

【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4月10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 柳谷 俊郎

【本店の所在の場所】 東京都千代田区九段南一丁目3番1号
(平成29年5月8日より「東京都千代田区麹町六丁目1番地1」に変更)

【事務連絡者氏名】 木村 升昭

【電話番号】 03-4520-3400
(平成29年5月8日より「03-6752-1050」に変更)

【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・グローバル・バランス・ファンド(部分為替ヘッジあり)

【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】 当初申込期間(平成28年7月19日から平成28年7月28日まで)300億円を上限とします。
継続申込期間(平成28年7月29日から平成29年10月10日まで)2兆円を上限とします。

【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28年7月1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・追加するためならびに訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

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】

当初申込期間：受益権1口当たり1円とします。

（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）

(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（当初申込期間中は1口当たり1円）に1.08%*（税抜1%）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）

(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）

（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）

（以下略）

<訂正後>

(4)【発行（売出）価格】

当初申込期間：受益権1口当たり1円とします。

（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（当初申込期間中は1口当たり1円）に1.08%*（税抜1%）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）

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、日本を含む世界の債券および株式に投資を行い、安定的な収益の獲得と信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

ファンドの特色

1 投資信託証券^{*1}への投資(上場投資信託証券(ETF)を含みます。)を通じて、先進国の中短期公社債および新興国を含む世界の株式に幅広く分散投資します。

- 株式部分の投資にあたっては、先進国の相対的に配当利回りが高い銘柄および新興国を含む世界の株式に幅広く分散投資を行う事で、リスク分散と収益の獲得を目指します。
- 債券部分の投資にあたっては、実質的な償還までの期間が5年以下の先進国の公社債に投資します。また、ポートフォリオの平均デュレーション^{*2}は3年以下となるようにコントロールを行い、金利変動リスクの低減を図ります。

*1 <組入れ投資信託証券>(以下「組入れファンド」または「組入れ指定投資信託証券」という場合があります。)

- ①ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショートターム・インベストメント・グレード・フィクスト・インカム・ファンド(円建て)
- ②グローバル・マルチ・ストラテジーズ・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジあり)(円建て)
- ③グローバル・マルチ・ストラテジーズ・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジなし)(円建て)
- ④ウィズダムツリー・U.S.クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド(米ドル建て)
- ⑤ウィズダムツリー・インターナショナル・ヘッジド・クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド(米ドル建て)
- ⑥ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド(円建て)
- ⑦ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド(円建て)

*2 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。

2 債券部分の平均格付は投資適格を維持することを基本とします。

- 投資する公社債の平均信用格付は原則として投資適格(BBB-格)以上を維持*することを基本とし、信用リスクの低減を図ります。

* 投資する公社債には、一部短期ハイ・イールド債券を含みます。

3 部分為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。

- 投資する一部の資産クラスについて対円での為替ヘッジを行います。

※本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。本ファンドの仕組みについては後記「ファンドの仕組み」をご参照ください。

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。

期待リターンと推計リスク

ご投資家の目標とする収益率（リターン）と、想定される価格変動性（リスク）水準に基づいてポートフォリオを構築します。先進国の中短期公社債および新興国を含む世界の株式に幅広く投資することで、価格変動性（リスク）をある程度抑えながら、収益率（リターン）を獲得することを目指します。

期待リターン（年率）	5.0%
推計リスク（年率）	11.6%
年間最大変動率の目安	±23.2%

※上記の期待リターン、推計リスクは金融投資理論に基づき委託会社が推計しています（2016年12月末現在）。なお、上記の期待リターンおよび推計リスクは年率で表記しています。

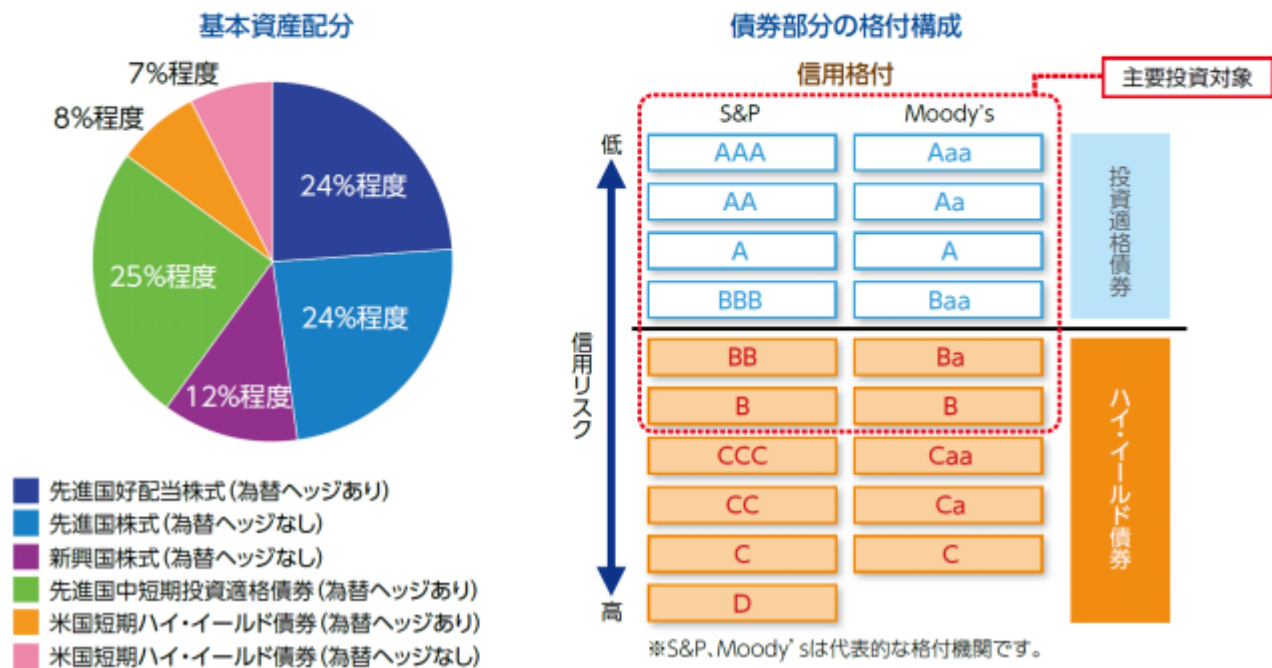
※期待リターンは、ビルディング・ブロック（積木）法という概念を用いて算出します。ビルディング・ブロック法とは、無リスク資産（国債金利等）のリターンに対して、リスクプレミアム（リスクをとる見返りに投資家が要求する超過収益）を上乗せしていく手法です。ただし、期待リターンは長期的な視点で推計された期待値であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。従って、投資者の元本が保証されるものではなく、本ファンドの基準価額は下落する場合があります。また、期待リターンは運用管理費用（信託報酬）控除後のものであり、その他の費用等は考慮していません。

