。）

種類	本数	純資産総額
単位型株式投資信託	<u>19</u>	<u>61,409</u> 百万円
追加型株式投資信託	<u>64</u>	<u>289,269</u> 百万円
合計	<u>83</u>	<u>350,678</u> 百万円

3【委託会社等の経理状況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 3 委託会社等の経理状況」について、以下の内容に更新・訂正いたします。

[更新・訂正後]

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。

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

2. 記載金額は千円未満を切捨てて表示しております。

3. 当社は、第34期事業年度（2018年1月1日から2018年12月31日まで）の財務諸表について、金融商品取引法第193条の2第1項の規定により、EY新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

また、第35期事業年度に係る中間会計期間（2019年1月1日から2019年6月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定により、EY新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (平成29年12月31日現在)		第34期 (平成30年12月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	*2	887,338		1,425,655
前払金		-		4,981
前払費用		32,849		21,225
未収入金		234,786		135,017
未収委託者報酬		670,737		457,570
未収運用受託報酬		253,439		329,213
繰延税金資産		-		85,444
未収還付法人税等		-		67,765
未収還付消費税等		-		30,254
立替金		8,963		14,880
流動資産合計		2,088,114		2,572,009
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	*1	36,172	*1	30,647
工具器具備品	*1	5,615	*1	7,041
有形固定資産合計		41,787		37,688
無形固定資産				
ソフトウェア		1,758		1,360
電話加入権		3,875		3,875
無形固定資産合計		5,634		5,235
投資その他の資産				
投資有価証券		87,915		2,770
関係会社株式		164,013		164,013
敷金保証金		98,648		109,117
預託金		74		74
投資その他の資産合計		350,651		275,976
固定資産合計		398,073		318,900
資産合計		2,486,188		2,890,910

(単位:千円)

	第33期 (平成29年12月31日現在)	第34期 (平成30年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	16,501	23,342
未払金		
未払収益分配金	1,692	240
未払償還金	3,500	-
未払手数料	318,692	172,561
その他未払金	186,770	227,732
未払費用	759,507	605,315
未払役員賞与	97,925	72,006
前受収益	893	-
未払法人税等	3,765	25,132
未払消費税等	451	16,468
賞与引当金	54,116	49,399
役員賞与引当金	20,525	9,092
流動負債合計	1,464,341	1,201,290
固定負債		
退職給付引当金	74,772	79,579
役員退職慰労引当金	2,618	3,398
固定負債合計	77,390	82,977
負債合計	1,541,732	1,284,268
純資産の部		
株主資本		
資本金	500,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	31,736	58,876
資本剰余金合計	31,736	58,876
利益剰余金		
利益準備金	265,112	265,112
その他利益剰余金		
任意積立金	230,000	230,000
繰越利益剰余金	66,188	53,013
利益剰余金合計	428,924	548,126
株主資本合計	960,660	1,607,002
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	16,204	360
評価・換算差額等合計	16,204	360
純資産合計	944,456	1,606,642
負債・純資産合計	2,486,188	2,890,910

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自平成29年 1月 1日 至平成29年12月31日)	第34期 (自平成30年 1月 1日 至平成30年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	5,064,645	3,280,295
運用受託報酬	947,328	1,250,895
その他営業収益	219,447	292,479
営業収益合計	6,231,421	4,823,670
営業費用		
支払手数料	2,297,846	1,429,483
広告宣伝費	19,985	17,638
調査費		
調査費	728,225	572,127
委託調査費	1,312,909	944,075
営業雑経費		
通信費	13,476	11,849
印刷費	131,408	93,396
協会費	6,910	5,657
図書費	2,416	2,079
その他	-	8,858
営業費用合計	4,513,178	3,085,165
一般管理費		
給料		
役員報酬	41,442	38,600
給料・手当	706,267	713,849
賞与	163,198	177,256
役員賞与	82,628	63,396
賞与引当金繰入	54,116	49,399
役員賞与引当金繰入	20,525	9,092
交際費	1,770	1,916
寄付金	681	640
旅費交通費	23,187	20,906
租税公課	17,917	30,629
不動産賃借料	166,229	173,890
退職給付費用	38,267	41,517
役員退職慰労引当金繰入	796	780
固定資産減価償却費	7,405	6,820
業務委託費	323,460	280,550
諸経費	82,907	64,100
一般管理費合計	1,730,802	1,673,348
営業利益又は営業損失（ ）	12,559	65,156
営業外収益		
受取利息	168	38
受取配当金	32	16

