

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年5月19日提出
【計算期間】	第6特定期間(自 平成28年8月19日至 平成29年2月20日)
【ファンド名】	グローバルドライブ（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジ グローバルドライブ（3ヵ月決算型）為替ヘッジなし
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 恵正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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】

a. ファンドの目的及び基本的性格

各ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主としてグローバルドライブ・マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）への投資を通じて、世界各国のさまざまな資産への分散投資を実質的に行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

委託者は、受託者と合意のうえ、各ファンドにつき金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

各ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、以下のよう分類・区分されます。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式 債券
追加型	海外	不動産投信 その他資産 ()
	内外	資産複合

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式・債券・不動産投信（リート）・その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

属性区分表

< 限定為替ヘッジファンド >

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 日本	ファミリーファンド
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他()	北米 欧州 アジア オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ
不動産投信		中南米	為替ヘッジ
その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式一般、債 券一般)))		アフリカ 中近東(中東) エマージング	あり(限定ヘッジ)
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型			なし

(注) ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 為替ヘッジなしファンド >

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 日本	ファミリーファンド
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他()	北米 欧州 アジア オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ
不動産投信		中南米	為替ヘッジ
その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式一般、債 券一般)))		アフリカ 中近東(中東) エマージング	あり
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型			なし

（注）ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

<各ファンド共通>

その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式一 般、債券一般）））	投資信託証券への投資を通じて、実質的に複数資産（株式一般、債券一般）に投資を行います。
年4回	目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （含む日本）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（含む日本）の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり （限定ヘッジ） ^{（注）}	目論見書または投資信託約款において、為替の限定ヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
為替ヘッジなし ^{（注）}	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

（注）属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

各ファンドはファミリーファンド方式で運用します。このため、組み入れている資産を示す「属性区分表」の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と、収益の源泉となる資産を示す「商品分類表」の投資対象資産（資産複合）とは異なります。

商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

b. ファンドの特色

1. 世界各国の株式や債券などさまざまな資産への分散投資で得られる収益の獲得を目指します。

各ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

マザーファンドを通じて、各ファンドは主として「ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド - クラスX」（以下「アロケーション・ファンド」といいます。）米ドル建投資証券に実質的な投資を行います。

補助的な位置付けとして、短期米ドル建債券などを主要投資対象とする上場投資信託証券（以下「短期米ドル債ETF」といいます。）にも、マザーファンドを通じた実質的な投資を行います。

ただし、アロケーション・ファンドの実質組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。

短期米ドル債ETFについては、規模、流動性、信用リスク、追従するベンチマーク指数の差異などを総合的に判断して、銘柄を決定します。

各ファンドが実質的に投資するアロケーション・ファンドが、償還した場合または商品の同一性が失われた場合は、委託会社は受託会社と合意のうえマザーファンドおよび各ファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

マザーファンドにおけるアロケーション・ファンドへの投資に係る指図権限を、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。

ブラックロック

BLACKROCK®

- ・「ブラックロック」は、運用資産総額で世界最大級の独立系運用会社であるブラックロック・インクおよびグループ会社の総称です。
- ・「ブラックロック」の運用資産総額は5.15兆米ドル(約600兆円)にのぼります。
- ・「ブラックロック」は世界各国の個人投資家および機関投資家のため、株式、債券およびオルタナティブ商品といったさまざまな資産クラスの運用を行っています。
- ・ブラックロック・ジャパン株式会社は、「ブラックロック」の日本拠点です。

上記は2016年12月末時点です。 1米ドル=116.635円で換算

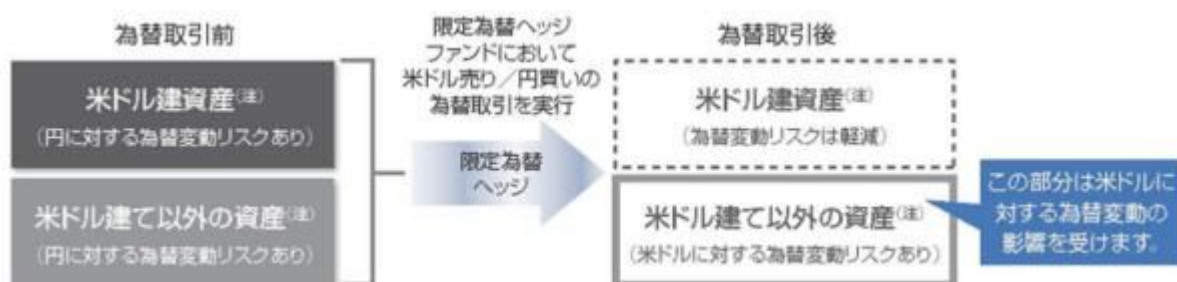
2. 為替ヘッジの有無に応じて以下のファンドからお選びいただけます。



「限定為替ヘッジファンド」では、実質外貨建資産については、原則としてファンドにおいて米ドル売り/円買いの為替取引を行います。

「為替ヘッジなしファンド」では、実質外貨建資産については、原則としてファンドにおいて為替ヘッジを行いません。

< 限定為替ヘッジによる為替変動リスク軽減のイメージ図 >



(注) マザーファンド(およびマザーファンドが投資するアロケーション・ファンド、短期米ドル債ETF)を通じて実質的に投資している資産

限定為替ヘッジに関する注意事項

「限定為替ヘッジファンド」では、マザーファンド(およびマザーファンドが投資するアロケーション・ファンド、短期米ドル債ETF)を通じて実質的に投資しているすべての資産の発行通貨について対円での為替ヘッジを行うだけでなく、全資産を米ドルに換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り/円買いの為替取引を行うことを基本とします。

これにより、米ドル建資産については対円での為替変動リスクが軽減されますが、米ドル建て以外の資産については、その発行通貨が米ドルに対して下落した場合は基準価額の値下がり要因に、上昇した場合には値上がり要因になります。また、円の金利が米ドルの金利より低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

アロケーション・ファンドは、米ドルベースでの収益の獲得を目指します。アロケーション・ファンドの米ドル/円為替変動の影響を軽減することが限定為替ヘッジの主な目的です。

「グローバルドライブ」構成ファンド間においてスイッチングができる場合があります。

「グローバルドライブ」構成ファンドは、アセットマネジメントOne株式会社を委託会社とする特定のファンドをグループ化したものであり、その構成ファンドの名称には「グローバルドライブ」の語句が付されています。なお、構成ファンドを総称して「グローバルドライブ」という場合があります。

スイッチングのお取り扱いの有無などは、販売会社により異なります。また、販売会社によっては一部のファンドのみのお取り扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社でご確認ください。

各ファンドの資金動向、市況動向などによっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

分配方針

原則として、年4回(毎年2月、5月、8月、11月の各月18日。休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

分配金額は、基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。

留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

運用状況により分配金額は変動します。

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

【収益分配金に関する留意事項】

投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が
支払われるイメージ



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係（イメージ）

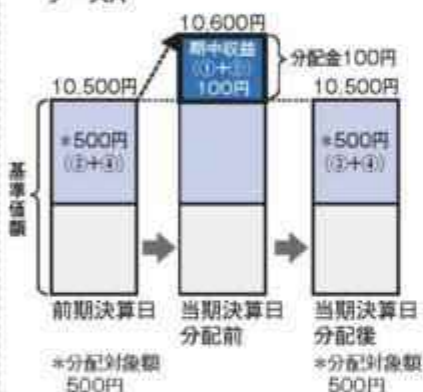
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

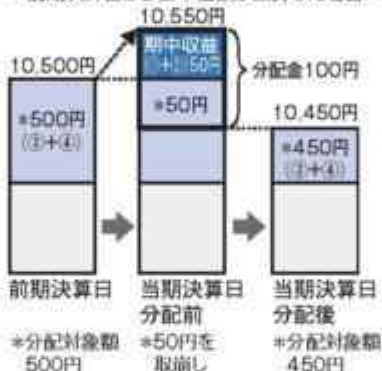
計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

ケースA



ケースB

<前期決算日から基準価額が上昇した場合>



ケースC

<前期決算日から基準価額が下落した場合>



上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円

ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円

ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



(2) 【ファンドの沿革】

平成26年1月17日
平成26年2月24日

関東財務局長に対して有価証券届出書提出
投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

平成28年10月1日

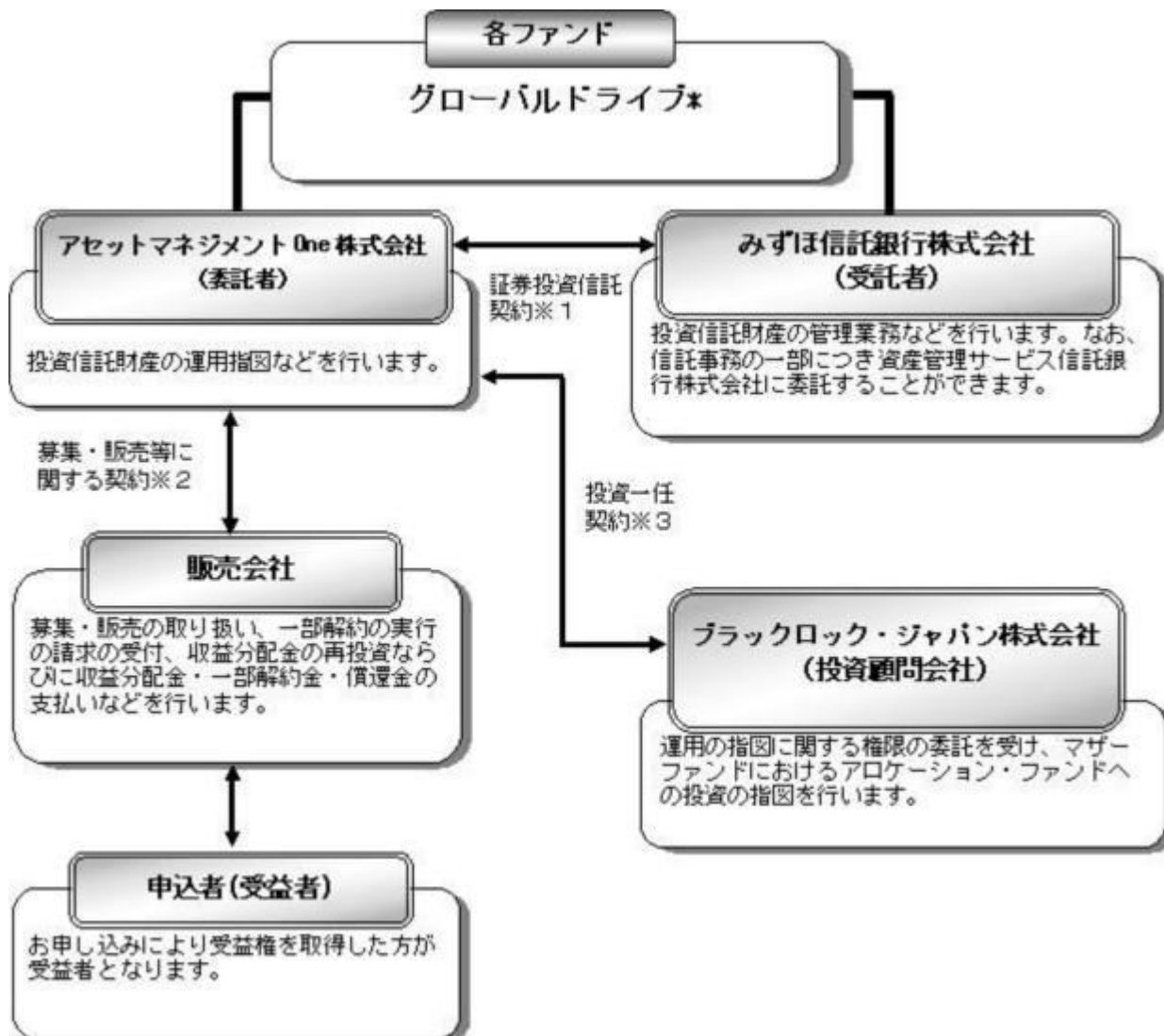
ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセット
マネジメントOne株式会社に承継

(3)【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み

図中の*には次の表の各ファンドの名称をあてはめてご覧ください。

(3ヵ月決算型) 限定為替ヘッジ	(3ヵ月決算型) 為替ヘッジなし
------------------	------------------



1 証券投資信託契約

委託者と受託者との間において「証券投資信託契約(投資信託約款)」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

3 投資一任契約

委託者と投資顧問会社との間において「投資一任契約」を締結しており、運用にかかる規定、運用責任の所在、投資顧問会社に対する報酬、契約の期間等を規定していません。

各ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（各ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。

マザーファンドは投資信託証券を投資対象とする「ファンド・オブ・ファンズ方式」で運用を行います。



b. 委託会社の概況

(イ) 資本金の額 20億円（平成29年 2月28日現在）

(ロ) 委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	証券投資信託法に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、商号を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする
平成20年1月1日	興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社からD I A Mアセットマネジメント株式会社に商号変更
平成28年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に變更

(ハ) 大株主の状況

(平成29年 2月28日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほ フィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス 株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

- 1：A種種類株式（15,510株）を含みます。
- 2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a．基本方針

各ファンドは、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

b．運用の方法

(イ) 主要投資対象

グローバルドライブ・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド - クラスX（以下「アロケーション・ファンド」といいます。）米ドル建投資証券に実質的な投資を行い、世界各国の様々な資産への分散投資と為替取引で得られる収益の獲得を目指します。加えて、短期米ドル建債券等を主要投資対象とする上場投資信託証券（以下「短期米ドル債ETF」といいます。）にも、実質的な投資を行います。

アロケーション・ファンドの実質組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。

< 限定為替ヘッジファンド >

実質外貨建資産については、原則としてファンドにおいて米ドル売り / 円買いの為替取引を行います。

< 為替ヘッジなしファンド >

実質外貨建資産については、原則としてファンドにおいて為替ヘッジを行いません。

各ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

マザーファンドが償還した場合は、委託者は受託者と合意のうえ投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

マザーファンドの運用方針

グローバルドライブ・マザーファンド

1．基本方針

この投資信託は、投資信託証券を主要投資対象として、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

(1) 投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

以下の投資信託証券への投資を通じて、世界各国の様々な資産への分散投資と為替取引で得られる収益の獲得による投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

ルクセンブルグ籍外国投資法 アロケーション・ファンド米ドル建投資証券

人

短期米ドル債ETF

短期米ドル債ETFについては、規模、流動性、信用リスク、追従するベンチマーク指数の差異等を総合的に判断して、銘柄を決定します。

各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向等を勘案して決定するものとし、アロケーション・ファンドの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。

外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。

アロケーション・ファンドへの投資に係る指図権限を、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。

当ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

アロケーション・ファンドが、償還した場合もしくは約款に規定する事項の変更により商品の同一性が失われた場合は、委託者は受託者と合意のうえ投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外には投資を行いません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産に留保し、期中には分配を行いません。

(2) 【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

各ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

b. 有価証券および金融商品の指図範囲等

(イ) 委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託であるグローバルドライブ・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの

3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。)

4. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをい

います。)

5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第3号の証券を以下「公社債」といいます。公社債にかかる運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができます。

(ロ) 委託者は、信託金を、上記(イ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(ハ) 上記(イ)の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、上記(ロ)に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

各ファンドがマザーファンドを通じて実質的に投資する投資信託証券の概要

アロケーション・ファンドの概要

ファンド名	ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド - クラスX
形態	ルクセンブルグ籍外国投資法人 / 米ドル建投資証券
運用方針	世界中のさまざまな資産（株式・債券など）、国・地域、セクターなどから、投資魅力が高いと判断する資産を発掘します。 多くの資産および銘柄（証券）に分散投資をすることで、株式投資より低いリスクで、競争力のあるリターンを獲得を目指します。 投資環境に応じて株式や債券などの各資産への配分比率や個別銘柄（証券）への投資比率を機動的に変更することで、中長期的なトータルリターンの最大化を目指します。
主な投資制限	・純資産総額の10%を超える借り入れは行わないこととします。 ・同一発行体の証券への投資は、原則として純資産総額の10%以下とします。
決算日	8月末
主な関係法人	管理会社：ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー 投資運用会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー 保管受託銀行：ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン（インターナショナル）リミテッド
信託報酬等	アロケーション・ファンドにおいて、管理会社および投資運用会社への報酬はかかりません。（ただし、各ファンドの委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社が受ける報酬から、マザーファンドの投資顧問会社であるブラックロック・ジャパン株式会社に投資顧問報酬が支払われます。そして、その投資顧問報酬から、アロケーション・ファンドの投資運用会社などへの報酬が支払われます。）アロケーション・ファンドの上記報酬制度は変更される場合があります。
その他の費用・手数料	有価証券売買時の売買手数料、計算にかかる報酬、登録および名義書換代行事務会社報酬、税務顧問、法律顧問、ファンド監査人などへの報酬、取締役の報酬、保管受託銀行への報酬などがアロケーション・ファンドから支払われます。これらは定率でないため事前に概算料率や上限額などを表示することができません。
収益分配方針	原則として、年1回、経費控除後の利子配当等収益を分配します。 分配原資が無い場合など分配を行わない場合もあります。
設定日	1997年1月3日（他の既存クラスを含めた当初の設定日）

上記投資信託証券については、資金流入にともない発生する取引費用などによる当該投資信託証券の純資

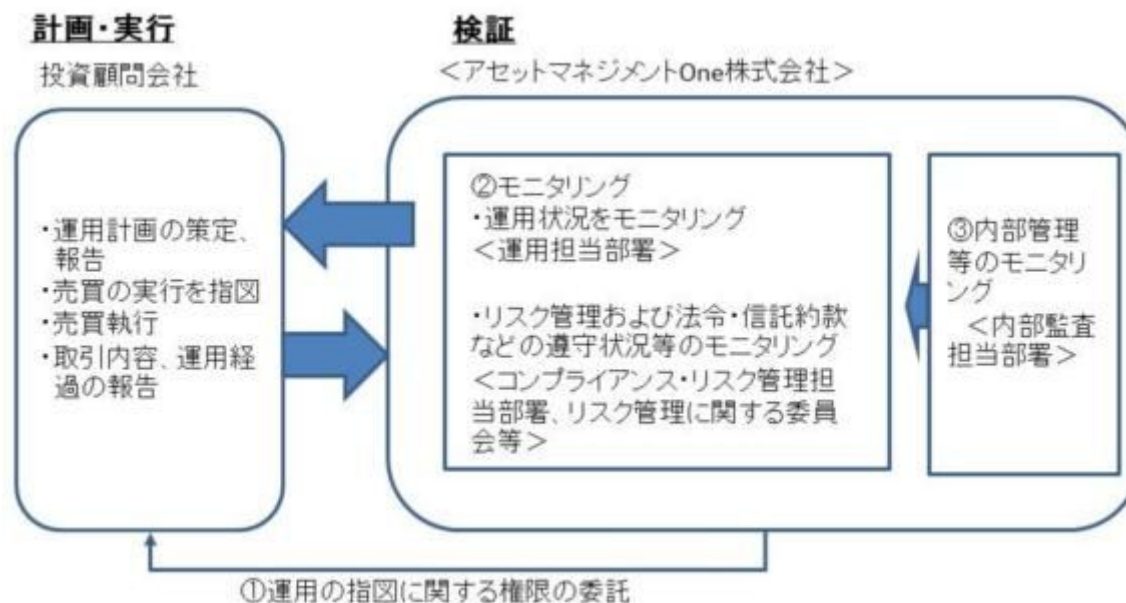
産への影響を軽減するため、純資産価格の調整が行われることがあります。純流入額が純資産総額に対し所定の割合を超える場合には純資産価格が上方へ調整され、逆に純流出額が純資産総額に対し所定の割合を超える場合には純資産価格が下方に調整されます。したがって、資金流入の動向が純資産価格に影響を与えることになります。

