

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	平成30年4月10日
<b>【発行者名】</b>	あおぞら投信株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役 原田 政明
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区麹町六丁目1番地1
<b>【事務連絡者氏名】</b>	木村 升昭
<b>【電話番号】</b>	03-6752-1050
<b>【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】</b>	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）
<b>【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】</b>	継続申込期間（平成29年10月11日から平成30年10月10日まで） 2兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成29年10月10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\*<sup>1</sup>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\*<sup>2</sup>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）	11.3%
年間最大変動率の目安	±22.6%

※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（2017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。

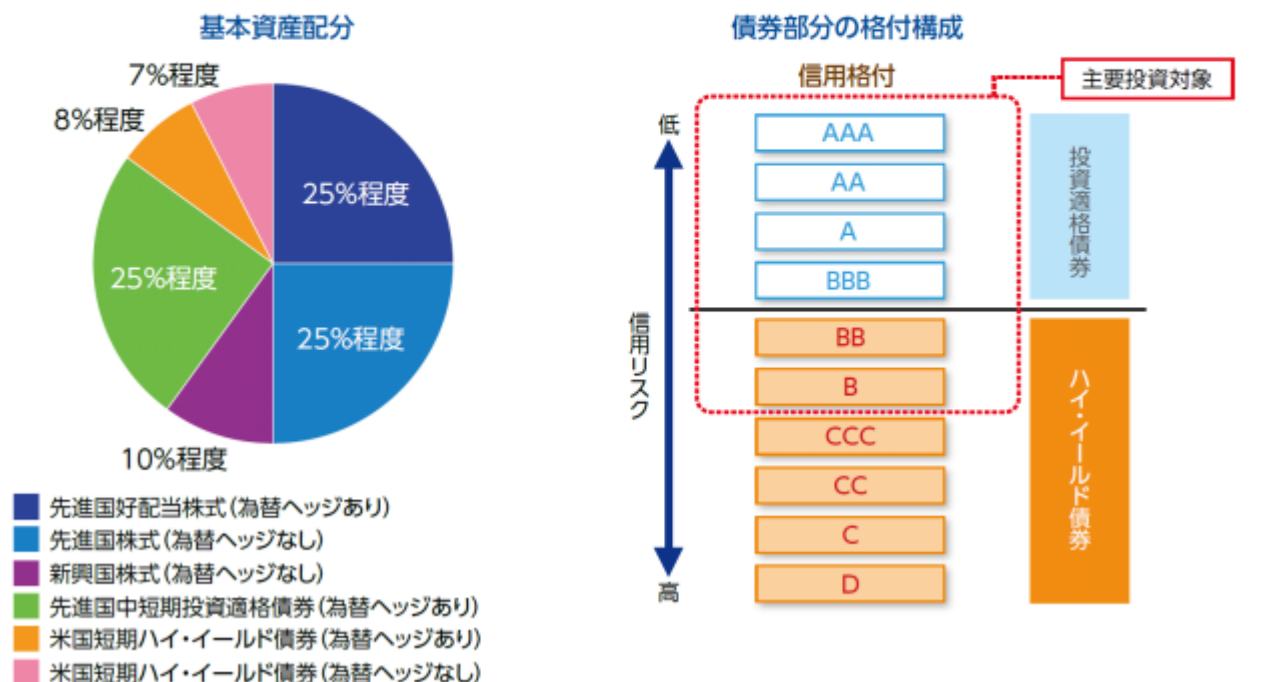
※期待リターンは、ビルディング・ブロック（積木）法という概念を用いて算出します。ビルディング・ブロック法とは、無リスク資産（国債金利等）のリターンに対して、リスクプレミアム（リスクをとる見返りに投資家が要求する超過収益）を上乗せしていく手法です。ただし、期待リターンは長期的な視点で推計された期待値であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。従って、投資者の元本が保証されるものではなく、本ファンドの基準価額は下落する場合があります。また、期待リターンは運用管理費用（信託報酬）控除後のものであり、その他の費用等は考慮していません。

※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。

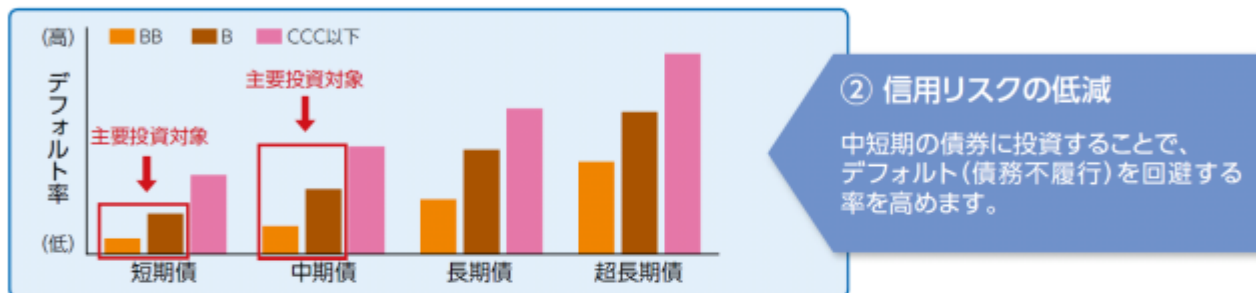
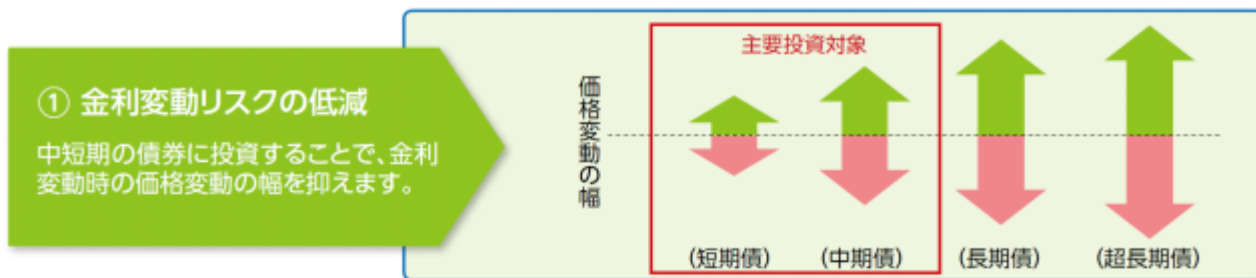
## 資産配分について