※推計リスクは、過去のデータを基に算出します。実際の運用においては、資産配分の見直しや組入れファンドのリスク水準の変化等に伴い変動します。

※年間最大変動率の目安は、推計リスク水準の2倍を目安としています。

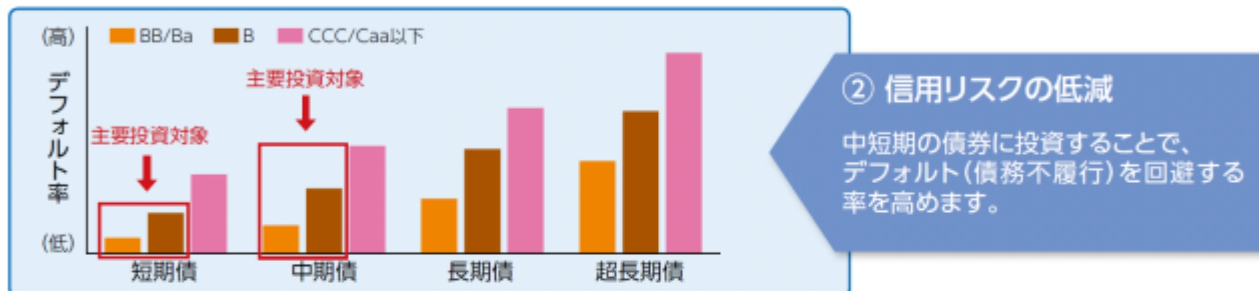
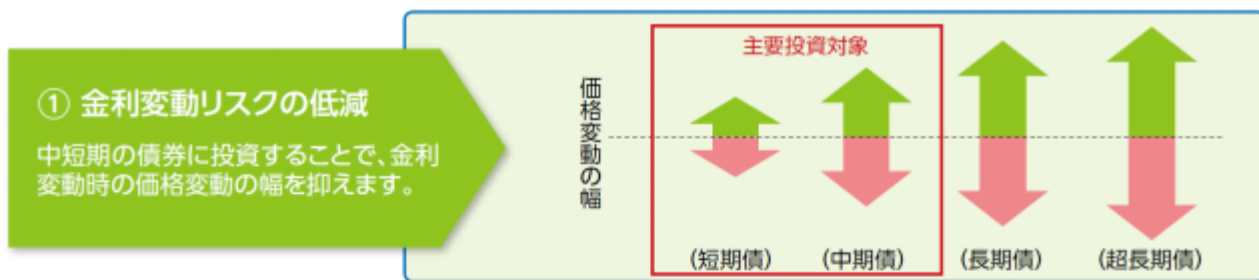
資産配分について

本ファンドの基本資産配分は以下の通りです。資産配分は、資産クラス毎の期待リターンおよび推計リスクを基に行います。資産配分は市場環境等により定期的に見直しを行います。その際は、①中長期的に期待リターンが達成できると見込まれる水準で、かつ、②債券部分の平均信用格付が投資適格となるように行います。



中短期の債券への投資でリスクを低減

本ファンドは、組入れファンドを通じて中短期の債券に投資します。中短期の債券に投資することで、金利変動リスクと信用リスクの両方を低減することが可能です。



※「デフォルト」とは、債券の元金金の支払いが定められた通りに行われなかったことをいいます。

上記は債券の一般的なリスクを理解していただくための概念図であり、必ずしも全ての場合に当てはまるとは限りません。

好配当株式への投資

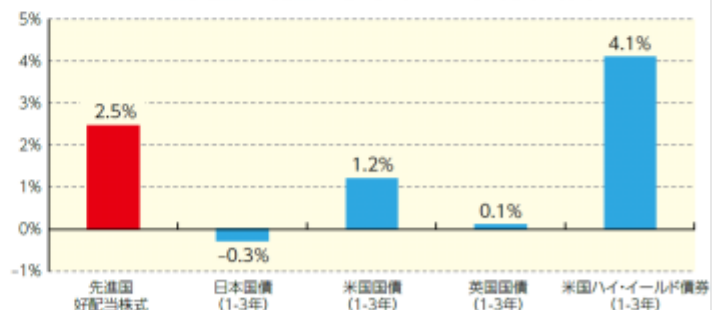
本ファンドは、上場投資信託証券(ETF)を通じて先進国の好配当株式に投資します。先進国の株式の中で、相対的に配当利回り*が高い銘柄の中から、企業の質(収益性、成長性)に着目して投資を行います。

好配当株式のイメージ



* 配当利回りは、株式の投資価値を表す指標のひとつです。株価の割安度の測定や、市場金利と比較することで株価水準の妥当性を判断するのに用いられます。

各資産の利回り水準 (2017年2月末現在)



先進国好配当株式：ウィズダムツリー・米国クオリティ・ディビデンド・グロース・インデックスおよびウィズダムツリー・インターナショナル・ヘッジド・クオリティ・ディビデンド・グロース・インデックスを基に、委託会社が1：1の割合で合成したものの。

日本国債、米国国債、英国国債：シティ世界国債インデックス(1-3年)

米国ハイ・イールド債券：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・ペイ・インデックス(BB-B格、1-3年)

※上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆あるいは保証するものではありません。上記のデータはインデックスの利回りであり本ファンドの利回りではありません。

グローバル株式への分散投資

本ファンドは、組入れファンドを通じてグローバル株式(新興国の株式を含みます。)にも投資を行います。グローバル株式の投資にあたっては、市場の代表的なインデックス*よりも幅広く、分散投資を行います。個別銘柄選択に焦点を当てるのではなく、企業規模(大型株/小型株)や、相対価格(割安株/成長株)等の特性に着目することにより、長期的に市場インデックスを上回る収益を目指します。長期的には、企業規模においては小型株、相対価格においては割安株のリターンが優位となる傾向があります。

市場の代表的なインデックスと組入れファンドの投資対象銘柄数の比較(2016年12月末現在)

MSCI オールカンントリー・ワールド・インデックス
約2500銘柄



約8,300銘柄に
分散投資

* ここでいう市場の代表的なインデックスとは、MSCI オールカンントリー・ワールド・インデックスを指します(以下同じ)。MSCI オールカンントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した指数で、新興国を含む世界株式の代表的な指数です。