上記の投資信託証券については、申込手数料はかかりません。

上記の概要は、投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、概要は平成29年5月19日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



運用の指図に関する権限の委託

各ファンドが主要投資対象とするグローバルドライブ・マザーファンドは、ブラックロック・ジャパン株式会社に投資に係る指図権限を委託します。

ブラックロック・ジャパン株式会社は投資一任契約に基づいて運用計画を策定・報告し、運用指図および売買執行・管理を行います。

モニタリング

委託会社では、各運用担当者が運用の委託先である投資顧問会社の運用状況をモニタリングし、必要に応じて対応を指示します。

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的開催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b. ファンドの関係法人に関する管理

当ファンドの関係法人である受託会社・投資顧問会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、

必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

また投資顧問会社に対しては、運用の外部委託管理に関する社内規程を設け、経営陣・運用担当者との面談を含めた、委託継続にかかる点検(デューデリジェンス)を定期的に行います。

c. 運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制等は平成29年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4)【分配方針】

a. 収益分配は年4回、原則として、2月、5月、8月、11月の各月18日(該当日が休業日の場合は翌営業日。)の決算時に以下の方針に基づき行います。

1. 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
2. 分配金額は、基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。
3. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

b. 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

c. 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

d. 「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払われます。

「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

(5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

b．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c．公社債の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借り入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借り入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 借り入れの指図は、当該借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券（外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。）への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

e．外国為替予約の指図

委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産（外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

f．資金の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借り入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間、もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

g．利害関係人等との取引等

(イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において投資信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他こ

れらに類する行為を行うことができます。

(ロ) 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

(ハ) 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

(ニ) 上記(イ)(ロ)(ハ)の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

h. デリバティブ取引等に係る投資制限

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

i. ファンドの投資制限

投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には実質的に投資を行いません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

各ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているのではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

a. 株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、金利動向、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係などの影響を受け変動します。一般に、株価が下落した場合にはその影響を受け、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

b. 為替変動リスク

外貨建資産は、為替相場の変動により円換算価格が変動します。一般に、保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも、投資先の通貨に対して円高となった場合には、当該外貨建資産の円換算価格が下落し、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

限定為替ヘッジファンド

「限定為替ヘッジファンド」では、実質的な外貨建資産については、原則としてファンドにおいて米ドル売り/円買いの為替取引を行います。この為替取引により（マザーファンドを通じて実質的に投資する）アロケーション・ファンドおよび短期米ドル債ETFが保有する米ドル建資産の対円での為替変動リスクは軽減されますが、米ドル建て以外の資産については米ドルに対する為替変動リスクを負うこととなります。したがって、それらの通貨が米ドルに対して下落した場合には、ファンドの基準価額が下落する可能性があります。また、円の金利が米ドルの金利よりも低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

c．金利変動リスク

公社債の価格は、金利水準の変化にともない変動します。一般に、金利が上昇した場合には公社債の価格は下落し、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

d．信用リスク

有価証券などの発行体が業績悪化・経営不振あるいは倒産に陥った場合、当該有価証券の価値が大きく減少すること、もしくは無くなることがあります。また、有価証券の信用力の低下や格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合には、当該有価証券の価格は下落します。これらの影響を受け、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

投機的格付けが付与されているハイイールド債券や当該格付けが付与されている国が多い新興国の債券は、投資適格の債券に比べ信用リスクは高くなります。

e．流動性リスク

有価証券などを売買する際、当該有価証券などの市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、希望する時期に、希望する価格で、希望する数量を売買することができない可能性があります。特に流動性の低い有価証券などを売却する場合にはその影響を受け、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

f．カントリーリスク

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制などの要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。これらの影響を受け、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

一般に新興国市場は、先進国市場に比べて規模が小さく、流動性も低く、金融インフラが未発達であり、さまざまな地政学的問題を抱えていることから、カントリーリスクはより高くなる可能性があります。

g．特定の投資信託証券に投資するリスク

各ファンドが実質的に組み入れる投資信託証券における運用会社の運用の巧拙が、各ファンドの運用成果に大きな影響を及ぼします。また、外国投資法人を通じて各国の有価証券に投資する場合、国内籍の投資信託から直接投資を行う場合に比べて、税制が相対的に不利となる可能性があります。

h．他のベビーファンドの影響

各ファンドが投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のファンド（ベビーファンド）において、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。これにより、マザーファンドの基準価額が下落した場合には、その影響を受け各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

i．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

(イ) 各ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

(ロ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。

(ハ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われなことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。

(ニ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消

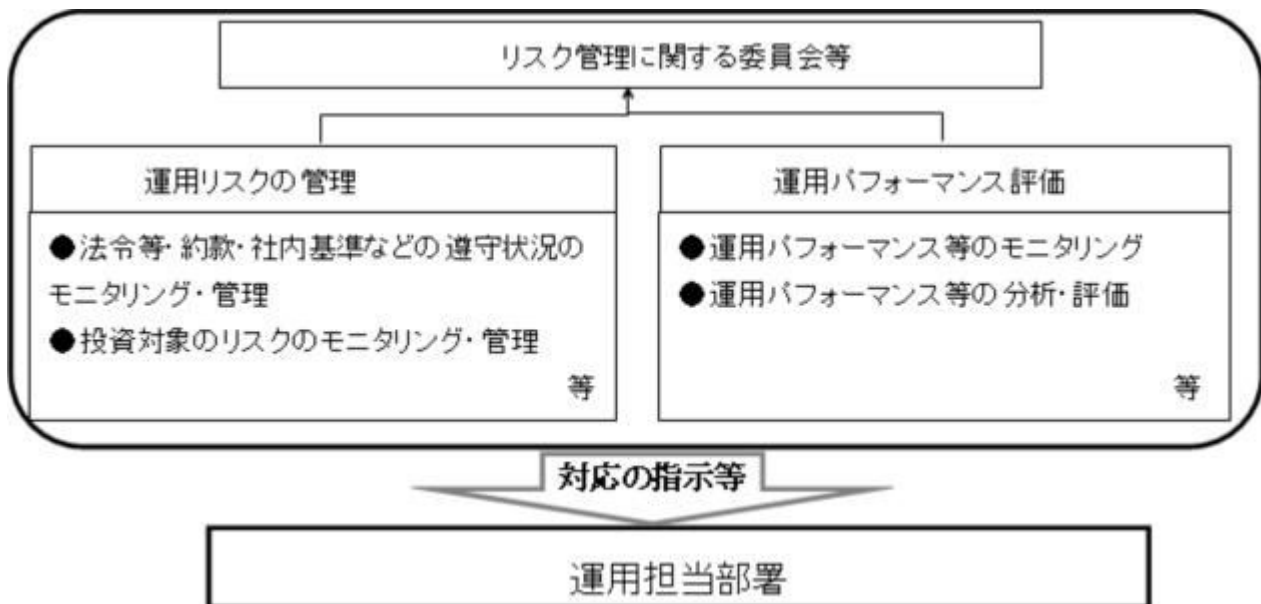
す場合があります。

- (ホ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入
有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場
合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ヘ) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地
変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあり
ます。これにより各ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があ
ります。

(2) リスク管理体制

委託会社における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運
用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、
適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用
パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価
等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価
を行います。

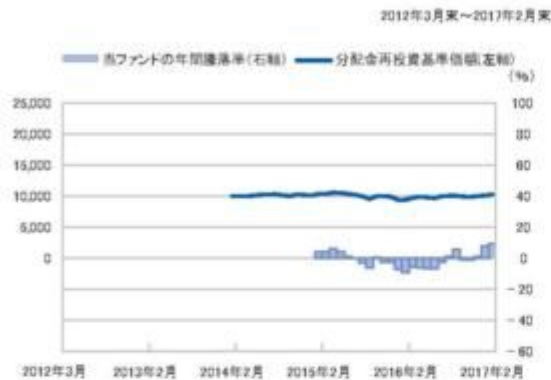


リスク管理体制は平成29年 2月28日現在のものであり、今後変更になることがあります。

グローバルドライブ（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジ/（3ヵ月決算型）為替ヘッジなし

<参考情報>**（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジ**

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



*分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

*年間騰落率は、2015年2月から2017年2月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

（3ヵ月決算型）為替ヘッジなし

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

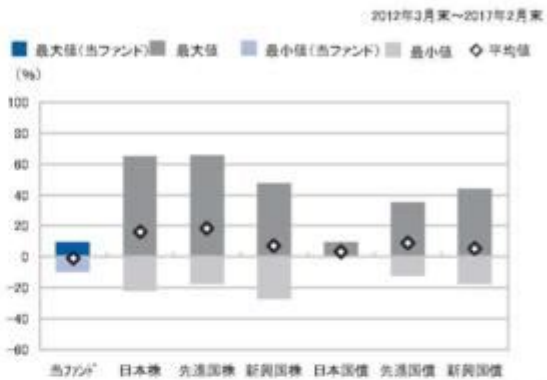


*分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

*年間騰落率は、2015年2月から2017年2月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	9.3	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△9.6	△22.0	△17.5	△27.4	△0.2	△12.3	△17.4
平均値	△0.8	16.3	18.6	7.2	3.1	9.0	5.3

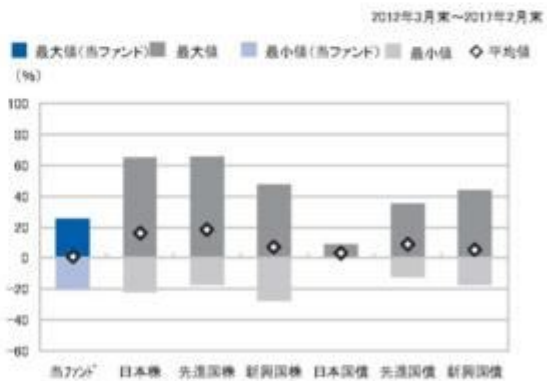
*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

*2012年3月から2017年2月の5年間の騰落率(当ファンドは2015年2月から2017年2月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

*決算日に対応した数値とは異なります。

*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	25.3	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△20.5	△22.0	△17.5	△27.4	△0.2	△12.3	△17.4
平均値	1.0	16.3	18.6	7.2	3.1	9.0	5.3

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

*2012年3月から2017年2月の5年間の騰落率(当ファンドは2015年2月から2017年2月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

*決算日に対応した数値とは異なります。

*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

投資リスク

*各資産クラスの指数

- 日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI国債
- 先進国債・・・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GBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に所有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が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ために開発した投資収益指数です。同指数の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。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、JPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

「各資産クラスの騰落率」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及び各指数のデータソースは、その内容について、信頼性、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及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及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

(イ) 申込手数料

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.0%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税等（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

<http://www.am-one.co.jp/>

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

ファンドの受益権の取得申込者が「償還乗り換え」¹または「償還前乗り換え」²によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができる場合があります。

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社ごとに異なりますので、詳しくは各販売会社でご確認ください。

- 1 「償還乗り換え」とは、取得申込受付日前の一定期間内に既に償還となった証券投資信託の償還金等をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合はいいです。
- 2 「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合はいいです。

(ロ) スイッチング手数料

「グローバルドライブ」構成ファンド間において、乗り換え（以下「スイッチング」³といいです。）が可能です。

スイッチング手数料につきましては、販売会社にお問い合わせください。

スイッチングのお取り扱いの有無や対象ファンドなどは、販売会社により異なりますので、詳しくは販売会社でご確認ください。

なお、スイッチングの際には、換金時と同様の税金がかかりますのでご注意ください。

- 3 「スイッチング」とは、「グローバルドライブ」を構成するファンドを換金した場合の手取金をもって、その換金請求受付日の販売会社の営業時間内に「グローバルドライブ」を構成する他のファンドの取得申し込みをすることをいいです。

(2) 【換金（解約）手数料】

ご解約時の手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率2.0304%（税抜1.88%）

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のとき各ファンドから支払われます。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
-----	--------	------

委託会社	年率1.15%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

委託会社の信託報酬には、グローバルドライブ・マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた投資顧問会社(ブラックロック・ジャパン株式会社)に対する報酬(各ファンドの信託財産に属する当該マザーファンドの純資産総額に対して年率0.75%(税抜))が含まれます。

マザーファンドを通じて実質的に投資するアロケーション・ファンドでは直接の投資運用会社報酬などはありません。(ただし、各ファンドの委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社が受ける報酬から、マザーファンドの投資顧問会社であるブラックロック・ジャパン株式会社に投資顧問報酬が支払われます。そして、その投資顧問報酬から、アロケーション・ファンドの投資運用会社などへの報酬が支払われます。)アロケーション・ファンドの上記報酬制度は変更される場合があります。

マザーファンドを通じて実質的に投資する短期米ドルETFについては、市場の需給により価格が形成されるため、その費用を表示することができません。

(4)【その他の手数料等】

- a. 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人に支払うファンドの監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。
- b. 投資信託財産にかかる監査報酬は、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査報酬にかかる消費税等とともに投資信託財産中から支払われます。
- c. 証券取引に伴う手数料・税金等、各ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税および資産を外国で保管する場合の費用についても投資信託財産が負担します。
- d. 各ファンドが実質的に主要投資対象とするアロケーション・ファンドにおいても、有価証券売買時の売買手数料、計算にかかる報酬、登録および名義書換代行事務会社報酬、税務顧問、法律顧問、ファンド監査人などへの報酬、取締役の報酬、保管受託銀行への報酬などがかかります。
- e. 「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。

手数料などの合計額については、購入金額や保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

(5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

- a. 個人の受益者に対する課税

(イ) 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税

（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（ロ）解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

（ハ）損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

b. 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成29年2月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

c. 個別元本について

（イ）受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税

等に相当する金額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

(ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

(ハ) 収益分配金に元本払戻金(特別分配金)が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、「d. 収益分配金の課税について」を参照。)

d. 収益分配金の課税について

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金(特別分配金)が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

(平成29年 2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	797,189,909	97.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,932,239	2.67
純資産総額		819,122,148	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

(平成29年 2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,671,334,015	97.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		258,857,888	2.36
純資産総額		10,930,191,903	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考)グローバルドライブ・マザーファンド

(平成29年 2月28日現在)

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	64,606,738	0.40
投資証券	ルクセンブルグ	15,663,349,527	97.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		400,766,814	2.48
純資産総額		16,128,723,079	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成29年 2月28日現在)

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	日本	親投資信託 受益証券	グローバルドライブ・マザーファ ンド	653,809,489	1.2177	796,178,277	1.2193	797,189,909	97.32

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

ロ. 種類別投資比率

(平成29年 2月28日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.32
合計	97.32

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

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	日本	親投資信託 受益証券	グローバルドライブ・マザーファンド	8,752,016,744	1.2175	10,655,580,385	1.2193	10,671,334,015	97.63

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

ロ.種類別投資比率

(平成29年 2月28日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.63
合計	97.63

(参考)グローバルドライブ・マザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(平成29年 2月28日現在)

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	ルクセンブルグ	投資証券	ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンド・クラスX	12,153,323.78	1,283.18	15,594,950,621	1,288.8119	15,663,349,527	97.11
2	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES SHORT TREASURY BOND ETF	5,200	12,422.12	64,595,032	12,424.3726	64,606,738	0.40

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成29年 2月28日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別投資比率

(平成29年 2月28日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.40
投資証券	97.11
合計	97.51

【投資不動産物件】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

該当事項はありません。

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

該当事項はありません。

(参考) グローバルドライブ・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

該当事項はありません。

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

該当事項はありません。

(参考) グローバルドライブ・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

期別	純資産総額(円)		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間末 (平成26年 8月18日)	390,377,302	392,311,755	1.0090	1.0140
第2特定期間末 (平成27年 2月18日)	784,308,745	788,167,930	1.0162	1.0212
第3特定期間末 (平成27年 8月18日)	982,140,035	982,140,035	0.9973	0.9973
第4特定期間末 (平成28年 2月18日)	909,165,559	909,165,559	0.9099	0.9099
第5特定期間末 (平成28年 8月18日)	837,446,906	850,711,653	0.9470	0.9620
第6特定期間末 (平成29年 2月20日)	813,168,350	825,999,036	0.9507	0.9657
平成28年 2月末日	915,086,620		0.9202	
3月末日	902,690,088		0.9549	
4月末日	887,501,181		0.9659	
5月末日	869,133,238		0.9373	
6月末日	832,062,037		0.9234	
7月末日	860,330,784		0.9535	
8月末日	838,877,149		0.9455	
9月末日	832,711,659		0.9476	
10月末日	818,188,675		0.9339	

11月末日	809,444,689		0.9306
12月末日	838,879,162		0.9414
平成29年 1月末日	813,344,856		0.9515
2月末日	819,122,148		0.9539

グローバルドライブ（3ヵ月決算型）為替ヘッジなし

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（平成26年 8月18日）	1,349,839,359	1,363,212,240	1.0094	1.0194
第2特定期間末（平成27年 2月18日）	4,449,429,911	4,530,599,001	1.0963	1.1163
第3特定期間末（平成27年 8月18日）	15,980,170,604	15,980,170,604	1.1194	1.1194
第4特定期間末（平成28年 2月18日）	15,331,814,236	15,331,814,236	0.9390	0.9390
第5特定期間末（平成28年 8月18日）	12,409,919,223	12,409,919,223	0.8988	0.8988
第6特定期間末（平成29年 2月20日）	10,899,113,398	11,231,645,296	0.9833	1.0133
平成28年 2月末日	15,426,592,680		0.9474	
3月末日	15,631,353,757		0.9767	
4月末日	15,228,683,279		0.9653	
5月末日	14,854,063,970		0.9648	
6月末日	13,033,516,433		0.8859	
7月末日	13,079,094,382		0.9293	
8月末日	12,653,715,848		0.9274	
9月末日	11,748,790,255		0.9132	
10月末日	11,693,535,029		0.9328	
11月末日	11,651,624,650		0.9675	
12月末日	11,651,052,576		1.0129	
平成29年 1月末日	11,243,017,509		1.0051	
2月末日	10,930,191,903		0.9842	