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いことをいいます。

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

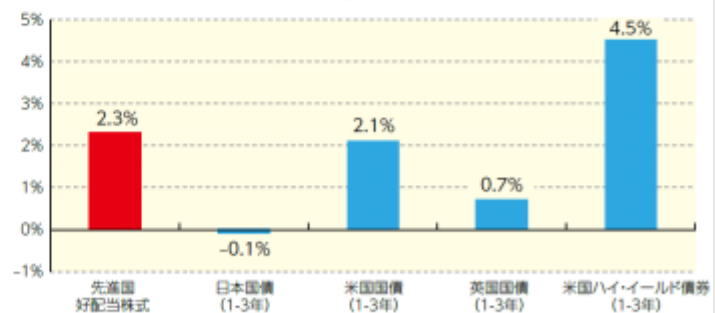
本ファンドは、上場投資信託証券（ETF）を通じて先進国の好配当株式に投資します。先進国の株式の中で、相対的に配当利回り\*が高い銘柄の中から、企業の質（収益性、成長性）に着目して投資を行います。

### 好配当株式のイメージ



\* 配当利回りとは、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（2018年1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。

日本国債、米国国債、英国国債：FTSE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(2018年1月末現在)

MSCI オールカントリー・ワールド・インデックス  
約2500銘柄



\* 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(2017年12月現在)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5,771億米ドル(約65兆円)  
【従業員数】約1,200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：  
2017年12月末現在、1米ドル=112.65円で換算



Understand. Act.

### アリアンツ・グループ

【運用資産残高】約265兆円

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：  
2017年12月末現在、1ユーロ=135.2701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（2017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468億米ドル（約5.3兆円）

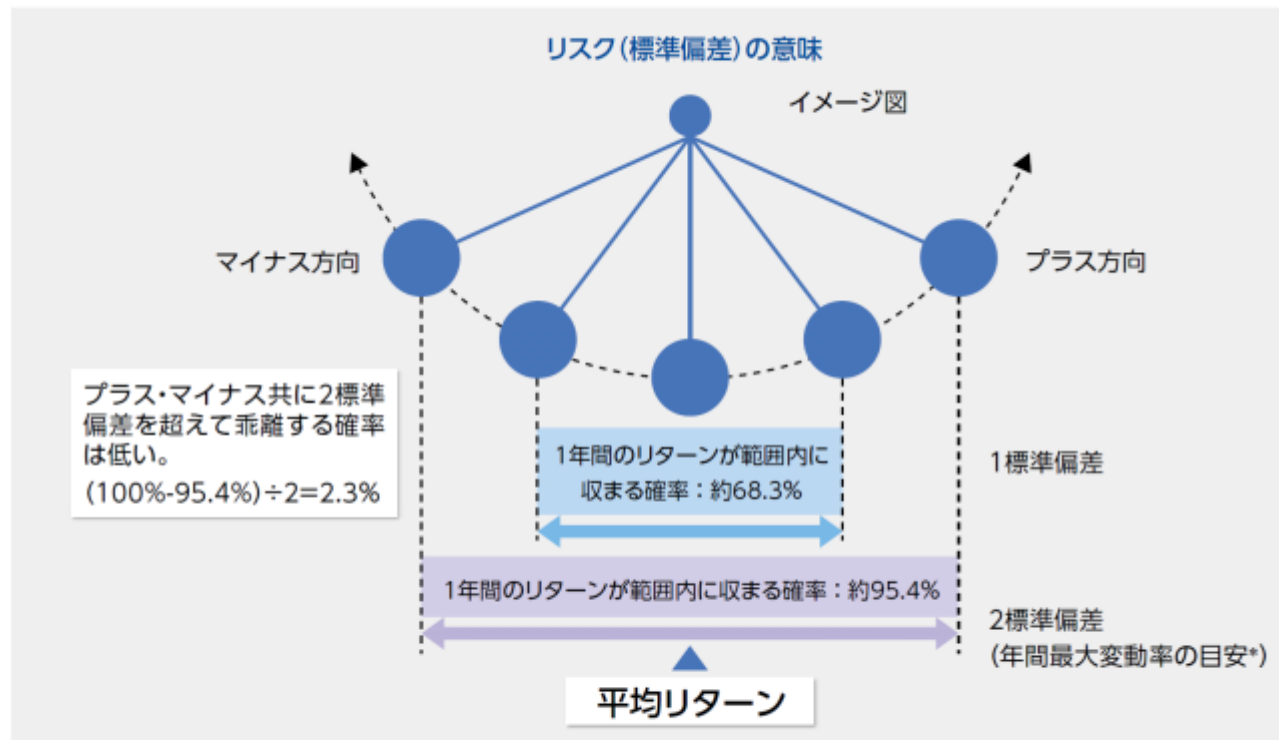
【従業員数】約200名

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：

2017年12月末現在、1米ドル=113.00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）の意味を理解して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。

### （3）【ファンドの仕組み】

#### ファンドの仕組み

<訂正前>

（前略）

\*1 損益はすべて投資家である受益者に帰属します。

\*2 上記上場投資信託証券（ETF）は、国内の証券会社で購入可能な場合があります。（2017年6月末現在）

<訂正後>

（前略）

\*1 損益はすべて投資家である受益者に帰属します。

\*2 上記上場投資信託証券（ETF）は、国内の証券会社で購入可能な場合があります。（2017年12月末現在）

## 2【投資方針】

### （2）【投資対象】

<訂正前>

（前略）

指定投資信託証券の概要 a.