為替差益	1,857	-
時効成立分配金・償還金	-	4,952
雑収入	127	632
営業外収益合計	2,186	5,639
営業外費用		
為替差損	-	4,862
貸倒損失	-	555
雑損失	4,154	594
営業外費用合計	4,154	6,013
経常利益又は経常損失（ ）	14,526	64,782
特別利益		
固定資産売却益	- *1	36
特別利益合計	-	36
特別損失		
固定資産除却損	- *2	111
退職特別加算金	8,904	-
投資有価証券償還損	-	18,163
移転価格調整金	- *3	67,765
特別損失合計	8,904	86,040
税引前当期純利益又は税引前当期純損失（ ）	23,431	21,220
法人税、住民税及び事業税	3,780	12,787
法人税等の更正、決定等による納付税額又は還付税額	- *3	67,765
法人税等調整額	-	85,444
法人税等合計	3,780	140,422
当期純利益又は当期純損失（ ）	27,211	119,202

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期（自 平成29年1月1日至 平成29年12月31日）

(単位:千円)

	株 主 資 本								評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資 本 剰 余 金			利 益 剰 余 金			株主資本 合計	その他有 価証券評 価差額金	評価・換 算差額等 合計		
		資本準 備金	その 他資 本剰 余金	資本剰 余金合 計	利益準 備金	その他利益剰余金						利益剰 余金合 計
					任意積 立金	繰越利益 剰余金						
当期首残高	500,000	31,736	-	31,736	265,112	230,000	38,977	456,135	987,872	19,379	19,379	968,492
当期変動額												
当期純利益又は 当期純損失（ ）	-	-	-	-	-	-	27,211	27,211	27,211	-	-	27,211
株主資本以外の 項目の当期中の 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,174	3,174	3,174
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	27,211	27,211	27,211	3,174	3,174	24,037
当期末残高	500,000	31,736	-	31,736	265,112	230,000	66,188	428,924	960,660	16,204	16,204	944,456

第34期（自 平成30年1月1日至 平成30年12月31日）

(単位:千円)

	株 主 資 本								評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資 本 剰 余 金			利 益 剰 余 金			株主資本 合計	その他有 価証券評 価差額金	評価・換 算差額等 合計		
		資本準 備金	その 他資 本剰 余金	資本剰 余金合 計	利益準 備金	その他利益剰余金						利益剰 余金合 計
					任意積 立金	繰越利益 剰余金						
当期首残高	500,000	31,736	-	31,736	265,112	230,000	66,188	428,924	960,660	16,204	16,204	944,456
当期変動額												
新株の発行	500,000	27,140	-	27,140	-	-	-	-	527,140	-	-	527,140
当期純利益又は 当期純損失（ ）	-	-	-	-	-	-	119,202	119,202	119,202	-	-	119,202
株主資本以外の 項目の当期中の 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	15,844	15,844	15,844
当期変動額合計	500,000	27,140	-	27,140	-	-	119,202	119,202	646,342	15,844	15,844	662,186
当期末残高	1,000,000	58,876	-	58,876	265,112	230,000	53,013	548,126	1,607,002	360	360	1,606,642

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)子会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2)その他有価証券(時価のあるもの) 期末の市場価格に基づく時価法(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)</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1)有形固定資産 建物附属設備及び工具器具備品は定率法によっております。主な耐用年数は、建物附属設備5～15年、工具器具備品は5～15年であります。ただし平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2)無形固定資産 ソフトウェア(自社利用分)については、定額法により、社内における利用可能期間(5年)で償却しております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1)賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払いに充てるため、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。</p> <p>(2)役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払いに充てるため、役員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。</p> <p>(3)退職給付引当金 従業員の退職給付の支出に充てるため、内規に基づく当事業年度末現在の退職給付要支給額を計上しております。 退職給付引当金の算定にあたり、期末自己都合退職金要支給額を退職給付引当金とする簡便法を採用しております。</p> <p>(4)役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に充てるため、内規に基づく当事業年度末現在の役員退職慰労金要支給額を計上しております。</p>
4. 外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建資産及び負債は、主として当事業年度末現在の直物為替相場による円換算額を付しております。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理方法は、税抜方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

第33期 平成29年12月31日現在	第34期 平成30年12月31日現在
*1 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 105,281 千円 工具器具備品 113,906 千円	*1 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 110,806 千円 工具器具備品 108,607 千円
*2 信託資産 現金・預金のうち、10,155千円は、直販顧客分別金信託契約により、三菱UFJ信託銀行株式会社に信託しております。	

(損益計算書関係)

第33期 自平成29年1月1日 至平成29年12月31日	第34期 自平成30年1月1日 至平成30年12月31日
-	*1 固定資産売却益は、工具器具備品36千円であります。 *2 固定資産除却損は、工具器具備品111千円であります。 *3 会社がアメリカン・インターナショナル・グループ(AIG)の傘下にあった平成18年3月期に納付済みの税金につき、税務当局より法人税等の還付を受けることが確定しました。この還付金は、会社が同グループから独立する際の合意により、AIGに帰属する取り決めであったことから、AIGに返還する費用として特別損失に計上しています。