【分配の推移】

グローバルドライブ（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジ

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	平成26年 2月24日～平成26年 8月18日	0.0050
第2特定期間	平成26年 8月19日～平成27年 2月18日	0.0050
第3特定期間	平成27年 2月19日～平成27年 8月18日	0.0100
第4特定期間	平成27年 8月19日～平成28年 2月18日	0.0000
第5特定期間	平成28年 2月19日～平成28年 8月18日	0.0350
第6特定期間	平成28年 8月19日～平成29年 2月20日	0.0150

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	平成26年 2月24日～平成26年 8月18日	0.0100
第2特定期間	平成26年 8月19日～平成27年 2月18日	0.0800
第3特定期間	平成27年 2月19日～平成27年 8月18日	0.0150
第4特定期間	平成27年 8月19日～平成28年 2月18日	0.0000
第5特定期間	平成28年 2月19日～平成28年 8月18日	0.0020
第6特定期間	平成28年 8月19日～平成29年 2月20日	0.0550

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

【収益率の推移】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

期	計算期間	収益率(%)
第1特定期間	平成26年 2月24日～平成26年 8月18日	1.4
第2特定期間	平成26年 8月19日～平成27年 2月18日	1.2
第3特定期間	平成27年 2月19日～平成27年 8月18日	0.9
第4特定期間	平成27年 8月19日～平成28年 2月18日	8.8
第5特定期間	平成28年 2月19日～平成28年 8月18日	7.9
第6特定期間	平成28年 8月19日～平成29年 2月20日	2.0

(注)収益率は各特定期間における騰落率を表示しており、当該特定期間中の分配金合計額を加算して計算しています。

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

期	計算期間	収益率(%)
第1特定期間	平成26年 2月24日～平成26年 8月18日	1.9
第2特定期間	平成26年 8月19日～平成27年 2月18日	16.5
第3特定期間	平成27年 2月19日～平成27年 8月18日	3.5
第4特定期間	平成27年 8月19日～平成28年 2月18日	16.1
第5特定期間	平成28年 2月19日～平成28年 8月18日	4.1
第6特定期間	平成28年 8月19日～平成29年 2月20日	15.5

(注)収益率は各特定期間における騰落率を表示しており、当該特定期間中の分配金合計額を加算して計算しています。

(4)【設定及び解約の実績】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1特定期間	平成26年 2月24日～平成26年 8月18日	387,272,653	382,001
第2特定期間	平成26年 8月19日～平成27年 2月18日	425,324,090	40,377,611
第3特定期間	平成27年 2月19日～平成27年 8月18日	320,690,609	107,690,299
第4特定期間	平成27年 8月19日～平成28年 2月18日	123,787,960	109,404,831
第5特定期間	平成28年 2月19日～平成28年 8月18日	31,864,897	146,768,969
第6特定期間	平成28年 8月19日～平成29年 2月20日	34,624,891	63,562,291

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

グローバルライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1特定期間	平成26年 2月24日～平成26年 8月18日	1,339,249,224	1,961,084
第2特定期間	平成26年 8月19日～平成27年 2月18日	3,307,643,124	586,476,757
第3特定期間	平成27年 2月19日～平成27年 8月18日	11,331,735,965	1,114,757,663
第4特定期間	平成27年 8月19日～平成28年 2月18日	3,227,526,597	1,175,720,212
第5特定期間	平成28年 2月19日～平成28年 8月18日	178,205,843	2,698,183,720
第6特定期間	平成28年 8月19日～平成29年 2月20日	102,957,311	2,825,822,001

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

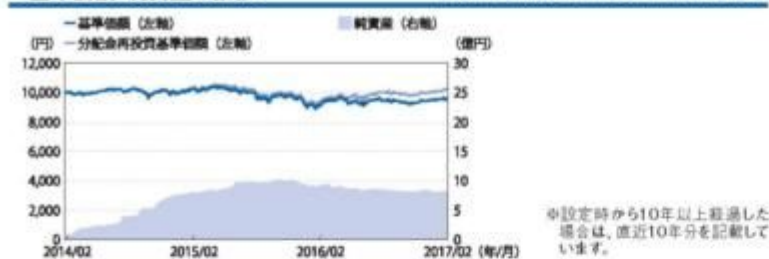
運用実績

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ/3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

データの基準日:2017年2月28日

(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

<基準価額・純資産の推移> (2014年2月24日～2017年2月28日)



<分配の推移(税引前)>

2017年2月	150円
2016年11月	0円
2016年8月	150円
2016年5月	200円
2016年2月	0円
設定来累計	700円

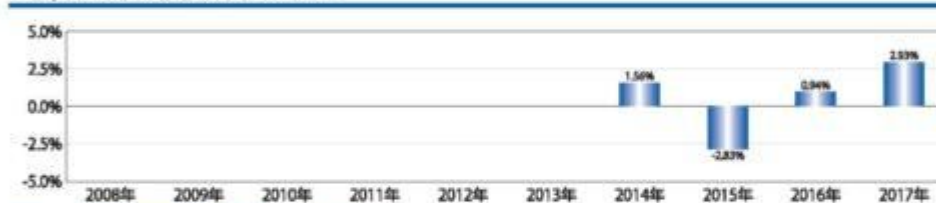
<主要な資産の状況>

資産配分

資産	純資産比率
投資証券	94.51%
投資信託受益証券	0.38%
その他資産	5.11%

※マザーファンドの保有口数に基づき計算した実質組入比率を記載しています。

<年間収益率の推移(暦年ベース)>



(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

<基準価額・純資産の推移> (2014年2月24日～2017年2月28日)



<分配の推移(税引前)>

2017年2月	300円
2016年11月	250円
2016年8月	0円
2016年5月	20円
2016年2月	0円
設定来累計	1,620円

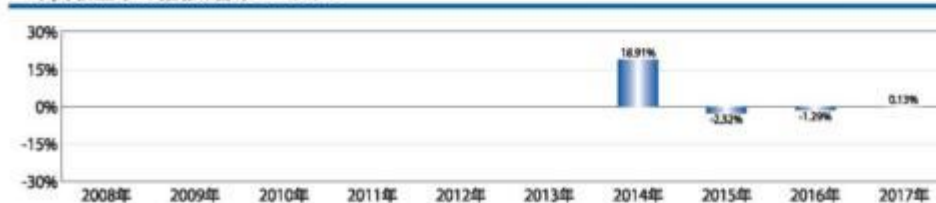
<主要な資産の状況>

資産配分

資産	純資産比率
投資証券	94.81%
投資信託受益証券	0.39%
その他資産	4.80%

※マザーファンドの保有口数に基づき計算した実質組入比率を記載しています。

<年間収益率の推移(暦年ベース)>



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2014年2月24日)

※分配金は1万口当たりです。※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2014年は設定日から年末までの収益率、および2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

-掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

-表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。

-委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

運用実績

データの基準日:2017年2月28日

グローバルライブ・マザーファンドの組入状況

ファンド・銘柄名	国・地域	通貨	純資産比率
ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスX	ルクセンブルグ	米ドル	97.11%
ISHARES SHORT TREASURY BOND ETF	アメリカ	米ドル	0.40%
		合計	97.51%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

※表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の会計と会計欄の数値が一致しない場合があります。

ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドの状況(2017年2月28日現在)

①資産配分

資産	比率
株式等	55.4%
債券	25.1%
コモディティ	3.8%
キャッシュその他	15.7%

②通貨別比率

通貨	比率
米ドル	66.0%
ユーロ	10.7%
日本円	8.8%
英ポンド	4.5%
その他	10.0%

③株式等地域別比率

地域	比率
北米	47.4%
欧州	25.9%
日本	19.5%
エマージング	5.4%
アジア・太平洋(日本を除く)	1.7%

④債券地域別比率

地域	比率
北米	50.7%
エマージング	22.5%
欧州	12.2%
アジア・太平洋(日本を除く)	8.8%
日本	5.7%

⑤株式等業種別比率

業種	比率
金融	18.9%
一般消費財・サービス	14.1%
情報技術	12.7%
資本財・サービス	12.2%
ヘルスケア	12.0%
その他	30.1%

⑥債券種別比率

債券種別	比率
国債・政府機関債	75.1%
社債	21.6%
転換社債(株式オプション部分除く)	2.9%
その他	0.4%

※上記はいずれもブラックロックからの情報を基に作成しています。

※表①、表②の比率は、ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドの純資産総額に対する割合です。

※表③、表④、表⑤、表⑥の比率は、ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドの組入株式等または組入債券全体を100%とした場合の割合です。

・掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
 ・委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(イ) 取得申込者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」について、販売会社ごとに定める申込単位で、取得申込受付日の翌営業日の基準価額で購入することができます。ただし、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。

また、スイッチングにより各ファンドを買い付ける場合は、販売会社ごとに定める申込単位となります。スイッチングについて、「分配金受取コース」の場合はスイッチング対象ファンドの同コースへの、「分配金再投資コース」の場合はスイッチング対象ファンドの同コースへのスイッチングとなります。なお、販売会社によってはスイッチングの取り扱いを行わない場合があります。

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

<http://www.am-one.co.jp/>

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込金額に手数料および当該手数料にかかる消費税等を加算した金額を販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

(ロ) 「分配金再投資コース」での取得申込者は、販売会社との間で「グローバルドライブ*自動継続投資約款」(別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。)にしたがって契約(以下「別に定める契約」といいます。)を締結します。

・上記の*には次の表の各ファンドの名称をあてはめてご覧ください。

(3ヵ月決算型) 限定為替ヘッジ	(3ヵ月決算型) 為替ヘッジなし
------------------	------------------

(ハ) 取得およびスイッチングの申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

- ・ルクセンブルクの銀行の休業日

- ・12月24日

また、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、取得およびスイッチングの申し込みの受付を中止することおよび既に受け付けた取得およびスイッチングの申し込みの受付を取り消すことができます。ただし、別に定める契約に基づく収益分配金の再投資にかかる追加信託金の申し込みに限ってこれを受け付けるものとします。

2【換金(解約)手続等】

一部解約(解約請求によるご解約)

(イ) 受益者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」の両コースとも、販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

なお、受付は原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

また、投資信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

(ロ) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行う

ものとしします。

(ハ) 委託者は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。また、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口座数の減少の記載または記録が行われます。

(ニ) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約に関して課税対象者にかかる所得税および地方税(法人の受益者の場合は所得税のみ)に相当する金額が控除されます。

なお、一部解約の価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

基準価額につきましては、アセットマネジメントOne株式会社のインターネットホームページ(<http://www.am-one.co.jp/>)または、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額および一部解約の価額は、前日以前のものとなります。

(ホ) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において受益者に支払われます。ただし、マザーファンドが投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

(ヘ) 委託者は、以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けないものとしします。

- ・ルクセンブルクの銀行の休業日
- ・12月24日

(ト) 委託者は、マザーファンドが投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

(チ) 上記(ト)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(この日が一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。)に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記(ニ)の規定に準じて計算された価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、投資信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(以下「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

基準価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください

い。

アセットマネジメントOne株式会社
 コールセンター 0120-104-694
 （受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）
 インターネットホームページ
<http://www.am-one.co.jp/>

基準価額は、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額は、前日以前のものとなります。

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
外貨建資産の 円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の 円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

各ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から平成36年2月19日までです。

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

各ファンドの計算期間は、原則として毎年2月19日から5月18日まで、5月19日から8月18日まで、8月19日から11月18日まで、11月19日から翌年2月18日までとします。

上記にかかわらず、上記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日以降の営業日で該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

(イ) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより、各ファンドの受益権の総口数が30億口を下回ることとなった場合、またはこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託者は、各ファンドにおいて、信託終了前に、マザーファンドが償還した場合は、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

また、委託者は、マザーファンドにおいて、所定の運用の基本方針に基づき、投資を行ったアロケーション・ファンドが償還、または次に掲げる事項の変更により商品の同一性が失われた場合は、受託者と合意のうえ、マザーファンドの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

1. アロケーション・ファンドの主要投資対象が変更となる場合

2. アロケーション・ファンドの取得の条件または換金の条件について、投資者に著しく不利となる変更がある場合

(ハ) 委託者は、上記(イ)の事項について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしがたがいます。

(ニ) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

(ホ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「c. 書面決議の手続き」の規定における書面決議が否決となる場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(ヘ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「b. 投資信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

b. 投資信託約款の変更等

(イ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託者は、上記(イ)の事項(投資信託約款の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしたがいます。

(ハ) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、上記(イ)および(ロ)の規定にしたがいます。

この投資信託約款は上記に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

c. 書面決議の手続き

(イ) 委託者は、上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(イ)について、または「b. 投資信託約款の変更等」(イ)の事項のうち重大な約款の変更等について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由または重大な約款の変更等の内容お

よびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、各ファンドにかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ロ) 上記(イ)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使用することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使用しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ハ) 上記(イ)の書面決議は議決権を行使用することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

(ニ) 重大な約款の変更等における書面決議の効力は、各ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

(ホ) 上記(イ)から(ニ)までの規定は、委託者が投資信託契約の解約または重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、各ファンドにかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときおよび上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(ロ)の規定に基づいてこの投資信託契約を解約する場合には適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(イ)から(ハ)までに規定する各ファンドの解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

(ヘ) 上記(イ)から(ホ)の規定にかかわらず、各ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

d. 反対受益者の受益権買取請求の不適用

各ファンドは、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託者が投資信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、投資信託契約の解約(上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(ロ)の場合を除きます。)または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

e. 運用報告書

委託者は、毎年2月、8月の決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知れている受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

運用報告書(全体版)は、下記「f. 公告」に記載の委託者のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

f. 公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am-one.co.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

g. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この

投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

h．信託事務処理の再信託

（イ）受託者は、各ファンドにかかる信託事務の処理の一部について資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

（ロ）上記（イ）における資産管理サービス信託銀行株式会社に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

i．信託業務の委託等

（イ）受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

- 1．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
- 2．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
- 3．委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
- 4．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

（ロ）受託者は、上記（イ）に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が上記（イ）各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

（ハ）上記（イ）および（ロ）にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

- 1．投資信託財産の保存にかかる業務
- 2．投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
- 3．委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
- 4．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

j．他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

- 1．他の受益者の氏名または名称および住所
- 2．他の受益者が有する受益権の内容

k．関係法人との契約の更改

委託者と販売会社との間において締結している「証券投資信託に関する基本契約」の有効期間は契約の締結日から1年ですが、期間満了前に委託者、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは自動的に1年間更新されるものとし、その後も同様とします。

また、委託者と投資顧問会社との間において締結している「投資一任契約」の有効期間は契約の締結日から投資信託約款に基づく信託終了日までとし、途中での更新は行いません。なお、委託者、投資顧問会社は、法律による解除権の行使以外に、相手方に対する事前の書面による解約の申し入れによりこの契約を解除することができます。

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

b. 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

c. 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

d. 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ

グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期特定期間(平成28年8月19日から平成29年2月20日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,352,397	48,620,276
親投資信託受益証券	789,484,948	771,178,277
派生商品評価勘定	-	10,527,192
未収入金	46,927,650	-
流動資産合計	864,764,995	830,325,745
資産合計	864,764,995	830,325,745
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	189,420	-
未払収益分配金	13,264,747	12,830,686
未払解約金	9,479,818	-
未払受託者報酬	69,672	68,737
未払委託者報酬	4,296,439	4,238,950
未払利息	42	80
その他未払費用	17,951	18,942
流動負債合計	27,318,089	17,157,395
負債合計	27,318,089	17,157,395
純資産の部		
元本等		
元本	884,316,498	855,379,098
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	46,869,592	42,210,748
(分配準備積立金)	631,918	161,673
元本等合計	837,446,906	813,168,350
純資産合計	837,446,906	813,168,350
負債純資産合計	864,764,995	830,325,745

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期特定期間		第6期特定期間	
	自	平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	自	平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
営業収益				
受取利息		35		23
有価証券売買等損益		23,238,572		127,693,329
為替差損益		101,521,875		103,103,749
営業収益合計		78,283,338		24,589,603
営業費用				
支払利息		4,739		10,054
受託者報酬		141,904		136,299
委託者報酬		8,750,496		8,405,113
その他費用		47,311		37,560
営業費用合計		8,944,450		8,589,026
営業利益		69,338,888		16,000,577
経常利益		69,338,888		16,000,577
当期純利益		69,338,888		16,000,577
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		4,958,568		759,484
期首剰余金又は期首欠損金()		90,055,011		46,869,592
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,266,490		4,203,111
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,266,490		4,203,111
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,759,666		1,954,674
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,759,666		1,954,674
分配金		31,701,725		12,830,686
期末剰余金又は期末欠損金()		46,869,592		42,210,748

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
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 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間に関する事項 当特定期間終了日に該当する日が休業日のため、当特定期間は平成28年 8月19日から平成29年 2月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 884,316,498口	1. 特定期間末日における受益権の総数 855,379,098口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 46,869,592円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 42,210,748円
3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9470円 (1万口当たり純資産額) (9,470円)	3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9507円 (1万口当たり純資産額) (9,507円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第5期特定期間 自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
1. 委託者報酬	当ファンドの主要投資対象であるグローバルドライブ・マザーファンドにおいて、信託財産の運用指図に関する権限を委託するための費用3,422,131円。	当ファンドの主要投資対象であるグローバルドライブ・マザーファンドにおいて、信託財産の運用指図に関する権限を委託するための費用3,314,772円。

2. 分配金の計算過程	第9期(自 平成28年 2月19日 至 平成28年 5月18日)	第11期(自 平成28年 8月19日 至 平成28年 11月18日)
	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(13,572,147円)及び分配準備積立金(21,887,793円)より分配対象収益は35,459,940円(1万口当たり384.65円)であり、うち18,436,978円(1万口当たり200円)を分配しております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,385,346円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(2,409,971円)及び分配準備積立金(621,535円)より分配対象収益は13,416,852円(1万口当たり153.44円)であります。分配を行っておりません。
	第10期(自 平成28年 5月19日 至 平成28年 8月18日)	第12期(自 平成28年 11月19日 至 平成29年 2月20日)
	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(13,045,005円)及び分配準備積立金(3,284,867円)より分配対象収益は16,329,872円(1万口当たり184.65円)であり、うち13,264,747円(1万口当たり150円)を分配しております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,658円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(2,719,757円)及び分配準備積立金(10,406,564円)より分配対象収益は13,145,979円(1万口当たり153.67円)であり、うち12,830,686円(1万口当たり150円)を分配しております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第5期特定期間 自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、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。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