（中略）

<p>主な投資制限</p>	<p>コマーシャル・ペーパーへの投資にあたっては、<u>格付機関ムーディーズ格付Prime1、S&amp;P格付A1以上、またはフィッチ格付F1以上の発行体に投資するもの</u>とします。</p> <p>その他の公社債への投資にあたっては、<u>格付機関ムーディーズ格付Baa3、S&amp;P格付BBB-、またはフィッチによる格付BBB-以上の発行体に投資するもの</u>とします。格付がないものについては、運用会社がこれらと同等以上と判断するものとします。</p> <p>リスク管理等を目的として、金融派生商品に投資することがあります。その際、為替予約取引および先物取引以外の金融派生商品の利用を目指すものではありません。また実質的な投資比率が資産総額の100%を超えるような取引は行いません。</p>
---------------	---

（以下略）

<訂正後>

（前略）

指定投資信託証券の概要 a.

（中略）

<p>主な投資制限</p>	<p>コマーシャル・ペーパーへの投資にあたっては、<u>主要な格付機関においてPrime1、A1またはF1以上の発行体に投資するもの</u>とします。</p> <p>その他の公社債への投資にあたっては、<u>主要な格付機関においてBaa3またはBBB-以上の発行体に投資するもの</u>とします。格付がないものについては、運用会社がこれらと同等以上と判断するものとします。</p> <p>リスク管理等を目的として、金融派生商品に投資することがあります。その際、為替予約取引および先物取引以外の金融派生商品の利用を目指すものではありません。また実質的な投資比率が資産総額の100%を超えるような取引は行いません。</p>
---------------	---

（以下略）



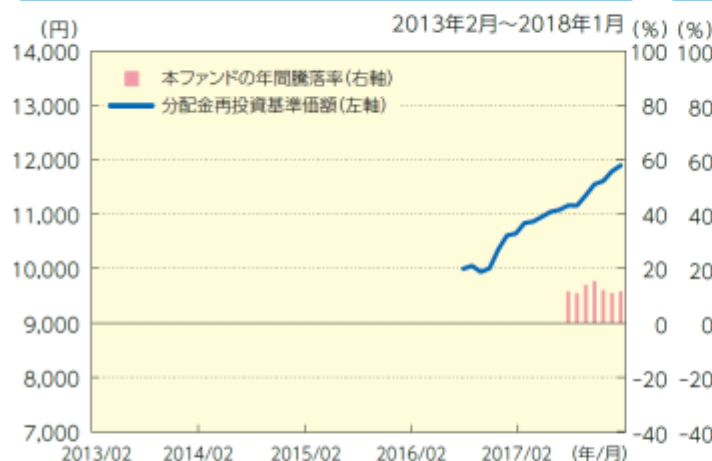
### 3【投資リスク】

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

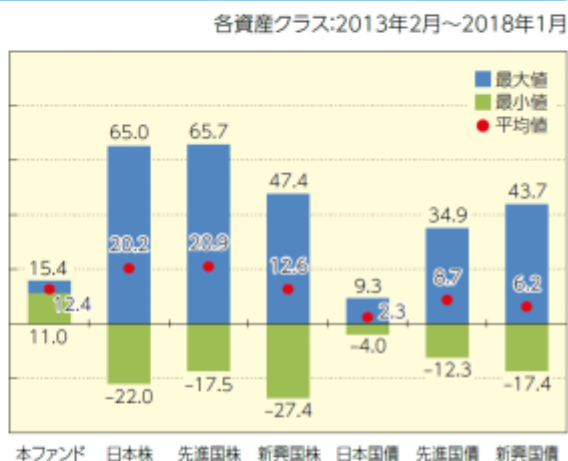


※本ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

※本ファンドの設定日が2016年7月29日のため、本ファンドの年間騰落率は2017年7月以降のデータを、分配金再投資基準価額は2016年7月末以降のデータをそれぞれ表示しています。

##### 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



※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、本ファンドについては2018年1月の月末の直近1年間の騰落率を表示しています。

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

#### <代表的な各資産クラスの指数>

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

先進国債・・・FTSE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。

※FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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、当該指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income 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。

## 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>

以下の運用状況は平成30年1月31日現在です。

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	71,334,988	23.31
	ケイマン	43,930,384	14.35
	小計	115,265,372	37.67
投資証券	アイルランド	184,373,642	60.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,291,053	2.05
合計(純資産総額)		305,930,067	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		71,797,820	23.46

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アイルランド	投資証券	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	77,218.429	967.8	74,732,093	964.74	74,495,707	24.35
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	53,635.336	1,365.06	73,215,556	1,346.14	72,200,671	23.60
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・ディビデント・グロース・ファンド	9,149	4,633.49	42,391,839	4,750.85	43,465,611	14.20
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・バリュア・ファンド	30,844.069	1,216.04	37,507,701	1,221.54	37,677,264	12.31
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・ディビデント・グロース・ファンド	7,974	3,537.48	28,207,874	3,495.03	27,869,377	9.10
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)	2,462.5808	9,618.62	23,686,646	9,609.82	23,664,977	7.73
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)	2,129.8936	9,825.49	20,927,263	9,514.75	20,265,407	6.62