(株主資本等変動計算書関係)

第33期（自平成29年1月1日至平成29年12月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	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
発行済株式				
普通株式	41,000 株	-	-	41,000 株
合計	41,000 株	-	-	41,000 株

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

第34期（自平成30年1月1日至平成30年12月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	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
発行済株式				
普通株式	41,000 株	1,000 株	-	42,000 株
合計	41,000 株	1,000 株	-	42,000 株

(変動事由の概要)

平成30年2月22日付けの取締役会決議による普通株式数の増加 1,000株

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第33期 自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日	第34期 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年12月31日
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 該当事項はありません。	オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 該当事項はありません。

(金融商品関係)

第33期（自 平成29年1月1日至 平成29年12月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は資金運用について短期的な預金及びグループ会社への貸付金に限定しております。

又、当社業務に関する所要資金は自己資金で賄っており、銀行借入れ、社債発行等による資金調達を行わない方針ですが、子会社への増資がある場合には、所要資金を当社親会社からの借入金により充当することがあります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金は銀行の信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬、未収入金については、顧客の信用リスクに晒されております。未収入金及びその他未払金の一部には、海外の関連会社との取引により生じた外貨建ての資産・負債を保有しているため、為替相場の変動による市場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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時及びその後も継続的に銀行の信用力を評価し、格付けの高い金融機関に係る銀行のみで運用し、預金に係る信用リスクを管理しております。未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、投資信託又は取引相手毎に残高を管理し、当社が運用している資産の中から報酬を徴収するため、信用リスクは僅少であります。又、未収入金は概ね海外の関連会社との取引により生じたものであり、定期的に決済が行われる事により、回収が不能となるリスクは僅少であります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての債権債務に関する為替の変動リスクについては、個別の案件毎に毎月残高照合等を行い、リスクを管理しております。

流動性リスク（支払期日に支払を実行出来なくなるリスク）の管理

当社は日々資金残高管理を行っております。又、月次で資金繰り予定表を作成・更新するとともに、手元流動性(最低限必要な運転資金)を状況に応じて見直し・維持する事等により、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

当事業年度末における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
1)現金・預金	887,338	887,338	-
2)未収委託者報酬	670,737	670,737	-
3)未収運用受託報酬	253,439	253,439	-
4)投資有価証券	87,915	87,915	-
資産計	1,899,430	1,899,430	-
1)未払費用	759,507	759,507	-
2)未払手数料	318,692	318,692	-
負債計	1,078,200	1,078,200	-

（注1） 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

1) 現金・預金、2) 未収委託者報酬、3) 未収運用受託報酬

短期間で決済され、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（投資信託）

投資信託は公表されている基準価額によっております。

負債

1) 未払費用、2) 未払手数料

短期間で決済され、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） 子会社株式（貸借対照表計上額164,013千円）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ため、上表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

（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)現金・預金	887,338	-	-	-
2)未収委託者報酬	670,737	-	-	-
3)未収運用受託報酬	253,439	-	-	-
合計	1,811,515	-	-	-

第34期（自平成30年1月1日至平成30年12月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は資金運用について短期的な預金及びグループ会社への貸付金に限定しております。

又、当社業務に関する所要資金は自己資金で賄っており、銀行借入れ、社債発行等による資金調達を行わない方針ですが、子会社への増資がある場合には、所要資金を当社親会社からの借入金により充当することがあります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

預金は銀行の信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬、未収入金については、顧客の信用リスクに晒されております。未収入金及びその他未払金の一部には、海外の関連会社との取引により生じた外貨建ての資産・負債を保有しているため、為替相場の変動による市場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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時及びその後も継続的に銀行の信用力を評価し、格付けの高い金融機関に係る銀行のみで運用し、預金に係る信用リスクを管理しております。未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、

投資信託又は取引相手毎に残高を管理し、当社が運用している資産の中から報酬を徴収するため、信用リスクは僅少であります。又、未収入金は概ね海外の関連会社との取引により生じたものであり、定期的に決済が行われる事により、回収が不能となるリスクは僅少であります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての債権債務に関する為替の変動リスクについては、個別の案件毎に毎月残高照合等を行い、リスクを管理しております。

流動性リスク（支払期日に支払を実行出来なくなるリスク）の管理

当社は日々資金残高管理を行っております。又、月次で資金繰り予定表を作成・更新するとともに、手元流動性(最低限必要な運転資金)を状況に応じて見直し・維持する事等により、流動性リスクを管理しております。