一般的な市場インデックスと組入れファンドの企業規模・相対価格別の構成比



※上記は組入れファンドの運用手法を理解していただくための概念図であり、必ずしも全ての場合に当てはまるとは限りません。

※市況動向や資金動向その他の要因等によっては、上記運用手法のような運用ができない場合があります。また、上記運用手法は変更される場合があります。

組入れファンドの運用

先進国の公社債およびグローバル株式を主要投資対象とする組入れファンドの運用は、ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・リミテッド(英国法人)が行います。ディメンショナルは、ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・リミテッドおよびその関係会社の総称です。経済分野で世界的に著名な学識経験者がディメンショナルのコンサルタントを務めており、ディメンショナルは学術的研究を応用した運用を実践しています。

米国市場の短期ハイ・イールド債券等を主要投資対象とする組入れファンドの運用は、アリアンツ・グローバル・インベスターズ U.S. LLCが行います。アリアンツ・グローバル・インベスターズ U.S. LLCは、アリアンツ・グループ傘下の運用会社です。アリアンツ・グループは、世界70カ国以上で保険、年金、退職金サービス、資産運用等のサービスを提供する総合金融グループです。



ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ

【運用資産残高】約4,000億米ドル(約54兆円)

【従業員数】約1,100名

出所：ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ

運用資産残高および従業員数：

2016年12月末現在、1米ドル=116.635円で換算



Understand. Act.

アリアンツ・グループ

【運用資産残高】約230兆円

出所：アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ジャパン

運用資産残高：

2016年12月末現在、1ユーロ=123.0208円で換算

組入れファンドの運用

好配当株式を主要投資対象とする組入れファンドの運用は、ウィズダムツリー・アセット・マネジメント・インクが行います。ウィズダムツリー・アセット・マネジメント・インクはスマートベータETF（上場投資信託）に特化した運用会社として唯一の上場企業会社であり、ETFの運用資産は米国7位（2016年12月）となっています。

インデックスリサーチ部門により独自のインデックスを開発し、株式、債券、コモディティ、通貨、オルタナティブ投資のスマートベータETFを米国と欧州で展開しており、日本にも拠点を有しています。



ウィズダムツリー・アセット・マネジメント・インク

【運用資産残高】約410億米ドル（約4.8兆円）

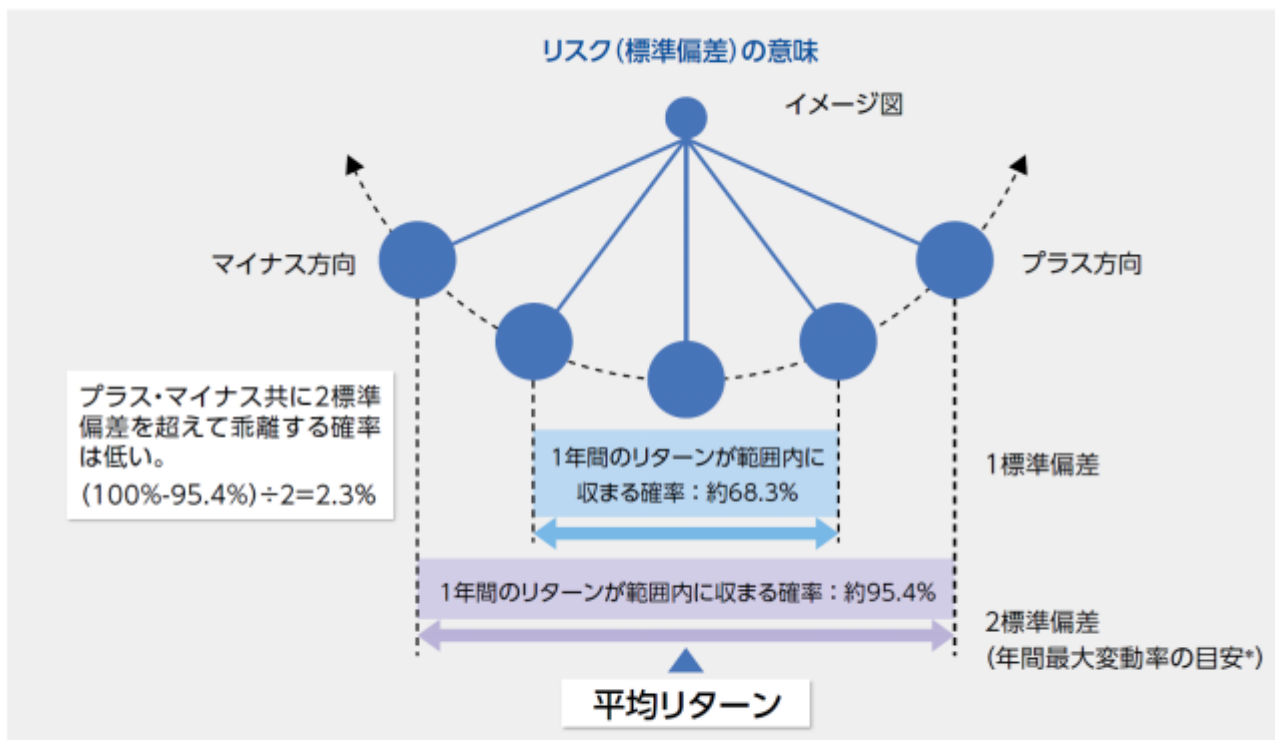
【従業員数】約200名

出所：ウィズダムツリー・アセット・マネジメント・インク

運用資産残高および従業員数：

2016年12月末現在、1米ドル=116.49円で換算

年間最大変動率の目安について



*上記の「年間最大変動率の目安」は、統計指標における±2標準偏差としていますが、実際の金融市場では、この目安を超えて変動する可能性があります。

※上記は、データや確率変数の散らばり度合いを表す統計指標（標準偏差）の意味を理解いただくために委託会社が作成・図式化したイメージ図であり、必ずしも全ての場合に当てはまるとは限りません。

※1年間のリターンの散らばり度合いは正規分布に従うものとして記載しています。

（２）【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

平成28年7月1日 関東財務局長に対して有価証券届出書の提出

平成28年7月29日 信託契約締結、本ファンドの設定、運用開始（予定）

< 訂正後 >

平成28年7月29日 信託契約締結、本ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

ファンドの仕組み

本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。運用にあたってはディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・リミテッド、アリアンツ・グローバル・インベスターズU.S.LLCおよびウィズダムツリー・アセット・マネジメント・インクが運用する投資信託証券のうち、本ファンドの運用戦略を行うために必要と認められる下記の投資信託証券を主要投資対象とします。

（中略）

上記は本書提出日現在予定されている組入れ指定投資信託証券の一覧です。各指定投資信託証券については見直されることがあります。この場合、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を除外する場合があります。

（以下略）

<訂正後>

ファンドの仕組み

本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。運用にあたってはディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・リミテッド、アリアンツ・グローバル・インベスターズU.S.LLCおよびウィズダムツリー・アセット・マネジメント・インクが運用する投資信託証券のうち、本ファンドの運用戦略を行うために必要と認められる下記の投資信託証券を主要投資対象とします。

（中略）

上記は本書提出日現在の組入れ指定投資信託証券の一覧です。各指定投資信託証券については見直されることがあります。この場合、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を除外する場合があります。

（以下略）

2【投資方針】

（2）【投資対象】

<訂正前>

（前略）

上記は本書提出日現在予定されている指定投資信託証券です。なお、指定投資信託証券は見直されることがあります。この場合、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を除外する場合があります。

指定投資信託証券の概要 a.