<p>3.金融商品に係るリスクの管理体制</p>	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>
<p>4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在</p>	<p>第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

親投資信託受益証券 「(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。	同左
派生商品評価勘定 「(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。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

(関連当事者との取引に関する注記)

	第5期特定期間 自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
期首元本額	999,220,570円	884,316,498円
期中追加設定元本額	31,864,897円	34,624,891円
期中一部解約元本額	146,768,969円	63,562,291円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	32,135,503	52,383,115
合計	32,135,503	52,383,115

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

	第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
--	---------------------------	---------------------------

種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	766,961,580	-	767,151,000	189,420	746,309,192	-	735,782,000	10,527,192
米ドル	766,961,580	-	767,151,000	189,420	746,309,192	-	735,782,000	10,527,192
合計	766,961,580	-	767,151,000	189,420	746,309,192	-	735,782,000	10,527,192

時価の算定方法

為替予約取引

1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡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。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	グローバルドライブ・マザーファンド	633,411,316	771,178,277	
	合計	633,411,316	771,178,277	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係)」に記載しております。

【グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	237,082,347	702,116,896
親投資信託受益証券	12,279,421,798	10,655,580,385
流動資産合計	12,516,504,145	11,357,697,281
資産合計	12,516,504,145	11,357,697,281
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	332,531,898
未払解約金	37,050,015	65,099,221
未払受託者報酬	1,105,045	968,365
未払委託者報酬	68,144,647	59,715,995
未払利息	358	1,163
その他未払費用	284,857	267,241
流動負債合計	106,584,922	458,583,883
負債合計	106,584,922	458,583,883
純資産の部		
元本等		
元本	13,807,261,317	11,084,396,627
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,397,342,094	185,283,229
(分配準備積立金)	236,144,970	459,916
元本等合計	12,409,919,223	10,899,113,398
純資産合計	12,409,919,223	10,899,113,398
負債純資産合計	12,516,504,145	11,357,697,281

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期特定期間		第6期特定期間	
	自	平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	自	平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
営業収益				
受取利息		217		237
有価証券売買等損益		391,416,735		1,852,158,587
営業収益合計		391,416,518		1,852,158,824
営業費用				
支払利息		45,317		63,691
受託者報酬		2,322,045		1,944,254
委託者報酬		143,193,172		119,895,805
その他費用		597,384		536,552
営業費用合計		146,157,918		122,440,302
営業利益		537,574,436		1,729,718,522
経常利益		537,574,436		1,729,718,522
当期純利益		537,574,436		1,729,718,522
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		15,270,327		105,120,676
期首剰余金又は期首欠損金()		995,424,958		1,397,342,094
剰余金増加額又は欠損金減少額		160,832,696		227,342,746
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		160,832,696		227,342,746
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,062,076		3,191,417
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,062,076		3,191,417
分配金		31,383,647		636,690,310
期末剰余金又は期末欠損金()		1,397,342,094		185,283,229

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間に関する事項 当特定期間終了日に該当する日が休業日のため、当特定期間は平成28年 8月19日から平成29年 2月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 13,807,261,317口	1. 特定期間末日における受益権の総数 11,084,396,627口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,397,342,094円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 185,283,229円
3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8988円 (1万口当たり純資産額) (8,988円)	3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9833円 (1万口当たり純資産額) (9,833円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第5期特定期間 自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
1. 委託者報酬	当ファンドの主要投資対象であるグローバルドライブ・マザーファンドにおいて、信託財産の運用指図に関する権限を委託するための費用57,396,236円。	当ファンドの主要投資対象であるグローバルドライブ・マザーファンドにおいて、信託財産の運用指図に関する権限を委託するための費用47,937,794円。

2. 分配金の計算過程	第9期(自 平成28年 2月19日 至 平成28年 5月18日)	第11期(自 平成28年 8月19日 至 平成28年 11月18日)
	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(843,119,017円)及び分配準備積立金(300,684,274円)より分配対象収益は1,143,803,291円(1万口当たり728.90円)であり、うち31,383,647円(1万口当たり20円)を分配しております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(188,621,420円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(654,596,432円)及び分配準備積立金(207,921,664円)より分配対象収益は1,051,139,516円(1万口当たり863.95円)であり、うち304,158,412円(1万口当たり250円)を分配しております。
	第10期(自 平成28年 5月19日 至 平成28年 8月18日)	第12期(自 平成28年 11月19日 至 平成29年 2月20日)
	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(742,674,262円)及び分配準備積立金(236,144,970円)より分配対象収益は978,819,232円(1万口当たり708.90円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(320,483円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(425,472,212円)及び分配準備積立金(255,080,555円)より分配対象収益は680,873,250円(1万口当たり614.25円)であり、うち332,531,898円(1万口当たり300円)を分配しております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第5期特定期間 自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、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	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左

3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	第5期特定期間 自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	第6期特定期間 自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
期首元本額	16,327,239,194円	13,807,261,317円
期中追加設定元本額	178,205,843円	102,957,311円
期中一部解約元本額	2,698,183,720円	2,825,822,001円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期特定期間末 平成28年 8月18日現在	第6期特定期間末 平成29年 2月20日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	516,369,066	737,795,010
合計	516,369,066	737,795,010

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	グローバルドライブ・マザーファンド	8,752,016,744	10,655,580,385	

合計	8,752,016,744	10,655,580,385
----	---------------	----------------

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替ヘッジ」及び「グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッジなし」は、「グローバルドライブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

グローバルドライブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	平成28年 8月18日現在	平成29年 2月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	15,517	151,784
コール・ローン	182,491,082	407,620,935
投資信託受益証券	57,271,325	64,778,671
投資証券	17,640,155,443	15,639,285,946
流動資産合計	17,879,933,367	16,111,837,336
資産合計	17,879,933,367	16,111,837,336
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	15,000,000
未払利息	275	675
流動負債合計	275	15,000,675
負債合計	275	15,000,675
純資産の部		
元本等		
元本	17,205,967,265	13,221,081,564
剰余金		
剰余金又は欠損金()	673,965,827	2,875,755,097
元本等合計	17,879,933,092	16,096,836,661
純資産合計	17,879,933,092	16,096,836,661
負債純資産合計	17,879,933,367	16,111,837,336

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
----	--------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 (1) 投資証券 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 投資信託受益証券 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 8月18日現在	平成29年 2月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 17,205,967,265口	1. 計算日における受益権の総数 13,221,081,564口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0392円 (1万口当たり純資産額) (10,392円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2175円 (1万口当たり純資産額) (12,175円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、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。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左

2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 8月18日現在	平成29年 2月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 2.時価の算定方法 投資信託受益証券 「(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。 投資証券 「(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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成28年 2月19日 至 平成28年 8月18日	自 平成28年 8月19日 至 平成29年 2月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成28年 8月18日現在	平成29年 2月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	19,733,242,622円	17,205,967,265円
期中追加設定元本額	314,058,035円	48,074,895円
期中一部解約元本額	2,841,333,392円	4,032,960,596円
同期末における元本の内訳		
グローバルドライブ(3ヵ月決算型)限定為替 ヘッジ	759,704,531円	633,411,316円
グローバルドライブ(3ヵ月決算型)為替ヘッ ジなし	11,816,225,749円	8,752,016,744円
グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替 ヘッジ	583,035,521円	424,385,258円
グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッ ジなし	4,047,001,464円	3,411,268,246円
合計	17,205,967,265円	13,221,081,564円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

平成28年 8月18日現在	平成29年 2月20日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	31,131	23,479
投資証券	1,689,791,076	1,783,427,345
合計	1,689,822,207	1,783,450,824

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資信託受益証券	ISHARES SHORT TREASURY BOND ETF	5,200	573,872.00	
	投資信託受益証券 小計		5,200	573,872.00 (64,778,671)	
	投資証券	ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファン ド・クラスX	12,153,323.78	138,547,891.09	
	投資証券 小計		12,153,323.78	138,547,891.09 (15,639,285,946)	
米ドル建小計			12,158,523.78	139,121,763.09 (15,704,064,617)	
合計				15,704,064,617 (15,704,064,617)	

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

有価証券明細表注記

1. 小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄の記載は、邦貨金額であります。（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益 証券	1銘柄	0.4%	0.4%
	投資証券	1銘柄	97.2%	99.6%

（注1）組入投資信託受益証券時価比率及び組入投資証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

（注2）有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

グローバルドライブ・マザーファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド - クラスX」投資証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、「ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド - クラスX」の投資証券であります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

「ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド - クラスX」は、「ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド」の個別クラスとなっております。

「ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド」は、ルクセンブルグで設立された米ドル建外国投資法人であります。同ファンドの平成28年8月31日現在の財務書類は、ルクセンブルグの諸法規に準拠して作成されており、独立監査人の監査を受けております。

同ファンドの「純資産計算書」、「損益及び純資産変動計算書」、「投資有価証券明細表」、「To Be Announced証券取引明細表」、「外国為替予約取引明細表」、「先物取引明細表」、「金利スワップ明細表」、「クレジット・デフォルト・スワップ明細表」、「トータル・リターン・スワップ明細表」、「通貨スワップ

明細表」、「売建コールオプション明細表」、「売建プットオプション明細表」、「買建プットオプション明細表」、「買建コールオプション明細表」、「買建スワップオプション明細表」、「売建スワップオプション明細表」及び「金融デリバティブ商品の概要」は、ブラックロック・ジャパン株式会社から入手した財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものであります。

(1) 純資産計算書

2016年8月31日現在

区分	金額(米ドル)
資産	
有価証券ポートフォリオ(取得価額)	19,164,376,479
未実現利益	634,119,059
有価証券ポートフォリオ(市場価額)	19,798,495,538
銀行預金	83,141,975
ブローカーによる債権	19,007,000
未収利息及び未収配当金	59,974,813
投資売却による未収入金	109,871,580 *
ファンド投資証券発行による未収入金	26,536,894
外国為替予約取引にかかる未実現利益	4,278,042
To Be Announced 証券取引にかかる未実現利益	314,854,275
スワップの市場価額	8,250,319
買建オプション/スワップオプションの市場価額	131,929,096
その他の資産	5,112,523
資産合計	20,561,452,055
負債	
ブローカーへの債務	124,882,678
未払収益分配金	31,299,784
投資購入による未払金	424,281,889 *
ファンド投資証券償還による未払金	59,178,527
先物取引未実現損失	8,422,386
売建オプション/スワップオプションの市場価額	39,401,059
その他の負債	27,324,111
負債合計	714,790,434
純資産合計	19,846,661,621

* 未決済のTo Be Announced証券取引を含んでいます。

(2) 損益及び純資産変動計算書

2016年8月31日終了年度

区分	金額(米ドル)
純資産期首残高	23,006,081,749
収益	
銀行受取利息	258
債券利金	155,411,105
スワップ買建金利	16,646,969
配当金(源泉徴収後純額)	241,423,188
有価証券貸付	6,849,262
管理費の払戻し	153,918
収益合計	420,484,700
費用	
銀行支払利息	178,014
スワップ売建金利	5,538,009
管理事務代行報酬	34,519,939
保管及び預託報酬	3,304,625

分配費用	22,507,289
税金	8,004,494
管理会社報酬	234,797,518
費用合計	308,849,888
純利益	111,634,812
投資にかかる実現純(損失)	(65,520,379)
To Be Announced 証券取引 にかかる実現純利益	5,960,979
先物取引にかかる実現純利益	14,124,620
オプション取引にかかる実現純(損失)	(180,517,762)
スワップ取引にかかる実現純利益	33,155,014
外国為替予約取引にかかる実現純(損失)	(167,978,104)
その他の取引による外国為替にかかる実現純(損失)	(22,777,843)
当期実現純(損失)	(383,553,475)
投資にかかる未実現利益/(損失)の純変動額	875,441,989
To Be Announced 証券取引 にかかる実現純利益/(損失)の純変動額	(359,043)
先物取引にかかる未実現利益/(損失)の純変動額	(54,531,506)
オプション取引にかかる未実現利益/(損失)の純変動額	87,014,201
スワップ取引にかかる未実現利益/(損失)の純変動額	(4,189,245)
外国為替予約取引にかかる未実現利益/(損失)の純変動額	(83,481,725)
その他の取引による外国為替にかかる未実現利益/(損失)の純変動額	(799,793)
当期末実現利益/(損失)の純変動額	819,094,878
営業による純資産の増加額	547,176,215
投資証券の変動額	
投資証券発行による受取純額	3,784,246,024
投資証券買戻しによる支払純額	(7,459,543,149)
投資証券の変動による純資産の(減少)額	(3,675,297,125)
公表済配当金	(31,299,218)
純資産期末残高	19,846,661,621

To Be Announced証券取引とは、モーゲージ債の売買などにおいて、発行機関、年限、クーポン、額面金額などは特定するものの、受け渡しの対象となるモーゲージ・プール内の個別証券は指定せずに行う取引形態をいいます。

はアセットマネジメントOneにて追記しました。

(3) 投資有価証券明細表

2016年8月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたは他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券及びマネー・マーケット商品

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
ファンド			
	米国		
159,871	ETFS Physical Palladium Shares - ETF	10,370,832	0.05
135,935	ETFS Physical Platinum Shares - ETF	13,770,215	0.07
320,108	ETFS Physical Swiss Gold Shares - ETF	40,791,362	0.21
4,907,763	iShares Gold Trust - ETF*~	61,985,047	0.31
3,327,129	SPDR Gold Shares - ETF*	415,758,040	2.09
ファンド合計		542,675,496	2.73

普通/優先株式(証券)及びワラント

オーストラリア

5,365,000	TFS Corp Ltd (Wts 15/7/2018)	1,168,594	0.00
-----------	------------------------------	-----------	------

1,226,264	Westpac Banking Corp	27,133,922	0.14
		<hr/>	<hr/>
	ベルギー		
285,161	Anheuser-Busch InBev SA/NV	35,542,291	0.18
265,788	Umicore SA	15,780,432	0.08
		<hr/>	<hr/>
	バミューダ		
2,011,105	Axalta Coating Systems Ltd	57,678,492	0.29
58,678	Axis Capital Holdings Ltd	3,330,563	0.02
6,060,000	Brilliance China Automotive Holdings Ltd*	6,929,658	0.03
312,000	Cheung Kong Infrastructure Holdings Ltd	2,620,503	0.01
4,980,000	Haier Electronics Group Co Ltd	8,333,349	0.04
26,800	Jardine Matheson Holdings Ltd	1,603,980	0.01
317,346	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	11,487,925	0.06
159,505	XL Group Ltd	5,486,972	0.03
		<hr/>	<hr/>
	ブラジル		
119,822	SLC Agricola SA	537,026	0.00
		<hr/>	<hr/>
	イギリス領ヴァージン諸島		
548,393	Michael Kors Holdings Ltd*	27,041,259	0.14
		<hr/>	<hr/>
	カナダ		
765,308	Brookfield Asset Management Inc 'A'*	25,790,880	0.13
55,963	Brookfield Asset Management Inc 'A'*	1,885,469	0.01
1,489,371	Cameco Corp	13,776,682	0.07
971,754	Cenovus Energy Inc	14,284,263	0.07
4,999,018	EnCana Corp*	48,740,425	0.25
28,917	Fairfax Financial Holdings Ltd	16,333,011	0.08

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	カナダ(続き)		
1,022,437	Platinum Group Metals Ltd	2,814,092	0.01
3,460,855	Platinum Group Metals Ltd Npv	9,621,177	0.05
812,738	Toronto-Dominion Bank/The	36,416,711	0.18
		<hr/>	<hr/>
	ケイマン諸島		
706,702	Alibaba Group Holding Ltd ADR*	68,302,748	0.35
35,927,360	Chaoda Modern Agriculture Holdings Ltd*	815,180	0.00
4,954,337	Haitian International Holdings Ltd	9,976,590	0.05
		<hr/>	<hr/>
	キュラソー		
383,288	Schlumberger Ltd	30,404,321	0.15
		<hr/>	<hr/>
	チェコ		
54,207	CEZ AS	943,639	0.00
		<hr/>	<hr/>
	デンマーク		
262,666	Novo Nordisk A/S 'B'	12,396,418	0.06
		<hr/>	<hr/>

	フィンランド		
4,500,296	Nokia OYJ	25,676,176	0.13
	フランス		
617,655	Accor SA*	23,325,815	0.12
62,528	Aeroports de Paris*	6,479,330	0.03
70,299	Arkema SA	6,275,599	0.03
1,436,966	AXA SA	30,496,273	0.16
616,427	BNP Paribas SA	31,865,837	0.16
544,521	Cie de Saint-Gobain	24,189,434	0.12
370,101	Danone SA	28,114,661	0.14
22,521	Dassault Aviation SA	24,004,460	0.12
839,857	Engie SA	13,472,132	0.07
273,767	Legrand SA	16,446,358	0.08
137,749	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	23,508,491	0.12
400,137	Publicis Groupe SA	29,852,355	0.15
123,704	Renault SA	10,200,812	0.05
940,614	Safran SA	65,845,890	0.33
913,557	Sanofi	70,283,880	0.36
129,060	Sodexo SA	15,050,474	0.08
461,774	TOTAL SA	22,304,258	0.11
51,203	TOTAL SA ADR	2,476,177	0.01
260,907	Ubisoft Entertainment SA*	10,316,915	0.05
86,458	Unibail-Rodamco SE (Reit)	23,777,689	0.12
319,102	Vinci SA	24,411,213	0.12
		502,698,053	2.53

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	ドイツ		
121,539	adidas AG	20,213,862	0.10
119,153	Allianz SE	17,918,315	0.09
295,316	BASF SE	24,065,886	0.12
136,133	Bayerische Motoren Werke AG	11,969,051	0.06
2,651,853	Deutsche Telekom AG	44,444,352	0.22
484,401	Evonik Industries AG	16,466,275	0.08
181,372	HUGO BOSS AG*	11,021,103	0.06
200,099	Siemens AG	24,070,597	0.12
174,097	Volkswagen AG (Pref)	24,347,497	0.12
7,960	Volkswagen AG	1,169,533	0.01
898,475	Vonovia SE	35,122,456	0.18
		230,808,927	1.16
	ガンジー		
78,727	Amdocs Ltd	4,710,236	0.02
	香港		
3,691,600	AIA Group Ltd	23,343,673	0.12
2,942,943	Beijing Enterprises Holdings Ltd	16,883,303	0.08
296,500	CLP Holdings Ltd	3,040,748	0.01