2.金融商品の時価等に関する事項

当事業年度末における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
1)現金・預金	1,425,655	1,425,655	-
2)未収委託者報酬	457,570	457,570	-
3)未収運用受託報酬	329,213	329,213	-
4)投資有価証券	2,770	2,770	-
資産計	2,215,209	2,215,209	-
1)未払費用	605,315	605,315	-
2)未払手数料	172,561	172,561	-
負債計	777,877	777,877	-

（注1） 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

1) 現金・預金、2) 未収委託者報酬、3) 未収運用受託報酬

短期間で決済され、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（投資信託）

投資信託は公表されている基準価額によっております。

負債

1) 未払費用、2) 未払手数料

短期間で決済され、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） 子会社株式（貸借対照表計上額164,013千円）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ため、上表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

(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)現金・預金	1,425,655	-	-	-
2)未収委託者報酬	457,570	-	-	-
3)未収運用受託報酬	329,213	-	-	-
合計	2,212,439	-	-	-

(有価証券関係)

第33期 平成29年12月31日現在				第34期 平成30年12月31日現在			
1.子会社株式 (単位：千円)				1.子会社株式 (単位：千円)			
区分	貸借対照表計上額			区分	貸借対照表計上額		
子会社株式	164,013			子会社株式	164,013		
上記については、市場価格がありません。したがって、時価を把握することが極めて困難と認められるものであります。				上記については、市場価格がありません。したがって、時価を把握することが極めて困難と認められるものであります。			
2.その他有価証券で時価のあるもの (単位：千円)				2.その他有価証券で時価のあるもの (単位：千円)			
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	区分	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ないもの				貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託受益証券	87,915	104,119	16,204	投資信託受益証券	2,770	3,131	360
3.当事業年度に売却したその他有価証券 該当事項はありません。				3.当事業年度に売却したその他有価証券 該当事項はありません。			

(退職給付関係)

第33期（平成29年12月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に充てるため、確定拠出年金制度および非積立型の退職一時金制度を採用しております。

退職一時金制度では、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、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. 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

	千円
期首における退職給付引当金	79,386
退職給付費用	10,068
退職給付の支払額	14,683
期末における退職給付引当金	<u>74,772</u>

(2)退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	10,068千円
----------------	----------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、29,199千円でありました。

第34期（平成30年12月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に充てるため、確定拠出年金制度および非積立型の退職一時金制度を採用しております。

退職一時金制度では、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、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. 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

	千円
期首における退職給付引当金	74,772
退職給付費用	11,098
退職給付の支払額	6,291
期末における退職給付引当金	<u>79,579</u>

(2)退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	11,098千円
----------------	----------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、30,419千円でありました。

(税効果会計関係)

第33期 平成29年12月31日現在	第34期 平成30年12月31日現在
1. 繰延税金資産発生 の主な原因別内訳 (単位：千円)	1. 繰延税金資産発生 の主な原因別内訳 (単位：千円)
繰延税金資産	繰延税金資産
未払金否認	未払金否認
21,403	26,659
未払賞与・賞与引当金否認	未払賞与・賞与引当金否認
78,673	81,911
退職給付引当金否認	退職給付引当金否認
42,090	24,370
役員退職慰労引当金否認	役員退職慰労引当金否認
801	1,040
前受収益	資産除去債務
273	20,951
資産除去債務	繰越欠損金
19,570	507,312
繰越欠損金	その他
521,880	12,257
その他	
35,676	
繰延税金資産小計	繰延税金資産小計
720,370	674,503
評価性引当額	評価性引当額
720,370	589,059
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
-	85,444
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	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	法定実効税率
30.9%	30.9%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
1.2%	1.5%
役員賞与等永久に損金に算入されない項目	役員賞与等永久に損金に算入されない項目
80.7%	105.4%
住民税均等割	寄付金等永久に損金に算入されない項目
16.1%	99.9%
評価性引当額	法人税等還付金
47.1%	319.3%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	住民税均等割
0.3%	17.8%
その他	評価性引当額
4.2%	618.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
16.1%	661.7%

(セグメント情報等)