（中略）

上記は本書提出日現在予定されている指定投資信託証券の概要であり、今後、当該項目の内容が変更される場合があります。

指定投資信託証券の概要 b.

（中略）

上記は本書提出日現在予定されている指定投資信託証券の概要であり、今後、当該項目の内容が変更される場合があります。

<訂正後>

（前略）

上記は本書提出日現在の指定投資信託証券です。なお、指定投資信託証券は見直されることがあります。この場合、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を除外する場合があります。

指定投資信託証券の概要 a.

（中略）

上記は本書提出日現在の指定投資信託証券の概要であり、今後、当該項目の内容が変更される場合があります。

指定投資信託証券の概要 b.

（中略）

上記は本書提出日現在の指定投資信託証券の概要であり、今後、当該項目の内容が変更される場合があります。

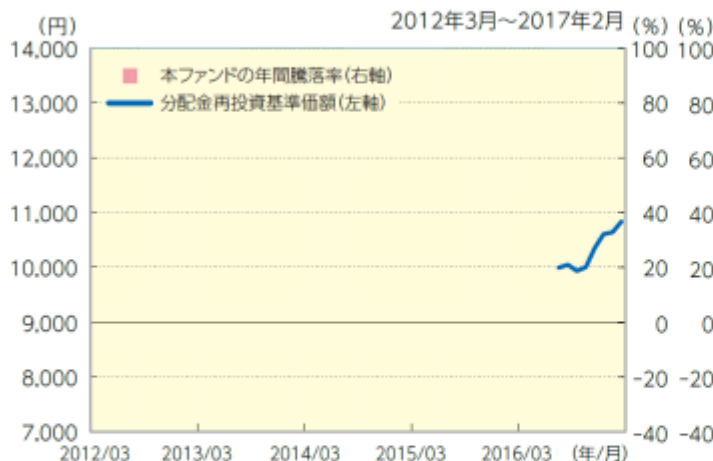
3【投資リスク】

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。

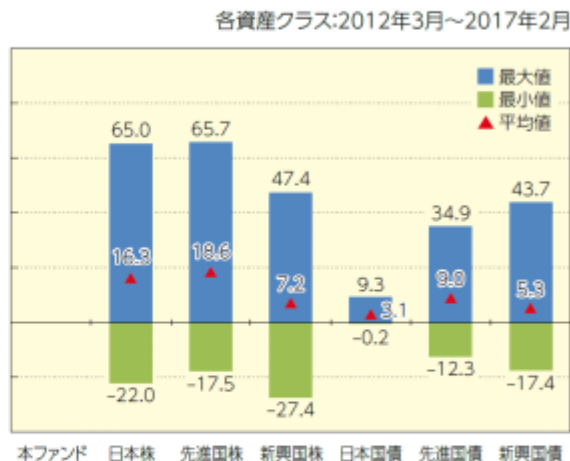
<更新・訂正後>

(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



※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2016年7月29日のため、上記グラフの分配金再投資基準価額は2016年7月末以降のデータを表示しています。また、上記グラフの本ファンドの年間騰落率については、各月末の直近1年間の騰落率であるため、該当事項はありません。

※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2016年7月29日のため、上記グラフにおいて本ファンドの各月末の直近1年間の騰落率については該当事項はありません。

<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）

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：03-4520-3401（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)

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2月28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】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	72,222,347	23.54
	ケイマン	42,380,576	13.81
	小計	114,602,923	37.36
投資証券	アイルランド	183,565,997	59.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,543,098	2.78
合計(純資産総額)		306,712,018	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		72,167,220	23.52

(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。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 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	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショートターム・インベストメント・グレード・フィクスト・インカム・ファンド	75,960.358	979.96	74,438,507	983.66	74,719,165	24.36
2	アイルランド	投資証券	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド	61,445.888	1,161.38	71,362,032	1,169.93	71,887,387	23.43
3	アメリカ	投資信託受益証券	ウィズダムツリー・U.S.クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド	10,928	3,819.93	41,744,235	3,993.62	43,642,375	14.22
4	アイルランド	投資証券	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・パリュウ・ファンド	37,112.721	951.69	35,319,850	995.87	36,959,445	12.05
5	アメリカ	投資信託受益証券	ウィズダムツリー・インターナショナル・ヘッジド・クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド	9,160	3,028.57	27,741,742	3,120.08	28,579,972	9.31
6	ケイマン	投資信託受益証券	グローバル・マルチ・ストラテジーズ・U.S.ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（為替ヘッジあり）	2,256.6645	9,806.56	22,130,136	9,863.27	22,258,112	7.25
7	ケイマン	投資信託受益証券	グローバル・マルチ・ストラテジーズ・U.S.ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（為替ヘッジなし）	2,039.1786	10,099.28	20,594,236	9,867.92	20,122,464	6.56

□ 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	37.36
投資証券	59.84
合計	97.21

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	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	642,000.00	72,733,485	72,167,220	23.52

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成29年2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算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計算期間末（平成29年1月10日）	217,103,715	219,157,491	1.0571	1.0671
平成28年7月末日	37,872,827		1.0000	
8月末日	84,853,278		1.0054	
9月末日	124,892,391		0.9941	
10月末日	134,113,675		1.0007	
11月末日	180,311,987		1.0353	
12月末日	212,505,889		1.0611	
平成29年1月末日	239,543,129		1.0545	
2月末日	306,712,018		1.0737	

【分配の推移】

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	平成28年7月29日～平成29年1月10日	0.0100

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（％）
第1計算期間	平成28年7月29日～平成29年1月10日	6.7

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。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計算期間	平成28年7月29日～平成29年1月10日	225,115,446	19,737,755	205,377,691