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	37.67
投資証券	60.26
合計	97.94

## 【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	661,000.00	72,757,063	71,797,820	23.46

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

平成30年1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
第2計算期間末 （平成29年 7月10日）	293,364,842	296,044,816	1.0947	1.1047
第3計算期間末 （平成30年 1月10日）	305,182,199	307,806,354	1.1630	1.1730
平成29年 1月末日	239,543,129		1.0545	
2月末日	306,712,018		1.0737	
3月末日	340,780,188		1.0764	
4月末日	357,280,432		1.0850	
5月末日	322,382,811		1.0942	
6月末日	296,549,938		1.0976	
7月末日	314,991,650		1.0956	
8月末日	319,438,868		1.0952	
9月末日	304,136,153		1.1136	
10月末日	286,597,681		1.1337	
11月末日	285,984,369		1.1396	
12月末日	303,599,087		1.1569	
平成30年 1月末日	305,930,067		1.1576	

## 【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
第2計算期間	平成29年 1月11日～平成29年 7月10日	0.0100
第3計算期間	平成29年 7月11日～平成30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
第2計算期間	平成29年 1月11日～平成29年 7月10日	4.5
第3計算期間	平成29年 7月11日～平成30年 1月10日	7.2

(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】

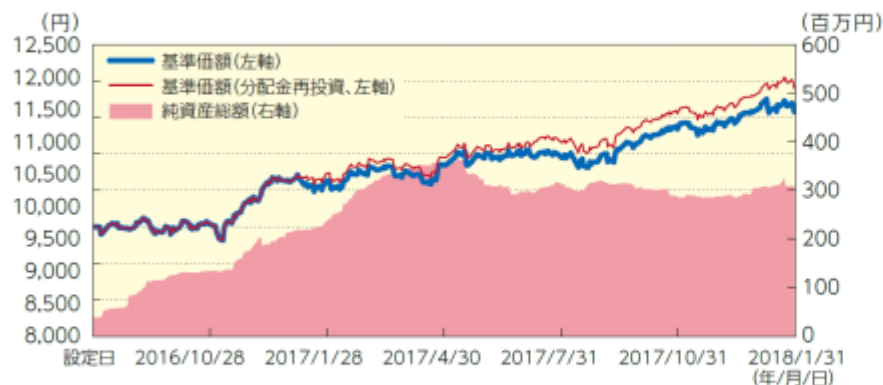
期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1計算期間	平成28年 7月29日～平成29年 1月10日	225,115,446	19,737,755	205,377,691
第2計算期間	平成29年 1月11日～平成29年 7月10日	171,602,579	108,982,833	267,997,437
第3計算期間	平成29年 7月11日～平成30年 1月10日	69,457,017	75,038,941	262,415,513

(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。

## &lt; 参考情報 &gt;

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。

2018年1月31日現在

**基準価額・純資産の推移** 2016年7月29日(設定日)～2018年1月31日

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

**基準価額・純資産総額**

基準価額	11,576円
純資産総額	306百万円

**期間騰落率 (年率換算前)**

期間	ファンド
1ヶ月	0.9%
3ヶ月	3.0%
6ヶ月	6.6%
1年	11.7%
3年	—
設定来	18.9%

- 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	比率
先進国債券	38.7%
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・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)	7.7%
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)	6.6%
グローバル株式	59.2%
うち、先進国好配当株式(為替ヘッジあり)	23.3%
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	9.1%
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	23.6%
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	12.3%
現預金・その他	2.1%
合計	100.0%

- 「先進国債券」および「グローバル株式」欄は、組入れファンドの比率を示しています。

\*比率は純資産総額に対する割合です。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)**

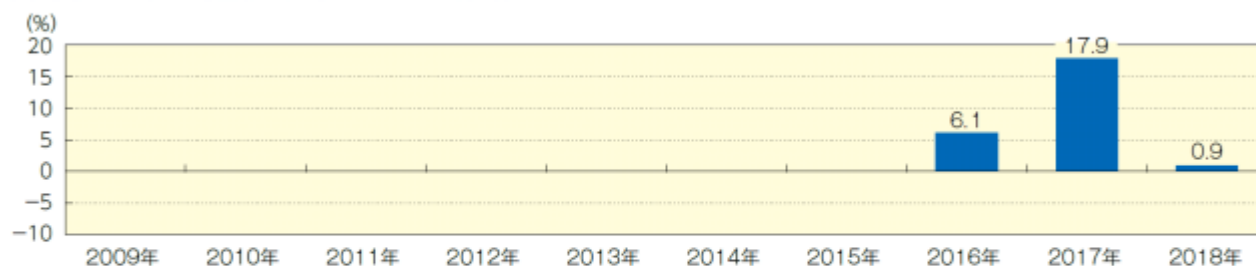
決算日	2017年1月	2017年7月	2018年1月	2018年7月	2019年1月	設定来累計
分配金	100円	100円	100円	—	—	300円

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

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。

2018年1月31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、2018年は1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・バリュー・ファンド」の運用状況です。

※当質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、アライアツ・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割合です。

#### ■ ポートフォリオ概況

最終利回り	2.7%
平均残存期間	3.0年
平均デュレーション	2.9年
平均格付	A
銘柄数	404銘柄

#### ■ 種別構成比

債券種別	比率
国債/政府機関債	24.0%
社債	76.0%
その他	0.0%
合計	100.0%

#### ■ 格付構成比

格付	比率
AAA	13.6%
AA	21.3%
A	39.5%
BBB	25.5%
その他	0.2%
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、該当投資顧問会社が定義した分類によるものです。

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。

2018年1月31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、組入れファンドの資産総額に対する割合です。