第33期 自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日	第34期 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年12月31日																																
<p>1.セグメント情報 当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。</p> <p>2.関連情報 (1) 製品及びサービス毎の情報 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>委託者報酬</th> <th>運用受託報酬</th> <th>その他営業収益</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>外部顧客への営業収益</td> <td style="text-align: right;">5,064,645</td> <td style="text-align: right;">947,328</td> <td style="text-align: right;">219,447</td> </tr> </tbody> </table> <p>(2) 地域毎の情報 営業収益 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: right;">5,674,747</td> <td style="text-align: right;">556,673</td> <td style="text-align: right;">6,231,421</td> </tr> </tbody> </table> <p>(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。</p> <p>有形固定資産 全有形固定資産が国内に所在しているため、記載を省略しております。</p> <p>(3) 主要な顧客毎の情報 外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。</p>		委託者報酬	運用受託報酬	その他営業収益	外部顧客への営業収益	5,064,645	947,328	219,447	日本	その他	合計	5,674,747	556,673	6,231,421	<p>1.セグメント情報 当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。</p> <p>2.関連情報 (1) 製品及びサービス毎の情報 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>委託者報酬</th> <th>運用受託報酬</th> <th>その他営業収益</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>外部顧客への営業収益</td> <td style="text-align: right;">3,280,295</td> <td style="text-align: right;">1,250,895</td> <td style="text-align: right;">292,479</td> </tr> </tbody> </table> <p>(2) 地域毎の情報 営業収益 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>米国</th> <th>欧州</th> <th>中国</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: right;">4,146,114</td> <td style="text-align: right;">355,400</td> <td style="text-align: right;">314,289</td> <td style="text-align: right;">7,865</td> <td style="text-align: right;">4,823,670</td> </tr> </tbody> </table> <p>(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。</p> <p>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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。</p> <p>(3) 主要な顧客毎の情報 外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。</p>		委託者報酬	運用受託報酬	その他営業収益	外部顧客への営業収益	3,280,295	1,250,895	292,479	日本	米国	欧州	中国	合計	4,146,114	355,400	314,289	7,865	4,823,670
	委託者報酬	運用受託報酬	その他営業収益																														
外部顧客への営業収益	5,064,645	947,328	219,447																														
日本	その他	合計																															
5,674,747	556,673	6,231,421																															
	委託者報酬	運用受託報酬	その他営業収益																														
外部顧客への営業収益	3,280,295	1,250,895	292,479																														
日本	米国	欧州	中国	合計																													
4,146,114	355,400	314,289	7,865	4,823,670																													

（関連当事者情報）

第33期（自平成29年1月1日 至平成29年12月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス B.V.	オランダ、アムステルダム	千ユーロ 18	持株会社	被所有直接100%	-	-	-	千円 -	-	千円 -

（2）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

属性	会社等の名称	住所	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス US LLC	アメリカ、ニューヨーク州	千USドル 258,140	持株会社	-	あり	経営管理サービス契約	役務提供に対する対価受取*2	千円 466,582	未収入金	千円 38,274
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ LLC	アメリカ、ニューヨーク州	千USドル 2	投資運用会社	-	あり	一任契約サービス契約	役務提供に対する対価受取*2	千円 320,443	未収運用受託報酬	千円 66,004
								役務提供に対する対価受取*2	千円 149,246	未収入金	千円 76,716
								委託調査費の支払*3	千円 579,488	未払費用	千円 268,707
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ・ヨーロッパ・リミテッド	イギリス、ロンドン	千スターリングポンド 200	投資運用会社	-	-	一任契約サービス契約	委託調査費の支払*3	千円 139,494	未払費用	千円 119,526
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ・アイルランド・リミテッド	アイルランド、ダブリン	千USドル 369	投資運用会社	-	-	一任契約サービス契約	役務提供に対する対価受取*2	千円 112,142	未収運用受託報酬	千円 25,475

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

*1 上記の表における消費税の取り扱いについては、国内取引については損益計算書項目は税抜き、貸借対照表項目については税込みで表示しております。尚、海外取引は全て免税取引となっております。

- *2 役務提供に対する対価受取は、サービス契約に基づくオペレーショナル・サポート費用、法務費用等の相手先への配賦額であります。尚、配賦額については、当社と当社の親会社及び兄弟会社等のグループ会社との間で合意した合理的な計算根拠に基づいて決定しております。
- *3 委託調査費等の支払については、ファンドの運用資産の割合に応じた一定の比率により決定しております。

2. 親会社又は重要な関連当事者に関する注記

(1) 親会社情報

パインブリッジ・インベストメンツ・リミテッド(金融商品取引所に上場しておりません)

パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス・(ホンコン)・リミテッド(金融商品取引所に上場しておりません)

パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス・リミテッドSarI(金融商品取引所に上場しておりません)

パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングスB.V.(金融商品取引所に上場しておりません)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当事項ありません。

第34期（自平成30年1月1日 至平成30年12月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス B.V.	オランダ、アムステルダム	千ユーロ 18	持株会社	被所有直接 100%	-	-	-	千円 -	-	千円 -