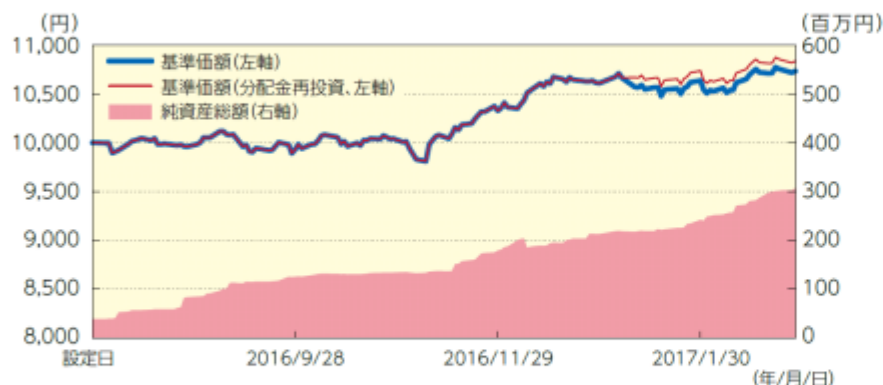
(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

< 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2月28日現在

基準価額・純資産の推移 2016年7月29日(設定日)～2017年2月28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保証するものではありません。

基準価額・純資産総額

基準価額	10,737円
純資産総額	307百万円

期間騰落率(年率換算前)

期間	ファンド
1ヶ月	1.8%
3ヶ月	4.7%
6ヶ月	7.8%
1年	—
3年	—
設定来	8.4%

- 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、税金等を考慮していません。
- 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。

主要な資産の状況

■資産構成比*

組入れファンド・資産	純資産比
先進国債券	38.2%
ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・ターム・インベストメント・グレード・フィクスト・インカム・ファンド	24.4%
グローバル・マルチ・ストラテジーズ・U.S.・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジあり)	7.3%
グローバル・マルチ・ストラテジーズ・U.S.・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジなし)	6.6%
グローバル株式	59.0%
うち、先進国好配当株式(為替ヘッジあり)	23.5%
ウィズダムツリー・U.S.クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド	14.2%
ウィズダムツリー・インターナショナル・ヘッジド・クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド	9.3%
ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド	23.4%
ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド	12.1%
現預金・その他	2.8%
合計	100.0%

- 「先進国債券」および「グローバル株式」欄は、組入れる投資信託証券の構成比を示しています。

*構成比は純資産総額に対する比率です。また、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。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

決算日	2017年1月	2017年7月	2018年1月	2018年7月	2019年1月	設定来累計
分配金	100円	—	—	—	—	100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。

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2月28日現在

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。
- 2016年は設定日から年末までの騰落率、2017年は2月末までの騰落率です。

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「ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショートターム・インベストメント・グレード・フィクスト・インカム・ファンド」、「グローバル・マルチ・ストラテジーズ・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジあり) / (為替ヘッジなし)」、「ウィズダムツリー・U.S.クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド」、「ウィズダムツリー・インターナショナル・ヘッジド・クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド」、「ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド」および「ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・パリュール・ファンド」の運用状況です。

※当頁はディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・リミテッド、アリアンツ・グローバル・インベスターズおよびウィズダムツリー・アセット・マネジメント・インクのデータを基に委託会社が作成しています。

※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。

ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショートターム・インベストメント・グレード・フィクスト・インカム・ファンド

※各項目の比率は、保有債券の時価総額に対する比率を「構成比」としています。

■ポートフォリオ概況

最終利回り	2.2%
平均残存期間	3.1年
平均デュレーション	2.9年
平均格付	A
銘柄数	402銘柄

■種別構成比

債券種別	構成比
国債/政府機関債	21.8%
社債	78.2%
その他	0.0%
合計	100.0%

■格付構成比

格付	構成比
AAA	15.5%
AA	15.8%
A	39.4%
BBB	28.9%
その他	0.4%
合計	100.0%

- 最終利回りは、実際の投資家利回りとは異なります(以下同じ)。
- 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(以下同じ)。
- 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(以下同じ)。

- 格付構成はS&Pの格付における分類です。
- 前月末残高と当月末残高の算術平均(月中平均)により算出しています。

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2月28日現在

グローバル・マルチ・ストラテジーズ・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジあり) グローバル・マルチ・ストラテジーズ・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジなし)

※各項目の比率は、組入れファンドの純資産額に対する比率を「純資産比」としています。

■ポートフォリオ概況

最終利回り	4.6%
平均残存期間	3.8年
平均デュレーション	3.2年
平均格付	BB-
銘柄数	58銘柄

■種別構成比

債券種別	純資産比
債券	94.7%
バンク・ローン	0.0%
現預金等	5.3%
合計	100.0%

■格付構成比

格付	純資産比
BBB以上	3.9%
BB	56.9%
B	28.4%
CCC以下	2.7%
無格付	2.8%
現預金等	5.3%
合計	100.0%

●格付構成はS&Pの格付における分類です。

ウィズダムツリー・U.S.クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド

※各項目の比率は、保有株式の時価総額に対する比率を「構成比」としています。

■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:297銘柄)

銘柄名	国	業種	構成比
ジョンソン・エンド・ジョンソン	米国	ヘルスケア	5.8%
アップル	米国	情報技術	3.9%
マイクロソフト	米国	情報技術	3.3%
アルトリア・グループ	米国	生活必需品	3.3%
ペプシコ	米国	生活必需品	2.8%

●国・地域は組入れ銘柄のリスク所在国を示しています(以下同じ)。

●当該銘柄の売買を推奨するものではありません(以下同じ)。

■業種別構成比

業種	構成比
情報技術	20.4%
ヘルスケア	19.1%
資本財・サービス	18.6%
一般消費財・サービス	17.1%
生活必需品	15.6%
その他	9.3%
合計	100.0%

ウィズダムツリー・インターナショナル・ヘッジド・クオリティ・ディビデンド・グロース・ファンド

※各項目の比率は、保有株式の時価総額に対する比率を「構成比」としています。

■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:220銘柄)

銘柄名	国	業種	構成比
ユニリーバ	オランダ	生活必需品	6.0%
プリティッシュ・アメリカン・タバコ	英国	生活必需品	5.7%
ロシュ・ホールディング	スイス	ヘルスケア	5.2%
エアバス・グループ	オランダ	資本財・サービス	3.5%
LVMHモエヘネシー・ルイヴィトン	フランス	一般消費財・サービス	3.1%

■業種別構成比

業種	構成比
一般消費財・サービス	20.2%
資本財・サービス	19.9%
生活必需品	17.8%
ヘルスケア	17.5%
情報技術	9.2%
その他	15.4%
合計	100.0%