■ポートフォリオ概況

最終利回り	4.5%
平均残存期間	3.5年
平均デュレーション	3.0年
平均格付	BB-
銘柄数	69銘柄

■資産構成比

資産	比率
債券	97.9%
バンク・ローン	0.0%
現預金等	2.1%
合計	100.0%

■格付構成比

格付	比率
BBB以上	10.5%
BB	47.0%
B	36.9%
CCC以下	3.5%
無格付	0.0%
現預金等	2.1%
合計	100.0%

●格付構成は、該当投資顧問会社が定義した分類によるものです。

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割合です。

■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:293銘柄)

銘柄名	国	業種	比率
エクソンモービル	米国	エネルギー	5.4%
ジョンソン・エンド・ジョンソン	米国	ヘルスケア	4.6%
ウェルズ・ファーゴ	米国	金融	4.4%
マイクロソフト	米国	情報技術	4.1%
アップル	米国	情報技術	3.6%

- 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	比率
情報技術	20.1%
資本財・サービス	18.7%
ヘルスケア	17.1%
一般消費財・サービス	12.0%
生活必需品	11.4%
その他	20.6%
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割合です。

■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:229銘柄)

銘柄名	国	業種	比率
ノボ・ノルディスク	デンマーク	ヘルスケア	5.5%
ロシュ・ホールディング	スイス	ヘルスケア	5.2%
ユニリーバ	オランダ	生活必需品	4.2%
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	3.5%
プリティッシュ・アメリカン・タバコ	英国	生活必需品	3.4%

■業種別構成比

業種	比率
一般消費財・サービス	19.5%
ヘルスケア	18.7%
生活必需品	18.7%
資本財・サービス	17.7%
情報技術	11.8%
その他	13.6%
合計	100.0%

■国別構成比

国	比率
英国	18.9%
日本	14.9%
スイス	12.3%
オランダ	9.7%
スウェーデン	7.2%
その他	37.0%
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。

2018年1月31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、組入れファンドの資産総額に対する割合です。

### ■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:7,345銘柄)

銘柄名	国	業種	比率
アップル	米国	情報技術	1.5%
マイクロソフト	米国	情報技術	1.1%
アマゾン・ドット・コム	米国	一般消費財・サービス	0.9%
アルファベット	米国	情報技術	0.8%
パークシャー・ハサウェイ	米国	金融	0.6%

### ■業種別構成比

業種	比率
金融	18.0%
情報技術	14.5%
一般消費財・サービス	14.2%
資本財・サービス	13.9%
ヘルスケア	9.9%
その他	29.5%
合計	100.0%

### ■国別構成比

国	比率
米国	58.5%
日本	10.0%
英国	6.5%
カナダ	3.5%
ドイツ	3.3%
その他	18.1%
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、組入れファンドの資産総額に対する割合です。

### ■組入上位5銘柄

(保有銘柄数:1,833銘柄)

銘柄名	国	業種	比率
中国建設銀行	中国	金融	2.9%
ヴァーレ	ブラジル	素材	2.8%
ブラジル石油公社	ブラジル	エネルギー	2.5%
リライアンス・インダストリーズ	インド	エネルギー	2.3%
中国工商銀行	中国	金融	2.3%

### ■業種別構成比

業種	比率
金融	35.5%
素材	17.8%
エネルギー	14.1%
一般消費財・サービス	8.4%
情報技術	8.1%
その他	16.0%
合計	100.0%

### ■国別構成比

国	比率
中国	18.2%
韓国	17.2%
台湾	15.4%
インド	12.3%
ブラジル	9.3%
その他	27.7%
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	3.4%
平均残存期間	3.2年
平均デュレーション	2.9年
平均格付	BBB+
銘柄数	473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	522銘柄	2.1%
米国株式	293銘柄	2.1%
先進国株式（北米除く）	229銘柄	2.2%
	銘柄数	
先進国株式	7,345銘柄	
新興国株式	1,833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	63.1%	米国	47.3%
スウェーデン	5.1%	日本	6.3%
英国	4.6%	英国	5.5%
ドイツ	4.5%	中国	3.9%
その他	22.7%	その他	37.0%
合計	100.0%	合計	100.0%

●国は組入れ銘柄の発行体の所在国（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資産総額に対する割合です。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割合です。



### 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3期計算期間（平成29年7月11日から平成30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2期 平成29年 7月10日現在	第3期 平成30年 1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,148,999	1,599,199
コール・ローン	6,572,190	18,804,000
投資信託受益証券	110,425,860	112,101,349
投資証券	169,442,143	176,742,350
派生商品評価勘定	-	360,366
未収入金	14,147,001	4,457
その他未収収益	10,807	9,606
流動資産合計	301,747,000	309,621,327
資産合計	301,747,000	309,621,327
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,757,916	774
未払金	58,932	-
未払収益分配金	2,679,974	2,624,155
未払解約金	2,051,027	-
未払受託者報酬	41,306	40,855
未払委託者報酬	1,487,057	1,470,723
未払利息	18	51
その他未払費用	305,928	302,570
流動負債合計	8,382,158	4,439,128
負債合計	8,382,158	4,439,128
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	267,997,437	262,415,513
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,367,405	42,766,686
（分配準備積立金）	18,105,913	32,985,066
元本等合計	293,364,842	305,182,199
純資産合計	293,364,842	305,182,199
負債純資産合計	301,747,000	309,621,327