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

属性	会社等の名称	住所	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス US LLC	アメリカ、ニューヨーク州	千USドル 209,089	持株会社	-	あり	経営管理 サービス契約	役務提供に対する 対価支払 *2	千円 386,161	未払費用	千円 78,482
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ LLC	アメリカ、ニューヨーク州	千USドル 2	投資運用会社	-	あり	一任契約 サービス契約	役務提供に対する 対価受取 *3	千円 464,788	未収入金	千円 108,724
								役務提供に対する 対価受取 *3	千円 17,627	未収運用 受託報酬	千円 8,510
								委託調査 費の支払 *4	千円 436,674	未払費用	千円 102,368
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ・ヨーロッパ・リミテッド	イギリス、ロンドン	千スターリングポンド 200	投資運用会社	-	-	一任契約 サービス契約	委託調査 費の支払 *4	千円 149,137	未払費用	千円 45,085
同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ・アイルランド・リミテッド	アイルランド、ダブリン	千USドル 369	投資運用会社	-	-	一任契約 サービス契約	役務提供に対する 対価受取 *3	千円 311,531	未収運用 受託報酬	千円 102,776

同一の親会社を持つ会社	パインブリッジ・インベストメンツ・アジア・リミテッド	ホンコン	千USD 28,651	投資運用会社	-	あり	経営管理	役員提供	千円	千円	
							サービス契約	に対する対価支払*2	57,546	未払費用	19,928
								委託調査費の支払*4	千円	千円	
									52,221	未払費用	18,188

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

- *1 上記の表における消費税の取り扱いについては、国内取引については損益計算書項目は税抜き、貸借対照表項目については税込みで表示しております。尚、海外取引は全て免税取引となっております。
- *2 役員提供に対する対価支払は、サービス契約に基づくテクノロジーサービス費用、オペレーショナル・サポート費用等の当社負担額であります。尚、負担額については、当社と当社の親会社及び兄弟会社等のグループ会社との間で合意した合理的な計算根拠に基づいて決定しております。
- *3 役員提供に対する対価受取は、サービス契約に基づくオペレーショナル・サポート費用、法務費用等の相手先への配賦額であります。尚、配賦額については、当社と当社の親会社及び兄弟会社等のグループ会社との間で合意した合理的な計算根拠に基づいて決定しております。
- *4 委託調査費等の支払については、ファンドの運用資産の割合に応じた一定の比率により決定しております。

2. 親会社又は重要な関連当事者に関する注記

（1）親会社情報

パインブリッジ・インベストメンツ・リミテッド（金融商品取引所に上場しておりません）

パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス・（ホンコン）・リミテッド（金融商品取引所に上場しておりません）

パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス・リミテッドSarI（金融商品取引所に上場しておりません）

パインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングスB.V.（金融商品取引所に上場しておりません）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当事項ありません。

(1株当たり情報)

第33期 自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日		第34期 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年12月31日	
1株当たり純資産額	23,035円51銭	1株当たり純資産額	38,253円38銭
1株当たり当期純損失金額	663円69銭	1株当たり当期純利益金額	2,849円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益額については、新株予約権付社債の発行がないため記載しておりません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益額については、新株予約権付社債の発行がないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定の基礎は、以下のとおりであります。

第33期 自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日		第34期 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年12月31日	
当期純損失	27,211 千円	当期純利益	119,202 千円
普通株主に帰属しない金額	-	普通株主に帰属しない金額	-
普通株主に係る当期純損失	27,211 千円	普通株主に係る当期純利益	119,202 千円
普通株式の期中平均株式数	41,000 株	普通株式の期中平均株式数	41,827 株

(重要な後発事象)

第33期 自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日	第34期 自 平成30年 1月 1日 至 平成30年12月31日												
<p>(株主割当増資に関する事項)</p> <p>当社は平成30年2月22日付けの取締役会決議に基づき、100%親会社であるパインブリッジ・インベストメンツ・ホールディングス B.V.に、株主割当増資を平成30年3月5日付けで実施致しました。</p> <p>1) 増資の目的 当社の財務基盤強化を目的としております。</p> <p>2) 増資の内容</p> <table> <tr> <td>発行株式の種類</td> <td>普通株式</td> </tr> <tr> <td>発行株式数</td> <td>1,000株</td> </tr> <tr> <td>発行価額 1株につき</td> <td>527千円</td> </tr> <tr> <td>発行価額の総額</td> <td>527,140千円</td> </tr> <tr> <td>資本組入額の総額</td> <td>500,000千円</td> </tr> <tr> <td>増資後の資本金</td> <td>1,000,000千円</td> </tr> </table>	発行株式の種類	普通株式	発行株式数	1,000株	発行価額 1株につき	527千円	発行価額の総額	527,140千円	資本組入額の総額	500,000千円	増資後の資本金	1,000,000千円	該当事項はありません。
発行株式の種類	普通株式												
発行株式数	1,000株												
発行価額 1株につき	527千円												
発行価額の総額	527,140千円												
資本組入額の総額	500,000千円												
増資後の資本金	1,000,000千円												