■国別構成比

国	構成比
英国	18.6%
スイス	12.3%
オランダ	12.1%
日本	10.9%
フランス	6.8%
その他	39.3%
合計	100.0%

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2月28日現在

ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド

※各項目の比率は、組入れファンドの純資産額に対する比率を「純資産比」としています。

■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:6,458銘柄)

銘柄名	国	業種	純資産比
アップル	米国	情報技術	1.6%
マイクロソフト	米国	情報技術	0.9%
AT&T	米国	電気通信サービス	0.8%
アルファベット	米国	情報技術	0.7%
JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー	米国	金融	0.7%

■業種別構成比

業種	純資産比
金融	18.1%
一般消費財・サービス	13.9%
資本財・サービス	13.8%
情報技術	13.3%
ヘルスケア	9.8%
その他	31.0%
合計	100.0%

■国別構成比

国	純資産比
米国	60.2%
日本	9.7%
英国	6.3%
カナダ	3.7%
ドイツ	3.0%
その他	17.2%
合計	100.0%

ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド

※各項目の比率は、組入れファンドの純資産額に対する比率を「純資産比」としています。

■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:1,892銘柄)

銘柄名	国	業種	純資産比
中国建設銀行	中国	金融	3.5%
ヴァーレ	ブラジル	素材	2.6%
ブラジル石油公社	ブラジル	エネルギー	2.5%
中国工商銀行	中国	金融	1.8%
リライアンス・インダストリーズ	インド	エネルギー	1.6%

■業種別構成比

業種	純資産比
金融	32.2%
素材	17.2%
エネルギー	13.6%
一般消費財・サービス	10.4%
情報技術	9.4%
その他	17.2%
合計	100.0%

■国別構成比

国	純資産比
中国	16.8%
台湾	16.3%
韓国	16.0%
インド	12.1%
ブラジル	9.4%
その他	29.3%
合計	100.0%

組入れファンド合計

■先進国債券・ポートフォリオ概況

最終利回り	3.1%
平均残存期間	3.3年
平均デュレーション	3.0年
平均格付	BBB+
銘柄数	460銘柄

■グローバル株式・ポートフォリオ概況

	銘柄数	配当利回り
先進国好配当株式	517銘柄	2.4%
米国株式	297銘柄	2.2%
先進国株式（北米除く）	220銘柄	2.6%
	銘柄数	
先進国株式	6,458銘柄	
新興国株式	1,892銘柄	

■国別構成比

先進国債券		グローバル株式	
国	純資産比	国	構成比
米国	67.7%	米国	48.1%
英国	3.9%	日本	5.6%
スウェーデン	3.5%	英国	5.4%
フランス	2.9%	中国	3.5%
その他	22.0%	その他	37.4%
合計	100.0%	合計	100.0%

- 国・地域は組入れ銘柄の発行体の所在国・地域（先進国債券）、リスク所在国（グローバル株式）をそれぞれ示しています。
- 先進国債券の純資産比は組入れファンドの純資産額に対する比率です。グローバル株式の構成比は保有株式の時価総額に対する比率です。

第2【管理及び運営】

<訂正前>

1【申込（販売）手続等】

（中略）

（7）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）

（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）

（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）

（以下略）

<訂正後>

1【申込（販売）手続等】

（中略）

（7）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）

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) 本ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成28年7月29日（設定日）から平成29年1月10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・グローバル・バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 平成29年 1月10日現在
資産の部		
流動資産		
預金		778,252
コール・ローン		8,292,537
投資信託受益証券		81,312,851
投資証券		128,842,389
派生商品評価勘定		646,721
その他未収収益		5,397
流動資産合計		219,878,147
資産合計		219,878,147
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金		2,053,776
未払受託者報酬		16,229
未払委託者報酬		584,232
未払利息		22
その他未払費用		120,173
流動負債合計		2,774,432
負債合計		2,774,432
純資産の部		
元本等		
元本		205,377,691
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,726,024
（分配準備積立金）		10,557,385
元本等合計		217,103,715
純資産合計		217,103,715
負債純資産合計		219,878,147

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 平成28年 7月29日 至 平成29年 1月10日
営業収益	
受取配当金	1,427,232
有価証券売買等損益	10,915,096
為替差損益	219,558
その他収益	7,166
営業収益合計	12,129,936
営業費用	
支払利息	5,365
受託者報酬	16,229
委託者報酬	584,232
その他費用	251,831
営業費用合計	857,657
営業利益又は営業損失()	11,272,279
経常利益又は経常損失()	11,272,279
当期純利益又は当期純損失()	11,272,279
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()	714,894
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,372,230
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,372,230
剰余金減少額又は欠損金増加額	149,815
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	149,815
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	2,053,776
期末剰余金又は期末欠損金()	11,726,024

(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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 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。
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相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券および投資証券の収益分配落ち日において、当該収益分配金金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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。 (2) ファンドの計算期間 本ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から1月10日まで及び、1月11日から7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、平成28年7月29日から平成29年1月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	205,377,691口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0571円
(10,000口当たり純資産額)	(10,571円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成28年7月29日 至 平成29年1月10日		
分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	A	1,278,726円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	9,278,659円
収益調整金額	C	3,222,415円
分配準備積立金額	D	0円
本ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,779,800円
本ファンドの期末残存口数	F	205,377,691口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	670円
10,000口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,053,776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1期 自 平成28年 7月29日 至 平成29年 1月10日
1. 金融商品に対する取組方針		<p>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。</p> <p>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。</p> <p>これらは、株価変動リスク、投資信託受益証券および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。</p> <p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク		
3. 金融商品に係るリスクの管理体制		

金融商品の時価等に関する事項

項目	期別	第1期 平成29年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		<p>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。</p> <p>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。 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。</p> <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。</p>
2. 時価の算定方法		
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		

（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1期 自 平成28年 7月29日 至 平成29年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	37,872,569円
期中追加設定元本額	187,242,877円
期中一部解約元本額	19,737,755円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 平成29年 1月10日現在	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		2,482,369
投資証券		7,379,919
合計		9,862,288

（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1期（平成29年 1月10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	50,466,521	-	49,819,800	646,721
	アメリカドル	50,466,521	-	49,819,800	646,721
	合計	50,466,521	-	49,819,800	646,721