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期			
	自 至	平成29年 平成29年	1月11日 7月10日	自 至	平成29年 平成30年	7月11日 1月10日
<b>営業収益</b>						
受取配当金			2,567,000			3,120,573
有価証券売買等損益			14,285,025			20,375,597
為替差損益			574,842			674,210
その他収益			18,402			18,081
営業収益合計			16,295,585			22,840,041
<b>営業費用</b>						
支払利息			6,636			5,742
受託者報酬			41,306			40,855
委託者報酬			1,487,057			1,470,723
その他費用			509,754			506,255
営業費用合計			2,044,753			2,023,575
営業利益又は営業損失( )			14,250,832			20,816,466
経常利益又は経常損失( )			14,250,832			20,816,466
当期純利益又は当期純損失( )			14,250,832			20,816,466
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( )			3,484,625			1,547,703
期首剰余金又は期首欠損金( )			11,726,024			25,367,405
剰余金増加額又は欠損金減少額			12,365,377			7,873,419
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			12,365,377			7,873,419
剰余金減少額又は欠損金増加額			6,810,229			7,118,746
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額			6,810,229			7,118,746
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			2,679,974			2,624,155
期末剰余金又は期末欠損金( )			25,367,405			42,766,686

## (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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資証券の基準価額で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	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。 本ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。 外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

第2期 平成29年 7月10日現在	第3期 平成30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 267,997,437口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 262,415,513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 1.0947円 (10,000口当たり純資産額) (10,947円)	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 1.1630円 (10,000口当たり純資産額) (11,630円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 平成29年 1月11日 至 平成29年 7月10日	第3期 自 平成29年 7月11日 至 平成30年 1月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
費用控除後の配当等収A 2,027,939円	費用控除後の配当等収A 2,731,362円
益額	益額
費用控除後・繰越欠損B 8,738,268円	費用控除後・繰越欠損B 16,537,401円
金補填後の有価証券等 損益額	金補填後の有価証券等 損益額
収益調整金額 C 9,941,466円	収益調整金額 C 12,405,775円
分配準備積立金額 D 7,339,706円	分配準備積立金額 D 13,716,303円
本ファンドの分配対象 E=A+B+C+D 28,047,379円	本ファンドの分配対象 E=A+B+C+D 45,390,841円
収益額	収益額
本ファンドの期末残存F 267,997,437口	本ファンドの期末残存F 262,415,513口
口数	口数
10,000口当たり収益分 G=E/F×10,000 1,046円	10,000口当たり収益分 G=E/F×10,000 1,729円
配対象額	配対象額
10,000口当たり分配金H 100円	10,000口当たり分配金H 100円
額	額
収益分配金金額 I=F×H/10,000 2,679,974円	収益分配金金額 I=F×H/10,000 2,624,155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2期	第3期
		自 平成29年 1月11日 至 平成29年 7月10日	自 平成29年 7月11日 至 平成30年 1月10日

1. 金融商品に対する取組方針	本ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	本ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、投資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。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社では、投信管理部門において、運用パフォーマンスの評価・分析及び運用に係るリスクのモニタリングならびに関係法令・運用の基本方針等の遵守状況のモニタリングを行っております。モニタリングの結果はコンプライアンス部及び社内に設置されたリスク管理委員会に報告されます。リスク管理委員会は投信管理部門からの報告事項に対して、必要な報告聴取、調査、リスクの評価分析及び是正勧告等の監督を行っております。運用の外部委託を行う場合は、当該外部運用委託先に対し定期的に前述と同等程度の報告を義務付けることにより、リスク管理を実施しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	期別 第2期 平成29年 7月10日現在	第3期 平成30年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価の差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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。	有価証券 売買目的有価証券 同左 デリバティブ取引 同左 上記以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第2期	第3期
	自平成29年1月11日 至平成29年7月10日	自平成29年7月11日 至平成30年1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	205,377,691円	267,997,437円
期中追加設定元本額	171,602,579円	69,457,017円
期中一部解約元本額	108,982,833円	75,038,941円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	平成29年7月10日現在	平成30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）	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	4,893,081	7,611,495
投資証券	6,211,043	11,163,399
合計	11,104,124	18,774,894

（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2期（平成29年7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	70,216,644	-	71,974,560	1,757,916
	アメリカドル	70,216,644	-	71,974,560	1,757,916
合計		70,216,644	-	71,974,560	1,757,916

第3期（平成30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	71,127,492	-	70,767,900	359,592
	アメリカドル	71,127,492	-	70,767,900	359,592
合計		71,127,492	-	70,767,900	359,592

（注）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)	2,358.6881	22,686,646	
		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)	2,026.6781	19,927,263	
	投資信託受益証券 小計		4,385.3662	42,613,909	
	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	51,102.081	69,787,556	
		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・バリュース・ファンド	29,425.688	35,793,701	
		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	73,525.679	71,161,093	
	投資証券 小計		154,053.448	176,742,350	
日本円合計			158,438.8142	219,356,259	
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	8,718	371,038.08	
		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	7,590	246,902.70	
アメリカドル合計			16,308	617,940.78 (69,487,440)	
合計				288,843,699 (69,487,440)	

(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30年1月31日現在

資産総額	378,900,618円
負債総額	72,970,551円
純資産総額（ - ）	305,930,067円
発行済口数	264,268,498口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1576円
（1万口当たり純資産額）	（11,576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29年8月末日現在、委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです（親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額（円）
追加型株式投資信託	23	54,640,708,413
単位型株式投資信託	8	69,734,660,736
合計	31	124,375,369,149

<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30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	26	67,569,934,789
単位型株式投資信託	9	64,253,723,100
合計	35	131,823,657,889