2. 中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第35期中間会計期間末 (2019年6月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		537,309
短期貸付金		700,000
前払金		4,736
前払費用		42,082
未収入金		97,527
未収委託者報酬		439,187
未収運用受託報酬		275,087
立替金		3,830
未収収益		2,010
未収還付法人税等		14,478
流動資産合計		2,116,251
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	*1	28,349
工具器具備品	*1	9,084
リース資産	*1	18,385
有形固定資産合計		55,819
無形固定資産		
ソフトウェア		1,161
電話加入権		3,875
無形固定資産合計		5,036
投資その他の資産		
投資有価証券		923
関係会社株式		164,013
敷金保証金		109,117
預託金		74
繰延税金資産		18,495
投資その他の資産合計		292,624
固定資産合計		353,481
資産合計		2,469,733

(単位:千円)

第35期中間会計期間末
(2019年6月30日現在)

負債の部	
流動負債	
預り金	23,828
未払収益分配金	240
未払手数料	162,243
その他未払金	269,400
未払費用	326,599
未払法人税等	2,819
未払消費税等	9,848
賞与引当金	195,596
リース債務	3,803
流動負債合計	994,379
固定負債	
退職給付引当金	75,966
役員退職慰労引当金	3,788
リース債務	14,936
固定負債合計	94,691
負債合計	1,089,070
純資産の部	
株主資本	
資本金	1,000,000
資本剰余金	
資本準備金	58,876
資本剰余金合計	58,876
利益剰余金	
利益準備金	265,112
その他利益剰余金	
任意積立金	230,000
繰越利益剰余金	173,213
利益剰余金合計	321,899
株主資本合計	1,380,776
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	113
評価・換算差額等合計	113
純資産合計	1,380,662
負債・純資産合計	2,469,733

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第35期 中間会計期間 (自2019年1月 1日 至2019年6月30日)	
営業収益	
委託者報酬	1,238,189
運用受託報酬	581,015
その他営業収益	95,715
営業収益合計	1,914,920
営業費用及び一般管理費	*1 2,067,435
営業損失()	152,515
営業外収益	
受取利息	3,170
受取配当金	6
為替差益	4,310
雑収入	467
営業外収益合計	7,955
営業外費用	
支払利息	48
営業外費用合計	48
経常損失()	144,607
特別損失	
退職特別加算金	15,435
投資有価証券償還損	31
特別損失合計	15,467
税引前中間純損失()	160,075
法人税、住民税及び事業税	1,890
法人税等還付税額	2,687
法人税等調整額	66,949
法人税等合計	66,151
中間純損失()	226,226

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自2019年1月1日 至2019年6月30日）

(単位:千円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		株主資本 合計	その他 有価証 券評価 差額金	評価・ 換算差 額等合 計		
		資本準 備金	資本剰余 金合計		任意積 立金	繰越利益 剰余金					利益剰余 金合計
当期首残高	1,000,000	58,876	58,876	265,112	230,000	53,013	548,126	1,607,002	360	360	1,606,642
当中間期変動額											
中間純損失（ ）	-	-	-	-	-	226,226	226,226	226,226	-	-	226,226
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	247	247	247
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	226,226	226,226	226,226	247	247	225,979
当中間期末残高	1,000,000	58,876	58,876	265,112	230,000	173,213	321,899	1,380,776	113	113	1,380,662

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)子会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2)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)</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1)有形固定資産(リース資産を除く) 建物附属設備及び工具器具備品は定率法によっております。主な耐用年数は、建物附属設備5～15年、工具器具備品は5～15年です。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2)無形固定資産(リース資産を除く) ソフトウェア(自社利用分)については、定額法により、社内における利用可能期間(5年)で償却しております。</p> <p>(3)リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1)賞与引当金 従業員及び役員に支給する賞与の支払いに充てるため、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。</p> <p>(2)退職給付引当金 従業員の退職給付の支出に充てるため、内規に基づく当中間会計期間末日現在の退職給付要支給額を計上しております。 退職給付引当金の算定にあたり、当中間会計期間末日における自己都合退職金要支給額を退職給付引当金とする簡便法を採用しております。</p> <p>(3)役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に充てるため、内規に基づく当中間会計期間末日現在の役員退職慰労金要支給額を計上しております。</p>
4. 外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建資産及び負債は、主として中間会計期間末日の直物為替相場による円換算額を付しております。
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理方法は、税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第35期 中間会計期間末 2019年6月30日現在	
*1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物附属設備	113,104 千円
工具器具備品	109,352 千円
リース資産	967 千円
*2.消費税等の取り扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺の上、未払消費税等として表示しております。

（中間損益計算書関係）

第35期 中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日		
*1.減価償却実施額	有形固定資産	4,009 千円
	無形固定資産	199 千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期 中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日				
1.発行済株式の種類及び総数に関する事項				
	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	42,000 株	-	-	42,000 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.配当に関する事項		該当事項はありません		