601,000	Hang Lung Properties Ltd	1,369,848	0.01
424,000	Link REIT	3,082,908	0.02
616,000	Sino Land Co Ltd	1,054,616	0.00
3,475,582	Sun Hung Kai Properties Ltd	48,928,931	0.25
149,000	Swire Pacific Ltd 'A'	1,646,200	0.01
461,000	Wharf Holdings Ltd/The	3,256,845	0.02
		<hr/>	
		102,607,072	0.52
	インド		
3,807,950	Coal India Ltd	18,962,979	0.10
181,150	Maruti Suzuki India Ltd	13,669,826	0.07
3,283,095	Reliance Industries Ltd	51,964,744	0.26
		<hr/>	
		84,597,549	0.43
	インドネシア		
15,247,954	Siloam International Hospitals Tbk PT	12,989,210	0.07
	アイルランド		
49,168	Accenture Plc 'A'	5,653,828	0.03
45,336	Allergan plc (Pref)	37,778,489	0.19
648,892	CRH Plc	21,749,421	0.11
116,038	Medtronic Plc	9,987,391	0.05
426,263	Perrigo Co Plc	38,670,579	0.19
		<hr/>	
		113,839,708	0.57

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	イスラエル		
78,399	Teva Pharmaceutical Industries Ltd (Pref)	67,266,342	0.34
1,210,656	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	61,017,062	0.31
		<hr/>	
		128,283,404	0.65
	イタリア		
677,528	Ei Towers SpA	35,333,967	0.18
3,470,965	Enel SpA	15,339,890	0.08
212,568	Luxottica Group SpA*	10,266,114	0.05
330,487	Prysmian SpA	8,149,953	0.04
3,334,589	RAI Way SpA	14,157,500	0.07
684,287	Snam SpA	3,812,656	0.02
39,574,051	Telecom Italia SpA/Milano*	36,205,368	0.18
1,282,726	Telecom Italia SpA/Milano	943,403	0.01
		<hr/>	
		124,208,851	0.63
	日本		
477,030	Aisin Seiki Co Ltd	22,549,751	0.11
1,331,000	Ajinomoto Co Inc	28,245,429	0.14
224,100	Alfresa Holdings Corp*	4,187,508	0.02
156,200	Alpine Electronics Inc	1,881,836	0.01
689,800	Asahi Group Holdings Ltd	22,601,727	0.11
2,920,600	Asahi Kasei Corp	24,655,807	0.12
1,222,700	Astellas Pharma Inc	18,700,185	0.09
140,300	Autobacs Seven Co Ltd*	1,945,518	0.01
841,600	Bridgestone Corp	28,951,883	0.15
189,900	Canon Marketing Japan Inc	3,335,286	0.02

590,000	Chiyoda Corp*	4,772,982	0.02
869,000	Chubu Electric Power Co Inc*	11,764,378	0.06
228,200	COMSYS Holdings Corp*	4,317,118	0.02
257,800	Daikin Industries Ltd	23,921,462	0.12
3,508,000	Daiwa Securities Group Inc	20,517,079	0.10
1,054,170	Denso Corp	43,578,611	0.22
777,061	East Japan Railway Co	66,622,407	0.34
94,700	Exedy Corp	2,347,797	0.01
1,755,110	Fuji Heavy Industries Ltd	69,599,766	0.35
144,500	FUJIFILM Holdings Corp	5,435,179	0.03
2,257,000	Fukuoka Financial Group Inc	9,566,149	0.05
644,060	Futaba Industrial Co Ltd	3,028,964	0.02
2,070,000	GS Yuasa Corp	8,072,478	0.04
396,000	Hino Motors Ltd*	4,391,484	0.02
38,600	Hirose Electric Co Ltd	4,960,402	0.02
798,000	Hitachi Chemical Co Ltd*	17,220,242	0.09
875,676	Honda Motor Co Ltd	26,861,743	0.14
801,091	Hoya Corp	31,077,738	0.16
3,581,800	Inpex Corp*	31,138,849	0.16
1,827,000	Isuzu Motors Ltd*	21,047,447	0.11

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	日本(続き)		
2,000,700	Japan Airlines Co Ltd	60,927,057	0.31
279,300	Japan Tobacco Inc	10,832,536	0.05
881,090	JGC Corp*	13,991,373	0.07
777,900	JSR Corp	11,389,225	0.06
414,000	Kamigumi Co Ltd	3,589,549	0.02
1,537,800	KDDI Corp	45,178,635	0.23
25,600	Keyence Corp*	17,967,561	0.09
527,800	Kinden Corp	5,786,698	0.03
262,200	Koito Manufacturing Co Ltd	12,495,982	0.06
1,109,500	Komatsu Ltd	24,280,375	0.12
1,512,531	Kubota Corp	22,203,495	0.11
527,720	Kuraray Co Ltd	7,547,610	0.04
160,500	Kurita Water Industries Ltd	3,663,823	0.02
430,200	Kyocera Corp	20,465,095	0.10
824,800	Kyushu Electric Power Co Inc*	7,686,107	0.04
116,400	Mabuchi Motor Co Ltd	6,183,820	0.03
151,000	Maeda Road Construction Co Ltd	2,571,705	0.01
152,000	Makita Corp*	10,928,584	0.06
256,800	Medipal Holdings Corp*	4,065,461	0.02
3,874,000	Mitsubishi Electric Corp	50,627,408	0.26
3,823,000	Mitsubishi Estate Co Ltd	72,398,007	0.36
4,801,100	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	26,207,666	0.13
1,253,052	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	35,800,615	0.18
303,540	Murata Manufacturing Co Ltd	40,843,073	0.21
384,000	Nabtesco Corp*	9,917,707	0.05
7,939,000	NEC Corp	20,204,729	0.10

145,800	Nintendo Co Ltd	31,991,625	0.16
211,000	Nippo Corp	3,828,382	0.02
641,080	Nippon Telegraph & Telephone Corp	28,201,561	0.14
270,600	Nippon Television Holdings Inc	4,375,581	0.02
94,200	Nitori Holdings Co Ltd	9,562,201	0.05
416,900	Nitto Denko Corp*	28,497,980	0.14
510,600	NTT DOCOMO Inc	12,861,347	0.06
2,044,030	Okumura Corp	11,037,048	0.06
475,000	Omron Corp*	16,133,634	0.08
248,500	Otsuka Holdings Co Ltd	10,780,195	0.05
133,426	Rinnai Corp*	12,524,018	0.06
527,850	Rohm Co Ltd	26,407,820	0.13
510,400	Sanrio Co Ltd*	9,507,643	0.05
76,900	Sawai Pharmaceutical Co Ltd*	5,060,189	0.03
83,300	Secom Co Ltd	6,329,316	0.03
982,100	Sega Sammy Holdings Inc	13,428,557	0.07
293,000	Seino Holdings Co Ltd	3,073,466	0.02
840,800	Sekisui Chemical Co Ltd	11,765,015	0.06
638,400	Seven & i Holdings Co Ltd*	26,940,798	0.14

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	日本(続き)		
55,800	Shimamura Co Ltd*	6,463,382	0.03
1,023,694	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	75,226,739	0.38
51,100	SHO-BOND Holdings Co Ltd*	2,257,320	0.01
443,500	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	2,017,079	0.01
49,500	SMC Corp/Japan	13,958,098	0.07
1,128,100	Sompo Japan Nipponkoa Holdings Inc*	36,198,753	0.18
1,319,200	Sony Financial Holdings Inc	18,139,955	0.09
256,200	Stanley Electric Co Ltd	6,552,511	0.03
1,487,900	Sumco Corp*	13,015,884	0.07
1,084,800	Sumitomo Electric Industries Ltd	16,097,741	0.08
600,680	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	21,047,629	0.11
113,600	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	3,296,752	0.02
1,699,848	Suzuki Motor Corp	56,403,890	0.28
2,147,000	Toda Corp*	10,948,992	0.06
171,700	Toho Co Ltd/Tokyo*	5,009,439	0.03
1,331,198	Tokio Marine Holdings Inc	52,351,345	0.26
8,180,780	Tokyo Gas Co Ltd*	35,109,110	0.18
1,549,000	Toray Industries Inc*	14,935,392	0.08
1,176,323	Toyota Industries Corp	56,346,024	0.28
203,400	Toyota Motor Corp	12,278,005	0.06
212,700	Trend Micro Inc/Japan*	7,553,792	0.04
161,200	TV Asahi Holdings Corp	2,580,073	0.01
7,377,800	Ube Industries Ltd	13,421,968	0.07
307,800	West Japan Railway Co*	17,638,778	0.09
3,980,200	Yamada Denki Co Ltd*	18,641,538	0.09
284,800	Yamaha Corp	9,246,215	0.05
119,200	Yamato Kogyo Co Ltd*	3,650,745	0.02

116,600	Zenkoku Hoshō Co Ltd	4,586,597	0.02
		1,922,331,223	9.69
	ジャージー		
621,161	Integrated Diagnostics Holdings Plc	2,267,238	0.01
598,795	Shire Plc	37,591,580	0.19
		39,858,818	0.20
	メキシコ		
10,923,024	Fibra Uno Administracion SA de CV (Reit)	21,084,283	0.11
15,060,378	Telesites SAB de CV	8,869,088	0.04
		29,953,371	0.15

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	オランダ		
999,149	Airbus Group SE	58,753,894	0.30
1,129,405	Akzo Nobel NV	76,494,410	0.39
3,262,997	ING Groep NV	41,087,945	0.21
7,013,859	Koninklijke KPN NV	22,861,367	0.11
987,201	Koninklijke Philips NV	28,734,130	0.14
1,073,208	Mylan NV	45,600,608	0.23
439,237	Patheon NV	12,188,827	0.06
405,474	Randstad Holding NV*	19,268,612	0.10
1,142,810	Unilever NV	52,492,991	0.26
		357,482,784	1.80
	ポーランド		
125,655	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	2,093,922	0.01
	ポルトガル		
1,860,163	NOS SGPS SA	12,675,549	0.06
	シンガポール		
20,294,150	CapitaLand Ltd	45,692,501	0.23
810,100	ComfortDelGro Corp Ltd	1,681,360	0.01
32,444,300	Global Logistic Properties Ltd	43,186,770	0.22
4,400,000	Keppel Corp Ltd*	16,715,452	0.08
997,700	Singapore Telecommunications Ltd	2,941,452	0.01
565,300	United Overseas Bank Ltd*	7,466,695	0.04
		117,684,230	0.59
	韓国		
33,219	Coway Co Ltd	2,484,722	0.01
194,464	Hyundai Motor Co	23,196,153	0.12
27,931	KT&G Corp	2,930,876	0.01
16,920	Samsung Electronics Co Ltd (Pref)	20,091,551	0.10
534,817	SK Hynix Inc	17,483,479	0.09
15,059	SK Telecom Co Ltd	2,951,024	0.02
		69,137,805	0.35
	スペイン		
2,082,495	Cellnex Telecom SA*	36,561,304	0.18
466,044	Gas Natural SDG SA*	9,667,390	0.05
		46,228,694	0.23

スウェーデン			
2,875,686	SKF AB 'B'	48,783,459	0.25
2,486,755	Svenska Handelsbanken AB 'A'*	32,249,314	0.16
		81,032,773	0.41

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	スイス		
408,483	Chubb Ltd	52,040,734	0.26
331,072	Cie Financiere Richemont SA*	19,272,805	0.10
1,358,587	Nestle SA	108,192,770	0.55
422,322	Novartis AG	33,223,826	0.17
118,221	Roche Holding AG	28,875,686	0.15
1,973,868	UBS Group AG*	28,686,182	0.14
33,097	Zurich Insurance Group AG	8,535,357	0.04
		278,827,360	1.41
	台湾		
4,047,160	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	8,596,723	0.04
829,000	Chunghwa Telecom Co Ltd	2,978,393	0.01
743,000	Far Eastone Telecommunications	1,730,437	0.01
540,000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	1,402,309	0.01
642,000	Formosa Plastics Corp	1,584,234	0.01
1,885,000	Fubon Financial Holding Co Ltd	2,667,352	0.01
1,095,000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	3,036,823	0.02
686,000	Nan Ya Plastics Corp	1,310,145	0.01
503,000	Taiwan Mobile Co Ltd	1,767,525	0.01
5,234,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	29,031,471	0.15
3,060,000	Yulon Motor Co Ltd	2,647,198	0.01
		56,752,610	0.29
	タイ		
600,800	Advanced Info Service PCL	2,872,484	0.01
1,150,600	Intouch Holdings PCL	1,869,720	0.01
948,900	PTT Global Chemical PCL	1,672,168	0.01
204,800	Siam Cement PCL/The	3,135,707	0.01
655,800	Thai Oil PCL	1,340,379	0.01
		10,890,458	0.05
	英国		
580,723	Aggreko Plc*	7,766,042	0.04
839,240	AstraZeneca Plc	54,126,408	0.27
3,564,008	BAE Systems Plc	25,071,905	0.13
510,589	Berkeley Group Holdings Plc	17,909,646	0.09
1,391,438	BP Plc ADR*	47,308,892	0.24
737,656	Burberry Group Plc	12,627,997	0.06
37,843	Coca-Cola European Partners Plc	1,436,142	0.01
211,054	Diageo Plc ADR	23,697,143	0.12
1,467,343	GlaxoSmithKline Plc	31,519,584	0.16
12,718,794	HSBC Holdings Plc	94,523,599	0.48
414,932	HSBC Holdings Plc	10,970,802	0.05
446,165	Liberty Global Plc 'A'*	14,063,121	0.07
48,296	Liberty Global Plc LiLAC 'A'	1,329,589	0.01

175,282	Meggitt Plc	1,076,980	0.00
1,031,764	National Grid Plc	14,223,532	0.07
1,518,666	NMC Health Plc	27,052,423	0.14
1,563,329	Pearson Plc	17,773,587	0.09
836,804	Prudential Plc	15,086,250	0.07

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	英国(続き)		
443,439	Royal Bank of Scotland Group Plc (Pref)	11,258,916	0.06
1,407,055	Royal Dutch Shell Plc ADR 'A'*	69,466,305	0.35
1,183,679	Smiths Group Plc	20,883,656	0.10
5,073,611	Spire Healthcare Group Plc	23,114,703	0.12
14,814,733	Vodafone Group Plc	44,921,041	0.23
1,095,664	Vodafone Group Plc ADR*	33,735,495	0.17
		620,943,758	3.13
	米国		
25,692	3M Co	4,616,082	0.02
50,976	AbbVie Inc	3,265,523	0.02
580,709	Activision Blizzard Inc	23,948,439	0.12
205,999	Adobe Systems Inc	21,048,978	0.11
627,096	Aetna Inc	73,389,045	0.37
106,557	Air Products & Chemicals Inc	16,684,695	0.08
184,760	Alexion Pharmaceuticals Inc	23,555,052	0.12
11,641	Alliance Data Systems Corp*	2,370,224	0.01
629,089	Allstate Corp/The	43,520,377	0.22
306,078	Alphabet Inc 'C'	234,685,306	1.18
585,379	Altria Group Inc	38,576,476	0.19
93,663	Amazon.com Inc	71,604,427	0.36
207,156	American Electric Power Co Inc	13,336,703	0.07
532,782	American International Group Inc	31,871,019	0.16
82,583	American Tower Corp (Pref)	9,130,376	0.05
63,735	American Tower Corp (Reit)	7,211,615	0.04
246,741	American Water Works Co Inc	18,187,279	0.09
424,035	Amgen Inc	72,497,264	0.36
1,875,538	Anadarko Petroleum Corp	102,967,036	0.52
462,156	Anthem Inc	57,848,067	0.29
1,024,365	Anthem Inc (Pref)	44,385,735	0.22
2,679,648	Apple Inc	285,060,954	1.44
32,935	Archer-Daniels-Midland Co	1,424,439	0.01
46,604	AT&T Inc	1,900,278	0.01
6,526,736	Bank of America Corp	104,623,578	0.53
595,161	Baxter International Inc	27,782,115	0.14
443,648	Bed Bath & Beyond Inc*	20,625,196	0.10
286	Berkshire Hathaway Inc 'A'	64,312,820	0.32
471,594	Berkshire Hathaway Inc 'B'	70,682,509	0.36
49,194	Biogen Inc	15,092,719	0.08
21,204	Boeing Co/The	2,766,486	0.01
572,422	Bristol-Myers Squibb Co	32,771,159	0.16
1,417,741	Brookdale Senior Living Inc*	24,583,629	0.12

654,310	Calpine Corp	8,309,737	0.04
55,339	Capital One Financial Corp	3,919,108	0.02
57,821	Cardinal Health Inc	4,621,633	0.02
793,436	Catalent Inc*	20,097,734	0.10
111,580	Celgene Corp	11,980,345	0.06

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	米国(続き)		
377,552	Centene Corp*	25,862,312	0.13
740,114	Charles Schwab Corp/The	23,506,021	0.12
135,214	Charter Communications Inc 'A'	34,809,492	0.18
17,123	Chevron Corp	1,725,485	0.01
65,475	Chipotle Mexican Grill Inc*	27,289,980	0.14
51,631	Cintas Corp*	6,037,213	0.03
1,445,563	Cisco Systems Inc	45,419,589	0.23
680,417	Citigroup Capital XIII (Pref)	17,663,625	0.09
1,149,641	Citigroup Inc	55,159,775	0.28
244,817	CME Group Inc	26,611,608	0.13
560,205	Coca-Cola Co	24,178,448	0.12
307,117	Colfax Corp*	9,265,720	0.05
1,325,004	Comcast Corp 'A'	86,681,762	0.44
1,606,113	CommScope Holding Co Inc	47,283,967	0.24
72,037	Computer Sciences Corp	3,377,815	0.02
35,131	Constellation Brands Inc 'A'	5,795,561	0.03
222,834	Crown Castle International Corp (Pref)	24,981,920	0.13
72,736	Crown Castle International Corp (Reit)	6,848,822	0.03
25,672	Crown Holdings Inc	1,385,775	0.01
190,719	CVS Health Corp	17,654,858	0.09
324,654	DaVita HealthCare Partners Inc	20,920,704	0.11
1,033,187	Delta Air Lines Inc	38,320,906	0.19
333,885	Discover Financial Services	19,939,612	0.10
517,433	DISH Network Corp 'A'	26,047,577	0.13
233,894	Dominion Resources Inc/VA	17,350,257	0.09
870,081	Dominion Resources Inc/VA (Pref)	44,072,933	0.22
17,575	Dover Corp	1,284,557	0.01
29,636	Dr Pepper Snapple Group Inc	2,761,186	0.01
713,784	Edgewell Personal Care Co	56,874,309	0.29
971,072	El du Pont de Nemours & Co	67,674,008	0.34
112,017	Electronic Arts Inc	9,113,703	0.05
726,243	Eli Lilly & Co	56,639,692	0.28
376,022	EQT Corp*	26,878,053	0.14
157,733	Expedia Inc	17,304,887	0.09
339,787	Exxon Mobil Corp	29,576,759	0.15
1,294,204	Facebook Inc 'A'	162,396,718	0.82
73,727	Fifth Third Bancorp	1,480,438	0.01
1,013,484	Fitbit Inc 'A'*	15,931,968	0.08
2,347,085	Ford Motor Co	29,538,065	0.15
279,939	Fortune Brands Home & Security Inc	17,834,914	0.09
4,247,589	General Electric Co	132,949,536	0.67