時価の算定方法

1 為替予約取引

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

計算期間末日において為替予約の受渡日（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。

計算期間末日において当該日の対顧客先物売買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。

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

2) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算期間末日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	投資信託受益証券	グローバル・マルチ・ストラテジーズ・U S・ショート・デュレーション・ハイ・ イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジ あり)	1,646.3877	16,130,136	
		グローバル・マルチ・ストラテジーズ・U S・ショート・デュレーション・ハイ・ イールド・ボンド・ファンド(為替ヘッジ なし)	1,435.4997	14,594,236	
	投資信託受益証券 小計		3,081.8874	30,724,372	
	投資証券	ディメンショナル・ファンズ・ピーエル シー グローバル・コア・エクイティ・ ファンド	43,750.243	50,794,032	
		ディメンショナル・ファンズ・ピーエル シー エマージング・マーケット・バ リュュー・ファンド	26,629.917	25,035,850	
		ディメンショナル・ファンズ・ピーエル シー グローバル・ショートターム・イン ベストメント・グレード・フィクスト・イン カム・ファンド	54,113.169	53,012,507	
	投資証券 小計		124,493.329	128,842,389	
日本円合計			127,575.2164	159,566,761	
アメリカ ドル	投資信託受益証券	ウィズダムツリー・U・S・クオリティ・ ディビデンド・グロース・ファンド	7,818	263,388.42	
		ウィズダムツリー・インターナショナル・ ヘッジド・クオリティ・ディビデンド・グ ロース・ファンド	6,460	172,869.60	
アメリカドル合計			14,278	436,258.02 (50,588,479)	
合計				210,155,240 (50,588,479)	

(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	組入投資信託 受益証券 時価比率(注)	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券 2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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成29年2月28日現在

資産総額	393,944,742円
負債総額	87,232,724円
純資産総額（ - ）	306,712,018円
発行済口数	285,671,026口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0737円
（1万口当たり純資産額）	（10,737円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として第二種金融商品取引業にかかる業務の一部として勧誘業務を行うことができます。

なお、平成28年5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	16	57,636,500,628
単位型株式投資信託	2	55,543,520,221
合計	18	113,180,020,849

<訂正後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として第二種金融商品取引業にかかる業務の一部として勧誘業務を行うことができます。

なお、平成29年2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	21	50,438,048,019
単位型株式投資信託	5	62,174,857,721
合計	26	112,612,905,740

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) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社であるあおぞら投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「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。

また、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）」（以下、「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

財務諸表及び中間財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間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27年 3月31日現在)		当事業年度末 (平成28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		228,895		128,778
前払費用			1,752		2,713
未収入金	2		56,199		43,422
未収委託者報酬			27,445		57,504
未収消費税等			4,012		-
流動資産計			318,305		232,418
固定資産					
有形固定資産	1		6,602		4,376
建物		6,246		4,176	
器具備品		355		199	
固定資産計			6,602		4,376
資産合計			324,907		236,794
(負債の部)					
流動負債					
未払金			55,332		71,044
未払手数料	2	13,590		27,651	
その他未払金	2	41,741		43,392	
未払費用			601		2,974
未払法人税等			1,133		643
未払消費税等			-		5,097
預り金			6,026		9,955
流動負債計			63,093		89,715
固定負債					
資産除去債務			5,906		7,542
繰延税金負債			1,782		1,169
固定負債計			7,689		8,712
負債合計			70,782		98,427
(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			195,874		311,633
その他利益剰余金					
繰越利益剰余金		195,874		311,633	
純資産合計			254,125		138,366
負債・純資産合計			324,907		236,794

(2) 【損益計算書】

期別	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年 3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28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		67,378		298,400	
営業収益計			67,378		298,400
営業費用					
支払手数料	1	32,963		136,077	
支払投資顧問料		1,505		28,216	
広告宣伝費		8,633		12,139	
調査費		6,284		7,960	
委託計算費		23,176		9,736	
営業雑経費		18,956		16,346	
通信費		1,300		1,503	
印刷費		12,196		14,292	
協会費		5,458		551	
営業費用計			91,520		210,476
一般管理費					
給料	1	171,420		191,112	
役員報酬		45,944		49,442	
給料・手当		95,781		111,675	
賞与		29,694		29,994	
法定福利費	1	16,844		19,963	
交際費		447		783	
旅費交通費		9,377		7,994	
租税公課		1,464		1,446	
不動産賃借料	1	9,093		9,093	
賃借料	1	2,954		3,648	
固定資産減価償却費		636		3,753	
資産除去債務利息費用		85		109	
支払報酬料		8,284		7,252	
消耗品費		1,095		584	
保守修理費		-		50	
会議費		831		819	
保険料		301		250	
送金手数料		105		512	
一般管理費計			222,941		247,373
営業損失			247,082		159,449
営業外収益					
受取利息	1	72		32	
雑収入		-		5	
営業外収益計			72		38
經常損失			247,010		159,410
税引前当期純損失			247,010		159,410
法人税、住民税及び事業税	1		55,898		43,039
法人税等調整額			1,782		613
当期純損失			192,894		115,758

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年 4月 1日 至 平成27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	2,979	2,979	447,020	447,020
当期変動額							
当期純損失				192,894	192,894	192,894	192,894
当期変動額合計	-	-	-	192,894	192,894	192,894	192,894
当期末残高	225,000	225,000	225,000	195,874	195,874	254,125	254,125

当事業年度（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

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

当社は、当事業年度において、平成29年5月にオフィスを移転することを決定いたしました。これにより、移転に伴い利用不能となるオフィスの「建物」資産について、耐用年数を移転予定月までの期間に短縮し、将来にわたり変更しております。

また、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も、支出発生までの見込期間を相当年数短縮し、償却期間の変更を行っております。

この変更の結果、従来の方法に比べて、当計算期間の営業損失、経常損失および税引前当期純損失がそれぞれ3,191千円増加しております。

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27年 3月31日現在)	当事業年度 (平成28年 3月31日現在)
有形固定資産の減価償却累計額	658千円	4,412千円

2．関係会社に対する資産・負債

	前事業年度 (平成27年 3月31日現在)	当事業年度 (平成28年 3月31日現在)
流動資産		
預金	200,865千円	90,633千円
未収入金	56,199	43,422
流動負債		
未払手数料	12,719	23,974
その他未払金	31,958	35,343

（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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
支払手数料	31,235千円	99,921千円
給料	171,420	191,112
法定福利費	16,844	19,764
不動産賃借料	9,093	9,093
賃借料	2,298	2,674
受取利息	72	32
法人税、住民税及び事業税	56,199	43,422

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26年 4月 1日 至 平成27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

（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27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	228,895	228,895	-
(2) 未収入金	56,199	56,199	-
(3) 未収委託者報酬	27,445	27,445	-
資産計	312,540	312,540	-
(1) 未払手数料	13,590	13,590	-
(2) その他未払金	41,741	41,741	-
負債計	55,332	55,332	-