（リース取引関係）

第35期 中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日
ファイナンス・リース取引 所有権移転外ファイナンス・リース取引 リース資産の内容 ・有形固定資産 主として、本社における複合機(工具器具備品)であります。 リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

（金融商品関係）

第35期 中間会計期間末（2019年6月30日）

金融商品の時価等に関する事項

当中間会計期間末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、次の通りであります。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
1) 現金・預金	537,309	537,309	-
2) 短期貸付金	700,000	700,000	-
3) 未収入金	97,527	97,527	-
4) 未収委託者報酬	439,187	439,187	-
5) 未収運用受託報酬	275,087	275,087	-
6) 未収収益	2,010	2,010	-
7) 投資有価証券	923	923	-
資産計	2,052,046	2,052,046	-
1) 未払手数料	162,243	162,243	-
2) その他未払金	269,400	269,400	-
3) 未払費用	326,599	326,599	-
負債計	758,243	758,243	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

1) 現金・預金、2) 短期貸付金、3) 未収入金、4) 未収委託者報酬、5) 未収運用受託報酬、6) 未収収益
 これらは短期間で決済され、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。

7) 投資有価証券（投資信託）

投資信託は公表されている基準価額によっております。

負債

1) 未払手数料、2) その他未払金、3) 未払費用

これらは短期間で決済され、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）子会社株式（中間貸借対照表計上額164,013千円）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ため、上表には含めておりません。

（有価証券関係）

第35期 中間会計期間末 2019年6月30日現在

1. 子会社株式

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
子会社株式	164,013
合計	164,013

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであります。

2. その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	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	投資信託受益証券	-	-	-
	小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	投資信託受益証券	923	1,037	113
	小計	923	1,037	113
合計		923	1,037	113

(セグメント情報等)

第35期 中間会計期間
自 2019年1月 1日
至 2019年6月30日

1.セグメント情報

当社はアセットマネジメント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)製品及びサービス毎の情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2)地域毎の情報

営業収益

(単位:千円)

日本	米国	欧州	アジア	合計
1,666,845	105,874	120,163	22,036	1,914,920

(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。

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%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客毎の情報

(単位:千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益
FWD富士生命保険株式会社	224,648

(注) 外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上のものを記載しております。

(1 株当たり情報)

第35期 中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日	
1株当たり純資産額	32,872円 92銭
1株当たり中間純損失	5,386円 34銭
(注)	
1. 当中間会計期間の潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、1株当たり中間純損失であり、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株当たり中間純損失の算定の基礎は、以下のとおりであります。	
中間損益計算書上の中間純損失	226,226 千円
普通株式に係る中間純損失	226,226 千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	-
普通株式の期中平均株式数	42,000 株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】**

1) 「受託会社」

[訂正前]

名称及び資本金の額（2019年3月末日現在）

[訂正後]

名称及び資本金の額（2019年9月末日現在）

2) 「販売会社」

[訂正前]

名称及び資本金の額（2019年3月末日現在）

[訂正後]

名称及び資本金の額（2019年9月末日現在）

3) 「投資顧問会社」

[訂正前]

名称及び資本金の額（2019年3月末日現在）

[訂正後]

名称及び資本金の額（2019年9月末日現在）

参考情報

[訂正前]

再信託受託会社の概要（2019年3月末日現在）

[訂正後]

再信託受託会社の概要（2019年9月末日現在）

独立監査人の監査報告書

平成31年3月19日

パインブリッジ・インベストメンツ株式会社

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 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、「委託会社等の経理状況」に掲げられているパインブリッジ・インベストメンツ株式会社の平成30年1月1日から平成30年12月31日までの第34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、パインブリッジ・インベストメンツ株式会社の平成30年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年2月5日

パインブリッジ・インベストメンツ株式会社

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

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」に掲げられているパインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジあり>の2019年6月18日から2019年12月16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、パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジあり>の2019年12月16日現在の信託財産の状況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

パインブリッジ・インベストメンツ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

2020年2月5日

パインブリッジ・インベストメンツ株式会社

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

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」に掲げられているパインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジなし>の2019年6月18日から2019年12月16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、パインブリッジ米国住宅支援機関債ファンド<為替ヘッジなし>の2019年12月16日現在の信託財産の状況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

パインブリッジ・インベストメンツ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。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2019年9月18日

パインブリッジ・インベストメンツ株式会社
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 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」に掲げられているパインブリッジ・インベストメンツ株式会社の2019年1月1日から2019年12月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2019年1月1日から2019年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、パインブリッジ・インベストメンツ株式会社の2019年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年1月1日から2019年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

-
- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[前へ](#)