1,054,996 Gilead Sciences Inc 82,864,661 0.42

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	米国(続き)		
65,653	Global Payments Inc	4,977,154	0.02
858,883	GMAC Capital Trust I (Pref)	21,721,151	0.11
211,990	Goldman Sachs Group Inc/The	36,019,221	0.18
73,123	Goodyear Tire & Rubber Co/The	2,146,160	0.01
199,398	Hartford Financial Services Group Inc/The	8,161,360	0.04
26,235	HCA Holdings Inc	1,989,400	0.01
449,862	HD Supply Holdings Inc	16,365,980	0.08
43,751	Helmerich & Payne Inc	2,668,811	0.01
108	Hershey Co/The	10,848	0.00
163,037	Hexcel Corp	7,352,969	0.04
140,441	Home Depot Inc/The	18,857,013	0.09
94,376	HTG Molecular Diagnostics Inc	236,884	0.00
19,869	Illinois Tool Works Inc	2,374,147	0.01
848,052	Intel Corp	30,250,015	0.15
55,630	International Business Machines Corp	8,861,303	0.04
77,444	International Paper Co*	3,771,523	0.02
190,416	Intuit Inc	21,174,259	0.11
798,216	Invitae Corp	6,146,263	0.03
613,685	Johnson & Johnson	73,237,168	0.37
1,583,186	JPMorgan Chase & Co	107,165,860	0.54
352,997	Kansas City Southern	34,050,091	0.17
33,790	Kimberly-Clark Corp	4,338,298	0.02
47,900	KLA-Tencor Corp	3,263,906	0.02
503,092	Kroger Co/The	16,184,470	0.09
51,933	Lear Corp	6,061,100	0.03
142,804	Liberty Broadband Corp 'A'*	9,707,816	0.05
280,526	Liberty Broadband Corp 'C'	19,314,215	0.10
36,144	Liberty Media Group LLC 'C'	772,397	0.00
512,080	Liberty SiriusXM Group 'A'	17,088,110	0.09
960,189	Liberty SiriusXM Group 'C'	31,868,673	0.16
256,207	Lowe's Cos Inc	19,594,711	0.10
350,543	Mandatory Exchangeable Trust (Pref)	41,860,092	0.21
3,637,748	Marathon Oil Corp*	55,984,942	0.28
3,381,219	Marathon Petroleum Corp*	144,716,173	0.73
544,973	Marsh & McLennan Cos Inc	36,943,720	0.19
505,490	Masco Corp	17,944,895	0.09
356,604	MasterCard Inc 'A'	34,472,909	0.17
37,557	McDonald's Corp	4,343,091	0.02
223,350	McKesson Corp	41,009,293	0.21
512,229	Merck & Co Inc	32,275,549	0.16
数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	米国(続き)		

815,843	MetLife Inc	35,546,279	0.18
1,857,253	Micron Technology Inc*	30,700,392	0.15
124,012	Microsoft Corp	7,154,252	0.04
77,702	Mohawk Industries Inc	16,473,601	0.08
970,715	Mondelez International Inc 'A'	43,565,689	0.22
166,750	Monsanto Co	17,788,890	0.09
54,499	Morgan Stanley	1,757,593	0.01
350,580	NextEra Energy Inc	42,549,895	0.21
497,341	NextEra Energy Partners LP (Unit)	14,681,506	0.07
101,759	Northrop Grumman Corp	21,537,292	0.11
1,267,036	Nuance Communications Inc	18,346,681	0.09
37,662	Oracle Corp	1,553,934	0.01
288,790	PACCAR Inc	17,416,925	0.09
36,537	Packaging Corp of America	2,887,154	0.01
572,977	PayPal Holdings Inc	21,131,392	0.11
410,292	PepsiCo Inc	43,675,583	0.22
1,794,375	Pfizer Inc	62,533,969	0.31
43,967	Phillips 66	3,468,996	0.02
115,967	Pioneer Natural Resources Co	20,983,069	0.11
176,187	Prudential Financial Inc	14,073,818	0.07
1,794,914	Pure Storage Inc 'A'	21,359,477	0.11
943,234	QUALCOMM Inc	59,329,419	0.30
68,114	Ralph Lauren Corp 'A'	7,109,739	0.04
27,643	Raytheon Co	3,871,402	0.02
208,801	Realogy Holdings Corp	5,702,355	0.03
33,986	Reinsurance Group of America Inc 'A'	3,628,345	0.02
20,597	Rockwell Automation Inc	2,412,527	0.01
185,025	Roper Technologies Inc	33,017,711	0.17
479,670	Sabre Corp*	13,483,524	0.07
17,993	Scripps Networks Interactive Inc 'A'*	1,142,196	0.01
38,999	Sealed Air Corp	1,834,123	0.01
230,554	Sempra Energy	24,035,254	0.12
237,521	Simon Property Group Inc	51,202,402	0.26
654,183	Southwest Airlines Co	24,414,110	0.12
1,272,605	Square Inc 'A'	15,525,781	0.08
2,443,211	St Joe Co/The	46,249,984	0.23
171,306	Stericycle Inc (Pref)	11,820,114	0.06
22,361	Stryker Corp	2,581,577	0.01
372,461	SunTrust Banks Inc	16,399,458	0.08
626,448	Target Corp*	44,271,080	0.22

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	米国(続き)		
1,295,999	Tenet Healthcare Corp*	30,831,816	0.15
210,716	Thermo Fisher Scientific Inc	32,119,440	0.16
329,251	Tiffany & Co*	23,679,732	0.12
578,517	Time Warner Inc	45,378,873	0.23
59,878	Travelers Cos Inc	7,123,087	0.04
38,063	Tyson Foods Inc 'A'	2,863,860	0.01

1,221,470	United Continental Holdings Inc	61,501,014	0.31
396,510	United Rentals Inc*	32,605,017	0.16
208,754	United Technologies Corp	22,282,402	0.11
24,909	UnitedHealth Group Inc	3,393,851	0.02
526,491	Unum Group	18,787,831	0.09
834,854	US Bancorp	36,883,850	0.19
220,796	US Bancorp (Pref)	5,764,984	0.03
375,953	US Bancorp (Pref)	11,684,619	0.06
89,937	Valero Energy Corp	4,996,900	0.02
308,196	Veeva Systems Inc 'A'	12,595,971	0.06
54,503	VeriSign Inc*	4,051,753	0.02
69,632	Verizon Communications Inc	3,642,450	0.02
557,349	Visa Inc 'A'*	45,145,269	0.23
67,067	WABCO Holdings Inc*	7,170,804	0.04
80,888	Walgreens Boots Alliance Inc	6,510,675	0.03
2,127,115	Wells Fargo & Co	108,185,069	0.54
6,927	Wells Fargo & Co (Pref)	9,368,767	0.05
333,799	Welltower Inc (Pref)	23,088,877	0.12
634,574	Western Digital Corp	29,717,100	0.15
614,583	WestRock Co	29,567,588	0.15
705,350	Whole Foods Market Inc*	21,583,710	0.11
1,137,729	Williams Cos Inc/The	31,680,064	0.16
188,465	Williams-Sonoma Inc	10,067,800	0.05
47,663	Wyndham Worldwide Corp	3,400,755	0.02
322,670	Zimmer Biomet Holdings Inc	41,785,765	0.21
		5,484,508,469	27.64
	普通ノ優先株式(証券)及びワラント合計	10,957,997,582	55.21

	数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産 比率 %
債券				
		アルゼンチン		
USD	25,256,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/4/2021	27,529,040	0.14
USD	32,095,000	Argentine Republic Government International Bond 7.125% 6/7/2036	34,234,774	0.17
USD	33,051,000	Argentine Republic Government International Bond 7.5% 22/4/2026	37,182,375	0.19
USD	9,710,000	City of Buenos Aires Argentina 8.95% 19/2/2021*	10,996,575	0.06
USD	9,642,500	IRSA Propiedades Comerciales SA 8.75% 23/3/2023	10,630,856	0.05
USD	12,431,000	Provincia de Buenos Aires/Argentina 9.125% 16/3/2024	13,867,153	0.07
USD	40,455,000	YPF SA 8.5% 28/7/2025*	43,578,126	0.22
			178,018,899	0.90
		オーストラリア		
AUD	102,909,000	Australia Government Bond 5.75% 15/5/2021	92,067,931	0.47
AUD	183,112,000	Australia Government Bond 5.75% 15/7/2022	169,148,575	0.85

USD	25,000,000	TFS Corp Ltd 8.75% 1/8/2023	25,656,250	0.13
			286,872,756	1.45
ブラジル				
BRL	10,534,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B 6% 15/8/2022	9,517,403	0.05
BRL	128,722,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2018	39,337,601	0.20
BRL	169,234,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2021	49,845,602	0.25
EUR	6,158,000	Brazilian Government International Bond 2.875% 1/4/2021*	7,025,312	0.03
USD	13,111,000	Brazilian Government International Bond 4.875% 22/1/2021	13,976,326	0.07
			119,702,244	0.60
カナダ				
CAD	57,305,000	Canada Housing Trust No 1 1.25% 15/6/2021	44,092,886	0.22
CAD	86,489,000	Canadian Government Bond 0.25% 1/5/2018	65,583,572	0.33
CAD	157,541,000	Canadian Government Bond 0.5% 1/8/2018	119,937,096	0.60
CAD	53,950,000	Canadian Government Bond 0.75% 1/3/2021	41,334,332	0.21
USD	7,718,000	First Quantum Minerals Ltd 6.75% 15/2/2020	7,100,560	0.04
			278,048,446	1.40
	数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
ケイマン諸島				
USD	15,612,000	Alibaba Group Holding Ltd 3.125% 28/11/2021	16,207,254	0.08
USD	11,084,000	Odebrecht Finance Ltd 4.375% 25/4/2025	3,796,270	0.02
			20,003,524	0.10
チリ				
USD	15,339,755	Inversiones Alsacia SA (Defaulted) 8% 31/12/2018	1,016,259	0.01
フランス				
USD	25,473,000	BNP Paribas SA 2.4% 12/12/2018	25,938,685	0.13
EUR	100,021,725	France Government Bond OAT 0.5% 25/5/2026*	115,159,040	0.58
			141,097,725	0.71
ドイツ				
EUR	109,729,584	Bundesobligation 9/4/2021 (Zero Coupon)*	125,480,203	0.63
USD	9,885,000	Deutsche Bank AG/London 1.875% 13/2/2018	9,838,649	0.05
USD	3,662,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.5% 15/1/2023*	3,867,988	0.02
			139,186,840	0.70
ハンガリー				
HUF	18,162,260,000	Hungary Government Bond 5.5% 24/6/2025	79,286,597	0.40
USD	11,824,000	Hungary Government International Bond 6.25% 29/1/2020	13,316,780	0.07

USD	74,502,000	Hungary Government International Bond 6.375% 29/3/2021	86,236,065	0.43
			178,839,442	0.90
インド				
USD	19,051,000	REI Agro Ltd (Restricted) (Defaulted) 5.5% 13/11/2014	1,607,428	0.01
USD	26,296,000	Suzlon Energy Ltd (Step-up coupon) 5.75% 16/7/2019	28,136,720	0.14
			29,744,148	0.15
インドネシア				
EUR	25,171,000	Indonesia Government International Bond 2.625% 14/6/2023	29,637,017	0.15
USD	13,356,000	Indonesia Government International Bond '144A' 6.875% 17/1/2018	14,357,700	0.07
			43,994,717	0.22
アイルランド				
USD	6,848,000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 2.342% 15/11/2020	7,060,483	0.04

	数量	銘柄	時価（米ドル）	純資産 比率 %
イタリア				
USD	20,795,000	Intesa Sanpaolo SpA 3.875% 15/1/2019*	21,377,759	0.11
EUR	77,998,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.5% 1/6/2025*	90,873,912	0.46
USD	17,549,000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30/5/2024*	18,163,215	0.09
			130,414,886	0.66
日本				
JPY	4,626,000,000	Japan Government Two Year Bond 0.1% 15/3/2017	44,849,230	0.23
JPY	12,108,450,000	Japan Government Two Year Bond 0.1% 15/3/2018	117,738,081	0.59
JPY	24,450,000,000	Japan Treasury Discount Bill 5/9/2016 (Zero Coupon)	236,599,027	1.19
JPY	11,450,000,000	Japan Treasury Discount Bill 12/9/2016 (Zero Coupon)	110,801,726	0.56
JPY	23,480,000,000	Japan Treasury Discount Bill 3/10/2016 (Zero Coupon)	227,246,222	1.14
JPY	4,660,000,000	Japan Treasury Discount Bill 11/10/2016 (Zero Coupon)	45,102,494	0.23
JPY	11,680,000,000	Japan Treasury Discount Bill 17/10/2016 (Zero Coupon)	113,050,325	0.57
JPY	6,990,000,000	Japan Treasury Discount Bill 24/10/2016 (Zero Coupon)	67,660,743	0.34
JPY	23,350,000,000	Japan Treasury Discount Bill 31/10/2016 (Zero Coupon)	226,030,297	1.14
JPY	4,690,000,000	Japan Treasury Discount Bill 7/11/2016 (Zero Coupon)	45,401,091	0.23

JPY	23,270,000,000	Japan Treasury Discount Bill 21/11/2016 (Zero Coupon)	225,285,613	1.13
USD	11,458,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.45% 10/1/2019	11,669,818	0.06
			1,471,434,667	7.41
		ジャージー		
USD	32,932,030	Dana Gas Sukuk Ltd 7% 31/10/2017	29,474,167	0.15
USD	10,665,000	UBS Group Funding Jersey Ltd 4.125% 24/9/2025	11,268,905	0.06
			40,743,072	0.21
数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産 比率 %	
	ルクセンブルグ			
USD	14,832,000	Actavis Funding SCS 3% 12/3/2020	15,351,290	0.08
USD	16,588,000	Intelsat Jackson Holdings SA 7.5% 1/4/2021	12,523,940	0.06
USD	5,120,000	Intelsat Jackson Holdings SA 8% 15/2/2024	5,158,400	0.02
EUR	16,700,000	Telecom Italia Finance SA 6.125% 15/11/2016	19,499,082	0.10
			52,532,712	0.26
	メキシコ			
MXN	3,104,463,100	Mexican Bonos 6.5% 10/6/2021	171,578,730	0.86
USD	8,616,000	Trust F/1401 5.25% 15/12/2024	9,219,120	0.05
			180,797,850	0.91
	オランダ			
EUR	7,536,000	Constellium NV 7% 15/1/2023*	8,443,884	0.04
USD	2,300,000	Constellium NV 8% 15/1/2023	2,351,750	0.01
USD	4,520,000	Cooperatieve Rabobank UA 3.95% 9/11/2022	4,753,173	0.03
USD	9,405,000	ING Groep NV FRN 16/4/2020 (Perpetual)	9,322,707	0.05
			24,871,514	0.13
	ニュージーランド			
NZD	97,073,000	New Zealand Government Bond 6% 15/5/2021	83,578,349	0.42
	ポーランド			
PLN	56,875,000	Poland Government Bond 2.5% 25/7/2026	14,285,002	0.07
PLN	128,663,000	Poland Government Bond 3.25% 25/7/2025	34,420,451	0.17
PLN	110,573,000	Poland Government Bond 5.25% 25/10/2020	31,966,399	0.16
PLN	94,847,000	Poland Government Bond 5.75% 25/10/2021	28,497,510	0.15
			109,169,362	0.55
	シンガポール			
SGD	20,250,000	CapitalLand Ltd 1.95% 17/10/2023	14,882,730	0.07
SGD	21,750,000	CapitalLand Ltd 2.1% 15/11/2016	15,987,149	0.08
USD	32,138,000	Global Logistic Properties Ltd 3.875% 4/6/2025	33,624,383	0.17
			64,494,262	0.32
	韓国			
USD	15,106,000	Export-Import Bank of Korea 2.625% 30/12/2020*	15,683,986	0.08

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産 比率 %
USD	7,656,000 Export-Import Bank of Korea 2.875% 17/9/2018	7,874,824	0.04
		23,558,810	0.12
<hr/>			
スペイン			
EUR	36,602,000 Spain Government Bond '144A'1.95% 30/4/2026*	44,441,897	0.23
EUR	27,300,000 Telefonica Participaciones SAU 4.9% 25/9/2017	26,366,394	0.13
		70,808,291	0.36
<hr/>			
スイス			
USD	8,505,000 UBS AG/Stamford CT 2.375% 14/8/2019	8,688,291	0.04
<hr/>			
トルコ			
USD	15,660,000 Turkey Government International Bond 6.75% 3/4/2018	16,687,687	0.08
<hr/>			
英国			
USD	30,772,000 HSBC Holdings Plc FRN 17/9/2024 (Perpetual)*	30,502,745	0.15
GBP	12,707,000 Lloyds Bank Plc FRN 21/1/2029 (Perpetual)	28,793,810	0.15
USD	3,809,000 Lloyds Bank Plc 2.3% 27/11/2018	3,851,649	0.02
GBP	13,589,000 Logistics UK 2015 Plc '2015-1X F'FRN 20/8/2025	16,421,596	0.08
USD	7,040,000 Standard Chartered Plc FRN 2/4/2020 (Perpetual)	6,663,360	0.03
GBP	90,145,669 United Kingdom Gilt 1.5% 22/1/2021*	124,802,947	0.63
GBP	6,268,700 United Kingdom Gilt 2% 7/9/2025*	9,286,761	0.05
GBP	15,790,207 United Kingdom Gilt 3.5% 22/1/2045	31,942,335	0.16
		252,265,203	1.27
<hr/>			
米国			
USD	14,765,000 AbbVie Inc 2.3% 14/5/2021	14,953,431	0.08
USD	18,235,000 AbbVie Inc 2.5% 14/5/2020	18,689,991	0.09
USD	14,981,000 Ally Financial Inc 2.75% 30/1/2017	15,015,059	0.08
USD	10,278,000 Ally Financial Inc 3.5% 27/1/2019	10,483,560	0.05
USD	10,575,000 American Express Co FRN 15/3/2020 (Perpetual)	10,456,031	0.05
USD	4,131,000 American Tower Corp 3.4% 15/2/2019	4,305,882	0.02
USD	19,216,000 Anheuser-Busch InBev Finance Inc 2.65% 1/2/2021	19,829,029	0.10
USD	21,244,000 AT&T Inc 2.375% 27/11/2018	21,685,546	0.11
USD	32,771,000 AT&T Inc 3% 30/6/2022	33,833,354	0.17
USD	8,652,000 Bank of America Corp 2% 11/1/2018	8,710,457	0.04
USD	8,436,000 Bank of America Corp 2.6% 15/1/2019	8,630,306	0.04
USD	8,380,000 Bank of America Corp 6.875% 25/4/2018	9,094,165	0.05
USD	11,910,000 Berkshire Hathaway Inc 2.75% 15/3/2023	12,438,042	0.06
USD	7,344,000 Cablevision Systems Corp 5.875% 15/9/2022	6,966,665	0.04
USD	6,700,000 Capital One Bank USA NA 2.15% 21/11/2018	6,760,886	0.03