当事業年度（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	-

（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27年 3月31日現在）（単位：千円）

	1年以内	1年超
(1) 現金・預金	228,895	-
(2) 未収入金	56,199	-
(3) 未収委託者報酬	27,445	-
合計	312,540	-

当事業年度（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	-

(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27年 3月31日現在)	当事業年度 (平成28年 3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	198	917
未払賞与	10,491	10,832
資産除去債務	1,907	2,327
未払事業税	234	109
未払事業所税	46	42
繰越欠損金	18,725	30,136
減価償却超過額	-	70
繰延資産償却超過額	1,326	951
繰延税金資産小計	32,930	45,388
評価性引当額	32,930	45,388
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	1,782	1,169
繰延税金負債合計	1,782	1,169
繰延税金資産(負債)の純額	1,782	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。

3. 決算日後の税率変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

平成28年3月31日に「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が公布され、平成28年4月1日以降開始する事業年度より法人税率等が変更されることとなりました。

これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用される法定実効税率は、一時差異等に係る解消時期に応じて以下のとおりとなります。

平成30年3月31日まで 30.86%

平成30年4月 1日以降30.62%

この税率の変更により、当事業年度末における一時差異等を基礎として再計算した結果、固定負債に計上されている繰延税金負債の金額が53千円減少し、法人税等調整額（借方）が同額減少しております。

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 平成26年 4月 1日 至 平成27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19年と見積り、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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
期首残高	-
有形固定資産の取得に伴う増加額	5,820
時の経過による調整額	85
期末残高	5,906

当事業年度（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)

当事業年度	
(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

(4) 資産除去債務の見積りの変更の内容及び影響額

当事業年度において、オフィスを移転することを決定いたしました。これに伴い、当該オフィスの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、償却に係る合理的な期間を短縮し、将来にわたり変更しております。これによる資産除去債務の増加額は、1,527千円であります。

（セグメント情報等）

前事業年度（自 平成26年 4月 1日 至 平成27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。

(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26年 4月 1日 至 平成27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%	役員の受入 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	56,199	未収入金	56,199
							出向者負担金	187,939	その他未払金	31,958
							代行手数料	31,235	未払手数料	12,719

当事業年度(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%	役員の受入 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

(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26年 4月 1日 至 平成27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	1,722	未払手数料	865

当事業年度(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

(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26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
1株当たり純資産額	28,236.15円	15,374.10円
1株当たり当期純損失金額	21,432.77円	12,862.04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26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
当期純損失(千円)	192,894	115,758
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)	192,894	115,758
普通株式の期中平均株式数(株)	9,000	9,000

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

期別	注記 番号	当中間会計期間末 (平成28年 9月30日現在)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金			156,377
前払費用			2,143
未収入金			13,441
未収委託者報酬			63,349
流動資産計			235,310
固定資産			
有形固定資産	1		3,503
建物		2,378	
器具備品		138	
建設仮勘定		986	
固定資産計			3,503
資産合計			238,813
(負債の部)			
流動負債			
未払金			83,785
未払手数料		30,587	
その他未払金		53,198	
未払費用			9,190
未払法人税等			1,326
未払消費税等			5,584
預り金			21,577
資産除去債務			7,598
繰延税金負債			668
流動負債計			129,731
負債合計			129,731
(純資産の部)			
株主資本			
資本金			225,000
資本剰余金			225,000
資本準備金		225,000	
利益剰余金			340,917
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		340,917	
純資産合計			109,082
負債・純資産合計			238,813

(2) 中間損益計算書

期別	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)	
	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業収益		
委託者報酬	248,248	
営業収益計		248,248
営業費用		
支払手数料	111,002	
支払投資顧問料	26,171	
広告宣伝費	7,907	
調査費	4,605	
委託計算費	12,278	
営業雑経費	11,692	
通信費	867	
印刷費	10,267	
協会費	557	
営業費用計		173,657
一般管理費		
給料	93,194	
役員報酬	24,659	
給料・手当	57,077	
賞与	11,458	
法定福利費	10,053	
交際費	252	
旅費交通費	3,575	
租税公課	1,607	
不動産賃借料	4,546	
賃借料	1,931	
固定資産減価償却費	1,859	
資産除去債務利息費用	55	
支払報酬料	3,601	
消耗品費	179	
保守修理費	49	
会議費	38	
保険料	274	
送金手数料	280	
一般管理費計		121,500
営業損失		46,909
営業外収益		
受取利息	5	
雑収入	5,097	
営業外収益計		5,102
経常損失		41,807
税引前中間純損失		41,807
法人税、住民税及び事業税		12,021
法人税等調整額		501
中間純損失		29,284

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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
当中間期変動額							
中間純損失				29,284	29,284	29,284	29,284
当中間期変動額合計	-	-	-	29,284	29,284	29,284	29,284
当中間期末残高	225,000	225,000	225,000	340,917	340,917	109,082	109,082

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. その他中間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。

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）を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間（平成28年 9月30日現在）

1. 有形固定資産の減価償却累計額 6,271千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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	9,000株	-	-	9,000株

（金融商品関係）

1．金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

当中間会計期間（平成28年 9月30日現在）

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	156,377	156,377	-
(2) 未収入金	13,441	13,441	-
(3) 未収委託者報酬	63,349	63,349	-
資産計	233,167	233,167	-
(1) 未払手数料	30,587	30,587	-
(2) その他未払金	53,198	53,198	-
負債計	83,785	83,785	-

（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。

（資産除去債務関係）

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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) 資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

期首残高	7,542
時の経過による調整額	55
期末残高	7,598

（セグメント情報等）

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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・サービスの区別の外部顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

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、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。

(1株当たり情報)

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日）

1株当たり純資産額	12,120.26円
1株当たり中間純損失金額	3,253.84円

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、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。

(注) 1株当たり中間純損失金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
中間純損失(千円)	29,284
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純損失(千円)	29,284
普通株式の期中平均株式数(株)	9,000

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

(中略)

342,037百万円(平成28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28年3月末現在)

(中略)

(2) 販売会社

(平成28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	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

<訂正後>

(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29年2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	

第3【その他】

<訂正前>

(前略)

10. 目論見書の表紙に、本ファンドの愛称は委託会社の登録商標である旨、または商標登録申請中である旨を記載することがあります。

(以下略)

<訂正後>

(前略)

10. 目論見書の表紙に、本ファンドの愛称は委託会社の登録商標である旨を記載することがあります。

(以下略)

独立監査人の監査報告書

平成29年3月10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・グローバル・バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）の平成28年7月29日から平成29年1月10日までの計算期間の財務諸表、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・グローバル・バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）の平成29年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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28年5月10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 佐藤嘉雄印
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27年4月1日から平成28年3月31日までの第3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28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月17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期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、あおぞら投信株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（注）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。