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

## ( 2 ) 【損益計算書】

期別	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業収益					
委託者報酬		298,400		503,215	
営業収益計			298,400		503,215
営業費用					
支払手数料	1	136,077		226,222	
支払投資顧問料		28,216		51,503	
広告宣伝費		12,139		9,128	
調査費		7,960		8,208	
委託計算費		9,736		20,181	
営業雑経費		16,346		20,432	
通信費		1,503		1,772	
印刷費		14,292		17,544	
協会費		551		1,115	
営業費用計			210,476		335,677
一般管理費					
給料	1	191,112		187,226	
役員報酬		49,442		49,327	
給料・手当		111,675		113,899	
賞与		29,994		23,999	
法定福利費	1	19,963		20,486	
交際費		783		462	
旅費交通費		7,994		9,491	
租税公課		1,446		2,819	
不動産賃借料	1	9,093		9,093	
賃借料	1	3,648		3,826	
固定資産減価償却費		3,753		2,299	
資産除去債務利息費用		109		103	
支払報酬料		7,252		7,879	
消耗品費		584		368	
保守修理費		50		55	
会議費		819		194	
保険料		250		274	
送金手数料		512		692	
一般管理費計			247,373		245,275
営業損失			159,449		77,737
営業外収益					
受取利息	1	32		5	
雑収入		5		5,097	
営業外収益計			38		5,103
経常損失			159,410		72,634
税引前当期純損失			159,410		72,634
法人税、住民税及び事業税	1		43,039		25,559
法人税等調整額			613		1,169
当期純損失			115,758		45,904

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利 益剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	225,000	225,000	225,000	195,874	195,874	254,125	254,125
当期変動額							
当期純損失				115,758	115,758	115,758	115,758
当期変動額合計	-	-	-	115,758	115,758	115,758	115,758
当期末残高	225,000	225,000	225,000	311,633	311,633	138,366	138,366

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利 益剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	225,000	225,000	225,000	311,633	311,633	138,366	138,366
当期変動額							
当期純損失				45,904	45,904	45,904	45,904
当期変動額合計	-	-	-	45,904	45,904	45,904	45,904
当期末残高	225,000	225,000	225,000	357,537	357,537	92,462	92,462

## 重要な会計方針

## 1. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	3年
器具備品	3～5年

## 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。

## (2) 連結納税制度の適用

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

## (3) 会計上の見積りの変更

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

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

なお、この変更による、当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

## 追加情報

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

## 1．有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2．関係会社に対する資産・負債

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

（損益計算書関係）

## 1．関係会社に対する事項

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

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	9,000株	-	-	9,000株

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
普通株式	9,000株	-	-	9,000株

## （金融商品関係）

## 1．金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

## (3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合には、当該価額が異なる場合もあります。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（平成28年 3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年 3月31日現在）

（単位：千円）

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

## （注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

## (1) 現金・預金、(2) 未収入金、並びに(3) 未収委託者報酬

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

負債

## (1) 未払手数料、並びに(2) その他未払金

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

## (注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年 3月31日現在）（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年 3月31日現在）（単位：千円）

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成28年 3月31日現在)	当事業年度 (平成29年 3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	917	887
未払賞与	10,832	9,638
資産除去債務	2,327	1,756
未払事業税	109	503
未払事業所税	42	42
繰越欠損金	30,136	36,259
減価償却超過額	70	140
繰延資産償却超過額	951	642
繰延税金資産小計	45,388	49,871
評価性引当額	45,388	49,871
繰延税金資産合計	-	-
繰延税金負債		
資産除去債務に対応する除去費用	1,169	-
繰延税金負債合計	1,169	-
繰延税金資産(負債)の純額	1,169	-

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

税引前当期純損失を計上したため記載を省略しております。

## (資産除去債務関係)

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から26箇月と見積り、割引率は1.471%を使用して資産除去債務の金額を算定しております。



## (3) 資産除去債務の総額の増減 (単位：千円)

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

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から26箇月と見積り、割引率は1.471%を使用して資産除去債務の金額を算定しております。

## (3) 資産除去債務の総額の増減 (単位：千円)

当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	
期首残高	7,542
時の経過による調整額	103
見積りの変更による減少額	1,954
期末残高	5,692

## (4) 資産除去債務の見積りの変更の内容及び影響額

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

## (セグメント情報等)

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

## 1. セグメント情報

当社は金融商品取引業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 商品及びサービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。

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

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

- 1．セグメント情報  
当社は金融商品取引業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。
- 2．関連情報
  - (1) 商品及びサービスごとの情報  
単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
  - (2) 地域ごとの情報  
営業収益  
投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。  
  
有形固定資産  
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。
  - (3) 主要な顧客ごとの情報  
投資信託の受益者の情報を制度上知り得ないため、記載を省略しております。
- 3．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報  
該当事項はありません。
- 4．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報  
該当事項はありません。
- 5．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報  
該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (億円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	㈱あおぞら銀行	東京都千代田区	1,000	銀行業	被所有 直接 100%	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

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (億円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	㈱あおぞら銀行	東京都千代田区	1,000	銀行業	被所有 直接 100%	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	27,124	未収入金	27,124
							出向者負担金	207,274	その他未払金	31,474
							代行手数料	129,864	未払手数料	23,101

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

前事業年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (億円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	あおぞら証券㈱	東京都千代田区	30	金融商品取引業	なし	事務代行	代行手数料	34,523	未払手数料	2,984

当事業年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (億円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	あおぞら証券㈱	東京都千代田区	30	金融商品取引業	なし	事務代行	代行手数料	93,687	未払手数料	5,694

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

## 2. 親会社に関する注記

## (1) 親会社情報

(株)あおぞら銀行 (東京証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
1株当たり純資産額	15,374.10円	10,273.62円
1株当たり当期純損失金額	12,862.04円	5,100.49円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純損失金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
当期純損失(千円)	115,758	45,904
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純損失(千円)	115,758	45,904
普通株式の期中平均株式数(株)	9,000	9,000