	数量	銘柄	時価（米ドル）	純資産 比率 %
		米国（続き）		
USD	11,817,000	Cisco Systems Inc 2.2% 28/2/2021	12,138,222	0.06
USD	20,960,000	Citigroup Inc FRN 27/3/2020 (Perpetual)	21,248,200	0.11
USD	8,693,000	Citigroup Inc FRN 30/1/2023 (Perpetual)	8,964,656	0.05
USD	24,386,000	Citigroup Inc 1.8% 5/2/2018	24,525,134	0.12
USD	27,103,000	Cobalt International Energy Inc 2.625% 1/12/2019	12,636,774	0.06
USD	31,086,000	Cobalt International Energy Inc 3.125% 15/5/2024	12,745,260	0.06
USD	8,394,000	eBay Inc 3.8% 9/3/2022	8,977,811	0.05
USD	10,484,000	Edgewell Personal Care Co 4.7% 19/5/2021	11,197,740	0.06
USD	9,349,000	Edgewell Personal Care Co 4.7% 24/5/2022	9,769,705	0.05
USD	4,856,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.551% 5/10/2018	4,938,290	0.03
USD	13,629,000	Ford Motor Credit Co LLC 5% 15/5/2018	14,375,208	0.07
USD	7,686,000	Forest Laboratories LLC '144A' 5% 15/12/2021	8,643,030	0.04
USD	9,112,000	Freeport-McMoRan Inc 3.875% 15/3/2023	8,064,120	0.04
USD	18,529,000	General Electric Co FRN 21/1/2021 (Perpetual)	19,875,688	0.10
USD	10,094,000	General Electric Co FRN 15/11/2067	10,472,525	0.05
USD	1,974,000	General Electric Co 5.55% 4/5/2020	2,252,275	0.01
USD	12,916,000	General Motors Financial Co Inc 3.5% 10/7/2019	13,363,953	0.07
USD	17,935,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 10/5/2019 (Perpetual)	18,405,794	0.09
USD	18,811,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 10/5/2020 (Perpetual)	19,022,812	0.10
USD	2,978,000	Hughes Satellite Systems Corp 7.625% 15/6/2021	3,190,182	0.02
USD	7,245,000	Hyundai Capital America 2% 19/3/2018	7,285,438	0.04
USD	7,059,000	Intel Corp 3.25% 1/8/2039	12,317,955	0.06
USD	19,941,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/5/2023 (Perpetual)	20,165,336	0.10
USD	37,007,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/10/2024 (Perpetual)	39,643,749	0.20
USD	23,455,000	JPMorgan Chase & Co 2.295% 15/8/2021	23,604,045	0.12
USD	7,086,000	JPMorgan Chase & Co 4.35% 15/8/2021	7,818,604	0.04
USD	19,085,000	Medtronic Inc 3.15% 15/3/2022	20,340,564	0.10
USD	12,594,000	Morgan Stanley FRN 15/7/2019 (Perpetual)	12,704,198	0.06
USD	11,772,000	Mylan Inc 2.55% 28/3/2019	11,928,285	0.06
USD	7,700,000	NBCUniversal Enterprise Inc'144A' 5.25% 19/3/2021 (Perpetual)	8,162,000	0.04
USD	43,325,000	Oracle Corp 1.9% 15/9/2021	43,450,837	0.22
USD	20,018,000	QUALCOMM Inc 3% 20/5/2022	21,086,631	0.11

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産 比率 %
	米国(続き)		
USD 7,232,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15/4/2023	7,647,840	0.04
USD 4,476,000	Synchrony Financial 3.75% 15/8/2021	4,702,656	0.02
USD 11,129,000	T-Mobile USA Inc 6% 15/4/2024	11,935,852	0.06
USD 358,000,000	United States Treasury Bill 6/10/2016 (Zero Coupon)	357,912,827	1.80
USD 172,128,000	United States Treasury Bill 13/10/2016 (Zero Coupon)	172,079,116	0.87
USD 65,800,000	United States Treasury Bill 20/10/2016 (Zero Coupon)	65,778,154	0.33
USD 256,000,000	United States Treasury Bill 10/11/2016 (Zero Coupon)	255,865,216	1.29
USD 205,000,000	United States Treasury Bill 17/11/2016 (Zero Coupon)	204,889,915	1.03
USD 65,000,000	United States Treasury Bill 25/11/2016 (Zero Coupon)	64,953,005	0.33
USD 264,778,200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2021	272,313,601	1.37
USD 569,613,100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/1/2026 †	602,544,931	3.04
USD 26,316,600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1% 15/2/2046 †	29,695,210	0.15
USD 46,589,400	United States Treasury Note/Bond 1.125% 31/7/2021*	46,469,287	0.23
USD 1,078,086,600	United States Treasury Note/Bond 1.125% 31/8/2021	1,075,349,273	5.42
USD 216,727,600	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/3/2021*	217,591,125	1.10
USD 16,680,000	USB Capital IX FRN 3/10/2016 (Perpetual)	14,282,250	0.07
USD 3,656,000	Verizon Communications Inc 1.75% 15/8/2021	3,633,735	0.02
USD 8,048,000	Verizon Communications Inc 2.625% 15/8/2026	8,000,545	0.04
USD 7,091,000	Volkswagen Group of America Finance LLC 2.45% 20/11/2019	7,210,235	0.04
		4,098,022,198	20.65
債券合計		8,051,652,637	40.57
公認の証券取引所に上場されているまたは他の規制ある市場で取引され ている譲渡性のある有価証券及びマネー・マーケット商品合計		19,552,325,715	98.51

その他の譲渡性のある有価証券

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産比率 %
	普通/優先株式(証券)		
	ジャージー		
19,223,120	Delta Topco Ltd**	192	0.00

米国

4,214,805	Domo, Inc (Pref)**	35,404,362	0.18
2,487,644	Dropbox, Inc**	26,145,139	0.13
4,185,730	Grand Rounds, Inc (Pref)**	11,636,329	0.06
107,909	Lookout, Inc**	915,068	0.01
1,919,121	Lookout, Inc (Pref)**	16,274,146	0.08
4,980	NCB Warrant Holding**	-	0.00
3,269,720	Palantir Technologies, Inc (Pref)**	30,016,030	0.15
2,003,248	Uber Technologies Inc Npv (Pref)**	97,698,405	0.49
		218,089,479	1.10
普通/優先株式(証券)合計		218,089,671	1.10
債券			
バミューダ			
SGD	38,000,000	Celestial Nutrifooods Ltd (Restricted) (Defaulted) 12/6/2011 (Zero Coupon)**	278,689 0.00
ケイマン諸島			
USD	15,900,000	China Milk Products Group Ltd (Restricted) (Defaulted) 5/1/2012 (Zero Coupon)**	159,000 0.00
中国			
CNY	103,700,000	FU JI Food and Catering Services Holdings Ltd (Defaulted) 18/10/2010 (Zero Coupon)**	- 0.00
スペイン			
EUR	8,500,000	Telefonica S.A. 6% 24/7/2017**	8,916,585 0.05
米国			
USD	19,506,123	Delta Topco Ltd 10% 24/11/2060**	18,725,878 0.09
債券合計		28,080,152	0.14
その他の譲渡性のある有価証券合計		246,169,823	1.24
ポートフォリオ合計		19,798,495,538	99.75
その他の純資産		48,166,083	0.25
純資産合計(米ドル)		19,846,661,621	100.00

~ 当該投資は関連当事者のファンドへの投資です。

* 当該有価証券は貸付有価証券です。

† 当該有価証券は、担保として差し入れられたものまたは保証が付与されたものです。

** 当該有価証券は公正価値修正の対象です。

'A'、'B'、'C'：議決権や転売権等に特定の規定が設けられた株式です。

(Wts) ワラントです。

(Pref) 優先株式(優先証券)です。

(Defaulted) デフォルト銘柄です。

(Restricted) 取引等の制限がかかっている銘柄です。

(FRN) 変動利付債です。

(Step-up coupon) ステップアップ債(利率が段階的に上昇する債券)です。

(Perpetual) 永久債です。なお、記号の直前にある日付は発行体が債券を償還する可能性のある日を表します。

'144A'：米国の適格機関投資家向け私募証券市場において発行された証券です。

はアセットマネジメントOneにて追記しました。

(4) To Be Announced証券取引明細表

2016年8月31日現在

数量	銘柄	時価(米ドル)	純資産 比率 %
TBA			
	米国		
USD 303,474,000	Fannie Mae Pool '3 9/16' 3% TBA	314,854,275	1.59
TBA合計		314,854,275	1.59

To Be Announced(「TBA」)取引は、主にパススルー機関の発行体の設立国によって分類されています。

(5) 外国為替予約取引明細表

2016年8月31日現在

通貨	買建金額	通貨	売建金額	契約相手	満期日	未実現利益/(損 失)(米ドル)
EUR	36,231,000	USD	40,615,313	JP Morgan	1/9/2016	(241,514)
GBP	35,980,000	USD	46,959,117	HSBC Bank Plc	1/9/2016	167,487
USD	41,042,114	EUR	36,231,000	JP Morgan	1/9/2016	668,315
USD	51,597,011	GBP	35,980,000	HSBC Bank Plc	1/9/2016	4,470,407
CAD	65,726,000	USD	51,214,400	JP Morgan	2/9/2016	(1,103,561)
GBP	36,012,000	USD	47,504,510	Goldman Sachs	2/9/2016	(335,992)
USD	51,879,247	GBP	36,012,000	Goldman Sachs	2/9/2016	4,710,730
USD	225,813,900	JPY	24,450,000,000	Goldman Sachs	6/9/2016	(10,828,607)
EUR	25,001,000	USD	27,508,625	Morgan Stanley	8/9/2016	358,650
JPY	5,091,497,100	USD	50,550,000	Morgan Stanley	8/9/2016	(1,266,606)
USD	50,400,882	JPY	5,091,497,100	Morgan Stanley	8/9/2016	1,117,488
BRL	108,749,414	USD	33,792,000	Deutsche Bank	9/9/2016	(203,504)
EUR	28,566,000	USD	31,451,166	Deutsche Bank	9/9/2016	391,264
GBP	35,979,000	USD	47,020,236	BNP Paribas	9/9/2016	113,664
USD	34,138,884	BRL	108,749,414	Deutsche Bank	9/9/2016	550,388
USD	51,797,275	GBP	35,979,000	BNP Paribas	9/9/2016	4,663,376
				Brown Brothers		
AUD	19,594,000	USD	14,719,130	Harriman & Co	12/9/2016	(6,016)
				Brown Brothers		
USD	14,281,675	AUD	19,594,000	Harriman & Co	12/9/2016	(431,439)
USD	16,157,755	CHF	15,734,000	JP Morgan	12/9/2016	134,738
USD	101,327,434	JPY	11,450,000,000	Credit Suisse	12/9/2016	(9,524,438)
GBP	35,953,000	USD	47,303,437	JP Morgan	15/9/2016	(196,229)
JPY	5,096,509,000	USD	50,660,871	Goldman Sachs	15/9/2016	(1,312,575)
USD	50,819,566	GBP	35,953,000	JP Morgan	15/9/2016	3,712,357
USD	50,472,978	JPY	5,096,509,000	Goldman Sachs	15/9/2016	1,124,682
GBP	16,575,444	USD	21,869,144	Morgan Stanley	16/9/2016	(150,698)
USD	50,749,717	GBP	34,549,000	Morgan Stanley	16/9/2016	5,480,911
EUR	44,664,000	USD	50,456,028	HSBC Bank Plc	23/9/2016	(637,677)
GBP	20,718,000	USD	27,336,427	Credit Suisse	23/9/2016	(185,126)
USD	28,333,626	GBP	20,718,000	Credit Suisse	23/9/2016	1,182,324
USD	20,093,000	MXN	366,369,734	Goldman Sachs	29/9/2016	688,043

GBP	20,684,000	USD	27,281,369	HSBC Bank Plc	30/9/2016	(169,678)
USD	19,689,579	AUD	26,726,000	Deutsche Bank	30/9/2016	(369,426)
USD	28,208,632	GBP	20,684,000	HSBC Bank Plc	30/9/2016	1,096,941
USD	28,365,624	GBP	20,684,000	Credit Suisse	30/9/2016	1,253,933
USD	228,798,612	JPY	23,480,000,000	Deutsche Bank	3/10/2016	1,254,601
USD	44,079,532	JPY	4,660,000,000	JP Morgan	11/10/2016	(1,095,004)
USD	66,176,888	JPY	6,990,000,000	Morgan Stanley	24/10/2016	(1,620,522)
USD	47,906,777	MXN	885,437,000	Goldman Sachs	27/10/2016	1,140,061
USD	223,734,010	JPY	23,350,000,000	Morgan Stanley	31/10/2016	(2,806,406)
CNH	367,728,000	USD	55,983,558	Deutsche Bank	4/11/2016	(1,199,488)

通貨	買建金額	通貨	売建金額	契約相手	満期日	未実現利益 / (損失) (米ドル)
USD	56,590,080	CNH	367,728,000	Deutsche Bank	4/11/2016	1,806,010
USD	51,895,536	NZD	76,688,000	Morgan Stanley	8/11/2016	(3,551,023)
USD	52,458,992	AUD	70,729,000	Goldman Sachs	9/11/2016	(575,204)
NOK	170,715,479	USD	20,099,000	Morgan Stanley	10/11/2016	402,471
USD	52,297,117	AUD	71,787,000	Deutsche Bank	10/11/2016	(1,529,120)
USD	51,807,653	NZD	77,661,000	JP Morgan	10/11/2016	(4,338,421)
EUR	17,979,000	PLN	77,286,327	BNP Paribas	17/11/2016	331,442
USD	232,655,795	JPY	23,270,000,000	Deutsche Bank	21/11/2016	6,694,128
EUR	33,639,000	USD	38,201,794	Credit Suisse	25/11/2016	(579,493)
BRL	78,731,000	USD	22,097,449	Deutsche Bank	2/12/2016	1,605,976
USD	21,107,507	BRL	78,731,000	Deutsche Bank	2/12/2016	(2,595,918)
TWD	1,489,132,850	USD	45,607,573	Citibank	9/1/2017	1,541,699
TWD	1,482,002,119	USD	45,417,696	JP Morgan	9/1/2017	1,505,800
USD	44,465,000	TWD	1,489,132,850	Citibank	9/1/2017	(2,684,271)
USD	44,451,000	TWD	1,482,002,119	JP Morgan	9/1/2017	(2,472,496)
USD	21,449,000	AED	79,417,067	BNP Paribas	19/1/2017	(159,052)
USD	21,438,000	AED	79,438,509	Goldman Sachs	19/1/2017	(175,886)
USD	21,197,000	AED	78,496,730	BNP Paribas	25/1/2017	(160,163)
EUR	18,763,000	JPY	2,333,976,477	HSBC Bank Plc	13/2/2017	(1,692,664)
JPY	2,432,566,661	EUR	18,763,000	HSBC Bank Plc	13/2/2017	2,654,009
USD	910,041	JPY	98,590,184	HSBC Bank Plc	13/2/2017	(51,304)
未実現純損失						(3,427,626)

通貨	買建金額	通貨	売建金額	契約相手	満期日	未実現利益 / (損失) (米ドル)
AUD Hedged Share Class						
AUD	197,764,107	USD	150,856,218	BNY Mellon	14/9/2016	(2,363,928)
USD	3,671,989	AUD	4,808,231	BNY Mellon	14/9/2016	61,703
未実現純損失						(2,302,225)
CHF Hedged Share Class						
CHF	53,229,516	USD	54,307,088	BNY Mellon	14/9/2016	(92,771)
USD	1,190,890	CHF	1,153,002	BNY Mellon	14/9/2016	16,545
未実現純損失						(76,226)
CNH Hedged Share Class						
CNY	12,653,064	USD	1,895,435	BNY Mellon	14/9/2016	(6,023)

USD	308,199	CNY	2,050,432	BNY Mellon	14/9/2016	2,020
未実現純損失						(4,003)
EUR Hedged Share Class						
EUR	2,442,239,564	USD	2,710,620,169	BNY Mellon	14/9/2016	12,345,468
USD	39,342,334	EUR	35,055,181	BNY Mellon	14/9/2016	257,459
未実現純利益						12,602,927
GBP Hedged Share Class						
GBP	115,133,836	USD	150,526,252	BNY Mellon	14/9/2016	323,129
USD	3,510,879	GBP	2,692,088	BNY Mellon	14/9/2016	(16,316)
未実現純利益						306,813
HKD Hedged Share Class						
HKD	127,839,218	USD	16,488,608	BNY Mellon	14/9/2016	(5,628)
USD	985,873	HKD	7,643,105	BNY Mellon	14/9/2016	407
未実現純損失						(5,221)
JPY Hedged Share Class						
JPY	234,479,278	USD	2,317,779	BNY Mellon	14/9/2016	(47,452)
USD	6,596	JPY	672,427	BNY Mellon	14/9/2016	85
未実現純損失						(47,367)
PLN Hedged Share Class						
PLN	48,633,374	USD	12,564,933	BNY Mellon	14/9/2016	(109,631)
USD	358,518	PLN	1,377,583	BNY Mellon	14/9/2016	5,711
未実現純損失						(103,920)
SGD Hedged Share Class						
SGD	312,734,038	USD	232,039,960	BNY Mellon	14/9/2016	(2,689,145)
USD	3,356,835	SGD	4,544,479	BNY Mellon	14/9/2016	24,035
未実現純損失						(2,665,110)
未実現純利益合計						
(米ドル原資産エクスポージャー - 6,560,763,112米ドル)						4,278,042