## (重要な後発事象)

前事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

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

## 1. 募集株式の数

9,000株

## 2. 募集株式の払込金額

募集株式1株につき金5万円(払込総額金4億5,000万円)

## 3. 増加する資本金及び資本準備金に関する事項

増加する資本金の額: 2億2,500万円

増加する資本準備金の額: 2億2,500万円

## 4. 募集株式と引換えにする金銭の払込みの期日

平成29年5月26日(金曜日)

## 5. 資金の用途

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

## ( 1 ) 中間貸借対照表

期別	注記 番号	当中間会計期間末 (平成29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			527,816
前払費用			2,906
未収入金			17,667
未収委託者報酬			83,978
流動資産計			632,369
固定資産			
有形固定資産	1		13,743
建物		13,077	
器具備品		665	
固定資産計			13,743
資産合計			646,112
(負債の部)			
流動負債			
未払金			89,381
未払手数料		40,859	
その他未払金		48,522	
未払費用			3,560
未払法人税等			2,507
未払消費税等			2,280
預り金			30,611
流動負債計			128,341
固定負債			
資産除去債務			11,893
繰延税金負債			3,607
固定負債計			15,500
負債合計			143,842
(純資産の部)			
株主資本			
資本金			450,000
資本剰余金			450,000
資本準備金		450,000	
利益剰余金			397,729
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		397,729	
純資産合計			502,270
負債・純資産合計			646,112

## ( 2 ) 中間損益計算書

期別	当中間会計期間 (自 平成29年 4月 1日 至 平成29年 9月30日)	
	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業収益		
委託者報酬	263,091	
営業収益計		263,091
営業費用		
支払手数料	119,255	
支払投資顧問料	25,616	
広告宣伝費	2,583	
調査費	5,525	
委託計算費	10,200	
営業雑経費	14,540	
通信費	2,281	
印刷費	11,673	
協会費	586	
営業費用計		177,722
一般管理費		
給料	97,547	
役員報酬	25,990	
給料・手当	57,153	
賞与	14,403	
法定福利費	11,586	
交際費	416	
旅費交通費	5,131	
租税公課	4,157	
不動産賃借料	9,696	
賃借料	1,786	
固定資産減価償却費	326	
資産除去債務利息費用	53	
支払報酬料	3,514	
消耗品費	3,647	
保守修理費	40	
会議費	129	
保険料	276	
送金手数料	460	
一般管理費計		138,770
営業損失		53,401
営業外収益		
受取利息	1	
雑収入	490	
営業外収益計		491
営業外費用		
資産除去債務履行差額	1,196	
営業外費用計		1,196
經常損失		54,106
税引前中間純損失		54,106
法人税、住民税及び事業税		17,521
法人税等調整額		3,607
中間純損失		40,191

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成29年 4月 1日 至 平成29年 9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計	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	357,537	357,537	92,462	92,462
当中間期変動額							
中間純損失				40,191	40,191	40,191	40,191
新株の発行	225,000	225,000	225,000			450,000	450,000
当中間期変動額合計	225,000	225,000	225,000	40,191	40,191	409,808	409,808
当中間期末残高	450,000	450,000	450,000	397,729	397,729	502,270	502,270

## 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	15年
器具備品	3～15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。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

当中間会計期間（平成29年 9月30日現在）

1. 有形固定資産の減価償却累計額 577千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成29年 4月 1日 至 平成29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	-	18,000株

## (変動事由の概要)

普通株式の増加数の内訳は、親会社である株式会社あおぞら銀行を引受先とする募集株式9,000株の発行によるものであります。

## （金融商品関係）

## 1．金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

当中間会計期間（平成29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	527,816	527,816	-
(2) 未収入金	17,667	17,667	-
(3) 未収委託者報酬	83,978	83,978	-
資産計	629,462	629,462	-
(1) 未払手数料	40,859	40,859	-
(2) その他未払金	48,522	48,522	-
負債計	89,381	89,381	-

（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29年 4月 1日 至 平成29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	5,692
有形固定資産の取得に伴う増加額	11,853
時の経過による調整額	53
資産除去債務の履行による減少額	5,706
期末残高	11,893

## （セグメント情報等）

当中間会計期間（自 平成29年 4月 1日 至 平成29年 9月30日）

## 1．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29年 4月 1日 至 平成29年 9月30日）

1株当たり純資産額 27,903.92円

1株当たり中間純損失金額 2,627.77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いません。

(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29年 4月 1日 至 平成29年 9月30日)
中間純損失(千円)	40,191
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)	40,191
普通株式の期中平均株式数(株)	15,295

## (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】

&lt;訂正前&gt;

## (1) 受託会社

(中略)

342,037百万円(平成29年3月末現在)

(中略)

&lt;(ご参考)再信託受託会社の概要&gt;

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 : 51,000百万円(平成29年3月末現在)

(中略)

## (2) 販売会社

(平成29年3月末現在)

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

&lt;訂正後&gt;

## (1) 受託会社

(中略)

342,037百万円(平成29年9月末現在)

(中略)

&lt;(ご参考)再信託受託会社の概要&gt;

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 : 51,000百万円(平成29年9月末現在)

(中略)

## (2) 販売会社

(平成29年9月末現在)

名称	資本金の額	事業の内容
株式会社あおぞら銀行	100,000百万円	銀行法により、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	

# 独立監査人の監査報告書

平成30年3月9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29年7月11日から平成30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30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29年5月12日

あおぞら投信株式会社  
取締役会御中

## 有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 平 木 達 也 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 山 田 信 之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているあおぞら投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第4期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、あおぞら投信株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以 上

---

（注）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29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29年4月1日から平成30年3月31日までの第5期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

（注）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。