(6) 先物取引明細表

2016年8月31日現在

契約数量	通貨	銘柄	満期日	原資産エクスポージャー(米ドル)	未実現利益/損失(米ドル)
(37)	CAD	S&P/TSX 60 Index	September 2016	4,818,192	(250,162)
(1,691)	EUR	STOXX Europe 600 Index	September 2016	32,486,294	(2,311,289)
(2,551)	EUR	EURO STOXX 50 Index	September 2016	86,503,108	(4,594,735)
(53)	GBP	FTSE 100 Index	September 2016	4,728,155	(180,173)
515	JPY	TOPIX Index	September 2016	66,206,446	799,411
(256)	JPY	Nikkei 225 (Yen)	September 2016	20,926,647	(254,620)
(125)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	September 2016	11,935,000	45,129
(336)	USD	Russell 2000 Mini Index	September 2016	41,768,160	(1,497,380)
(3,881)	USD	S&P 500 E Mini Index	September 2016	421,331,063	(178,567)
合計				690,703,065	(8,422,386)

(7) 金利スワップ明細表

2016年8月31日現在

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益 / (損失) (米 ドル)	時価 (米ドル)
EUR	31,347,000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.016%	Goldman Sachs	9/4/2021	(270,905)	(270,905)
GBP	118,887,210	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.537%	UBS	2/7/2020	(276,667)	(276,667)
GBP	117,000,000	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.563%	UBS	2/7/2020	(351,701)	(351,701)
GBP	117,000,000	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.568%	UBS	2/7/2020	(366,975)	(366,975)
GBP	117,000,000	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.584%	UBS	2/7/2020	(415,853)	(415,853)
USD	151,853,232	Fund receives Fixed 0.972%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	5/7/2020	(713,500)	(713,500)
USD	153,000,000	Fund receives Fixed 0.998%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	5/7/2020	(641,870)	(641,870)
USD	153,000,000	Fund receives Fixed 1.0005%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	5/7/2020	(634,465)	(634,465)
USD	153,000,000	Fund receives Fixed 1.042%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	5/7/2020	(511,532)	(511,532)
GBP	116,793,000	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.604%	UBS	16/7/2020	(468,264)	(468,264)
	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益 / (損失) (米 ドル)	時価 (米ドル)
GBP	116,792,900	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.608%	UBS	16/7/2020	(480,465)	(480,465)
GBP	116,793,000	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.6375%	UBS	16/7/2020	(570,451)	(570,451)
GBP	116,792,800	Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month; and pays Fixed 0.64%	UBS	16/7/2020	(578,076)	(578,076)

USD	151,831,000	Fund receives Fixed 1.167%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	19/7/2020	(149,603)	(149,603)
USD	151,831,000	Fund receives Fixed 1.1915%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	19/7/2020	(76,773)	(76,773)
USD	151,830,800	Fund receives Fixed 1.203%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	19/7/2020	(42,587)	(42,587)
USD	175,188,900	Fund receives Fixed 1.244%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month	UBS	19/7/2020	91,492	91,492
USD	234,642,882	Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month; and pays Fixed 1.4175%	UBS	28/6/2022	(216,453)	(216,453)
USD	117,321,441	Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month; and pays Fixed 1.4225%	UBS	28/6/2022	(124,906)	(124,906)
合計(米ドル原資産エクスポージャー - 2,856,186,035米ドル)					(6,799,554)	(6,799,554)

(8) クレジット・デフォルト・スワップ明細表
2016年8月31日現在

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益/ (損失)(米 ドル)	時価 (米ドル)
USD	(92,521,000)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.26.V1 and receives Fixed 1%	Barclays	20/6/2021	391,181	1,197,885
USD	(86,027,217)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.26.V1 and receives Fixed 1%	Barclays	20/6/2021	488,485	1,113,809
USD	(200,000,337)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.26.V1 and receives Fixed 1%	Barclays	20/6/2021	99,295	2,589,438
USD	(38,622,486)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.26.V1 and receives Fixed 1%	Barclays	20/6/2021	72,654	500,052
EUR	(34,905,287)	Fund provides default protection on ITRAXX.EUR.25.V1 and receives Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2021	71,349	602,186
EUR	(46,085,000)	Fund provides default protection on ITRAXX.EUR.25.V1 and receives Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2021	77,168	795,058

EUR	(24,037,000)	Fund provides default protection on ITRAXX.X0.25.V1 and receives Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2021	(194,345)	2,226,330
EUR	(17,285,482)	Fund provides default protection on ITRAXX.X0.25.V1 and receives Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2021	(187,005)	1,600,998
EUR	(23,918,000)	Fund provides default protection on ITRAXX.X0.25.V1 and receives Fixed 5%	Citigroup	20/6/2021	(218,300)	2,215,308
USD	(116,670,865)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.26.V1 and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2021	(264,550)	5,340,837

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益/ (損失)(米 ドル)	時価 (米ドル)
USD	(2,502,668)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.26.V1 and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2021	31,365	114,564
USD	(12,066,503)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.26.V1 and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2021	153,637	552,368
USD	(110,740,205)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.26.V1 and receives Fixed 1%	Credit Suisse	20/6/2021	(146,840)	1,433,772
EUR	(24,000,000)	Fund provides default protection on ITRAXX.X0.25.V1 and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2021	1,046,380	2,222,903
EUR	(11,839,619)	Fund provides default protection on ITRAXX.X0.25.V1 and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2021	(133,870)	1,096,597
EUR	(21,036,000)	Fund provides default protection on ITRAXX.X0.25.V1 and receives Fixed 5%	HSBC Bank Plc	20/6/2021	27,623	1,948,375
EUR	(21,035,531)	Fund provides default protection on ITRAXX.X0.25.V1 and receives Fixed 5%	HSBC Bank Plc	20/6/2021	30,485	1,948,331

USD	(16,261,255)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.26.V1 and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2021	85,900	744,391
USD	(69,259,046)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.26.V1 and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2021	1,851,953	3,170,468
合計(米ドル原資産エクスポージャー - 1,030,067,395米ドル)					3,282,565	31,413,670

(9) トータル・リターン・スワップ明細表

2016年8月31日現在

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益/ (損失)(米 ドル)	時価 (米ドル)
JPY	2,680,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 16; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	31/3/2017	942,616	1,107,373
JPY	2,680,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 16; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	31/3/2017	1,022,951	1,237,043
EUR	92,200	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	15/12/2017	(153,991)	(171,878)
EUR	92,700	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	15/12/2017	(73,917)	(61,980)
JPY	3,600,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 17; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	2/4/2018	876,260	(186,375)
JPY	3,600,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 17; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	2/4/2018	1,026,428	(73,505)
USD	292,250	Fund receives S&P 500 Annual Dividend Index; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	21/12/2018	438,375	438,375
EUR	50,600	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	21/12/2018	(197,121)	(265,013)
EUR	46,400	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	21/12/2018	(165,363)	(186,140)
EUR	92,700	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	21/12/2018	(506,542)	(524,246)
JPY	1,800,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 18; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	29/3/2019	233,400	(327,463)

JPY	3,540,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 18; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	29/3/2019	264,108	(298,026)
JPY	1,800,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 18; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	29/3/2019	118,021	(183,762)
額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益 / (損失) (米ドル)	時価 (米ドル)	
EUR	31,100	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	20/12/2019	70,117	41,587
EUR	59,900	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	20/12/2019	(20,582)	-
EUR	65,800	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	20/12/2019	89,460	43,994
JPY	1,800,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 19; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	31/3/2020	209,874	(269,983)
JPY	2,990,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 19; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	31/3/2020	265,510	(170,708)
JPY	2,400,000	Fund receives NIKKEI Dividend December 19; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	31/3/2020	328,770	(346,042)
EUR	34,500	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	18/12/2020	11,258	19,222
EUR	18,400	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	18/12/2020	(14,339)	8,202
EUR	16,100	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	18/12/2020	(8,114)	10,765
EUR	18,500	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	18/12/2020	(4,568)	(4,123)
EUR	13,800	Fund receives EURO STOXX 50 Dividend; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	18/12/2020	(10,977)	12,302
USD	144,750	Fund receives S&P 500 Annual Dividend Index; and pays Fixed 0%	BNP Paribas	17/12/2021	390,825	390,825
USD	116,500	Fund receives S&P 500 Annual Dividend Index; and pays Fixed 0%	Goldman Sachs	17/12/2020	259,213	259,213
合計（米ドル原資産エクスポージャー - 188,332,149米ドル）					5,391,672	499,657

(10) 通貨スワップ明細表

2016年8月31日現在

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現損失 (米ドル)	時価 (米ドル)
JPY	(4,626,000,000)	Fund pays JPY 0.1% Fixed; and receives USD 1.23% Fixed	Bank of America	15/3/2017	(6,540,558)	(6,540,558)
JPY	(4,870,300,000)	Fund pays JPY 0.1% Fixed; and receives USD 1.8375% Fixed	Bank of America	15/3/2018	(4,012,528)	(4,012,529)
JPY	(7,238,150,000)	Fund pays JPY 0.1% Fixed; and receives USD 1.963% Fixed	Bank of America	15/3/2018	(6,310,367)	(6,310,367)
合計(米ドル原資産エクスポージャー - 16,321,688米ドル)					(16,863,453)	(16,863,454)

(11) 売建コールオプション明細表

2016年8月31日現在

コールに係る 契約数量	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/(損 失)(米ドル)	時価(米ド ル)
(71,787,000)	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.79	10/11/2016	233,339	(162,080)
(117,340,241)	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 115	15/11/2016	378,305	(146,206)
(70,729,000)	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.8	9/11/2016	366,415	(87,443)
(118,115,401)	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 117	4/10/2016	484,037	(33,308)
(77,661,000)	OTC NZD/USD	JP Morgan	NZD 0.725	10/11/2016	(517,162)	(1,106,452)
(76,688,000)	OTC NZD/USD	Morgan Stanley	NZD 0.73	8/11/2016	(288,406)	(893,755)
(599,038)	Johnson & Johnson	Barclays	USD 110	20/1/2017	(3,935,206)	(6,541,021)
(8,819)	Safety FirstTrust					
(79,410)	Series2009-2 S&P 500 Index	Citibank Credit Suisse	EUR 125	16/9/2016	21,809	(12)
(35,763)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	USD 2,240	16/9/2016	561,403	(56,963)
(1,769,017)	General Electric	Deutsche Bank	USD 125	18/11/2016	(105,422)	(349,683)
(738,189)	QUALCOMM Inc	Deutsche Bank	USD 32.5	20/1/2017	935,871	(965,822)
(127,409)	Unilever NV	Deutsche Bank	USD 70	19/5/2017	(831,849)	(1,385,490)
(593,125)	SPDR Gold Trust	Goldman Sachs	EUR 43	16/9/2016	150,033	(5,631)
(607,700)	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 137	16/9/2016	672,713	(9,381)
(293,636)	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 140	16/9/2016	1,090,100	(3,760)
(593,125)	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 150	21/10/2016	182,761	(13,917)
(593,125)	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 145	16/12/2016	575,456	(296,438)

(7,849)	SX5E Index Link Morgan Stanley	EUR 3,450	17/3/2017	(52,671)	(254,288)
(592,507)	SPDR Gold Trust Societe Generale	USD 145	20/1/2017	(51,725)	(496,105)
(2,083,304)	General Electric UBS	USD 31	16/9/2016	822,218	(969,423)

コールに係る 契約数量	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益 / (損 失) (米ドル)	時価 (米ド ル)
(690,538)	Apple Inc	UBS	USD 130	15/9/2017	719,112	(1,668,134)
(2,315)	Altria Group Inc	Exchange Traded	USD 67.5	16/9/2016	319,574	(23,150)
(2,315)	Altria Group Inc	Exchange Traded	USD 67.5	16/12/2016	252,924	(297,477)
(69)	Biogen Inc	Exchange Traded	USD 325	21/10/2016	(28,802)	(64,515)
(2,663)	Mondelez International Inc	Exchange Traded	USD 43	16/9/2016	181,962	(564,556)
(6,066)	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 145	30/9/2016	1,061,281	(24,264)
(5,827)	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 145	18/11/2016	237,495	(168,983)
(1,359)	Tiffany & Co	Exchange Traded	USD 75	17/2/2017	111,531	(468,855)
(1,359)	Tiffany & Co	Exchange Traded	USD 72.5	17/2/2017	(128,418)	(608,153)
(1,884)	Williams-Sonoma Inc	Exchange Traded	USD 55	18/11/2016	158,813	(447,450)
合計 (米ドル原資産エクスポージャー - 283,292,068米ドル)					3,577,491	(18,112,715)

(12) 売建プットオプション明細表

2016年8月31日現在

プットに係る 契約数量	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益 / (損 失) (米ドル)	時価 (米ド ル)
(71,787,000)	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.67	10/11/2016	541,689	(46,155)
(117,340,241)	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 98	15/11/2016	13,025	(904,576)
(118,840,000)	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 100.5	8/9/2016	974,250	(78,315)
(70,729,000)	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.685	9/11/2016	583,345	(82,024)
(118,115,401)	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 100	4/10/2016	432,421	(682,589)
(77,661,000)	OTC NZD/USD	JP Morgan	NZD 0.615	10/11/2016	564,627	(24,663)
(76,688,000)	OTC NZD/USD	Morgan Stanley	NZD 0.62	8/11/2016	399,683	(26,022)
(80,228)	S&P 500 Index	BNP Paribas	USD 1,950	30/11/2016	200,499	(1,226,757)

(15,387)	SX5E	IndexCitibank					
	Link		EUR 2,350	16/6/2017	787,570	(1,048,434)	
(160,414)	S&P 500 Index	Credit					
		Suisse	USD 1,955	18/11/2016	388,273	(2,039,031)	
(738,189)	QUALCOMM Inc	Deutsche					
		Bank	USD 40	19/5/2017	2,042,208	(393,815)	
(6,554)	SX5E	IndexDeutsche	EUR				
	Link	Bank	2,586.07	21/9/2018	644,396	(1,744,970)	
(51,881)	S&P 500 Index	Morgan					
		Stanley	USD 2,000	16/9/2016	294,117	(43,110)	
(208,000)	Prudential	Morgan					
	Financial Inc	Stanley	USD 77.5	20/1/2017	399,139	(855,110)	
(4,112)	SX5E	IndexMorgan					
	Link	Stanley	EUR 2,375	17/3/2017	359,784	(163,676)	
(4,117)	SX5E	IndexMorgan					
	Link	Stanley	EUR 2,375	17/3/2017	407,321	(141,198)	
(7,849)	SX5E	IndexMorgan					
	Link	Stanley	EUR 2,400	17/3/2017	135,761	(333,217)	
(80,228)	S&P 500 Index	Societe					
		Generale	USD 1,965	30/11/2016	147,104	(1,337,114)	
(169,700)	Metlife Inc	UBS	USD 46	20/1/2017	(113,257)	(683,428)	
(186,339)	Metlife Inc	UBS	USD 45	20/1/2017	15,512	(641,110)	
(690,538)	Apple Inc	UBS	USD 100	15/9/2017	(871,544)	(5,781,583)	
(69)	Biogen Inc	Exchange					
		Traded	USD 260	21/10/2016	37,391	(17,940)	
合計(米ドル原資産エクスポージャー - 226,407,135米ドル)					8,383,314	(18,294,837)	

(13) 買建プットオプション明細表

2016年8月31日現在

プットに係る 契約数量	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/(損 失)(米ドル)	時価(米ド ル)
689,372	CBOE Volatility					
	Index	Barclays	USD 15	21/9/2016	(247,034)	852,514
1,150,507	CBOE Volatility					
	Index	Barclays	USD 16	19/10/2016	(462,326)	1,643,102
80,228	S&P 500 Index	BNP				
		Paribas	USD 2,125	30/11/2016	(415,718)	3,491,385
230,305	CBOE Volatility					
	Index	Citibank	USD 15	21/9/2016	(98,190)	284,808
79,410	S&P 500 Index	Credit				
		Suisse	USD 2,130	16/9/2016	(1,544,601)	559,764
160,414	S&P 500 Index	Credit				
		Suisse	USD 2,130	18/11/2016	(712,361)	6,321,071
1,932,445	Gentex Corp	Morgan				
		Stanley	USD 12.5	16/9/2016	(2,314,304)	1,543
51,881	S&P 500 Index	Morgan				
		Stanley	USD 2,125	16/9/2016	(921,612)	331,314
230,218	CBOE Volatility	Societe				
	Index	Generale	USD 16	21/9/2016	109,422	443,238
80,228	S&P 500 Index	Societe				
		Generale	USD 2,140	30/11/2016	(211,914)	3,843,852

合計(米ドル原資産エクスポージャー - 357,578,498米ドル)

(6,818,638) 17,772,591

(14) 買建コールオプション明細表

2016年8月31日現在

コールに係る 契約数量	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/(損 失)(米ドル)	時価(米ド ル)
117,340,241	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 108.5	15/11/2016	(1,473,324)	756,141
118,840,000	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 110.5	8/9/2016	(2,119,749)	17,113
118,115,401	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 110	4/10/2016	(2,009,497)	218,159
411,802	Apple Inc	Citibank	USD 100	16/9/2016	(684,141)	2,692,636
230,305	CBOE Volatility Index	Citibank	USD 22	19/10/2016	(91,322)	206,554
15,387	SX5E Index Link	Citibank	EUR 3,150	16/6/2017	(1,218,764)	2,069,352
94,574	STOXX Europe 600 Index	Credit Suisse	EUR 345	16/9/2016	(598,846)	427,916
121,552	STOXX Europe 600 Index	Credit Suisse	EUR 355.6145	17/3/2017	(1,886,250)	1,552,674
738,189	QUALCOMM Inc	Deutsche Bank	USD 52.5	19/5/2017	5,555,610	8,785,556
6,554	SX5E Index Link	Deutsche Bank	EUR 3,426.55	21/9/2018	(1,543,056)	846,310
613,267	Aflac Inc	Goldman Sachs	USD 85	19/1/2018	(540,103)	764,070
390,520	Allstate Corp/The	Goldman Sachs	USD 80	19/1/2018	(605,723)	451,220
852,698	BB&T Corp	Goldman Sachs	USD 40	19/1/2018	167,796	1,907,300
872,875	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs	USD 80	19/1/2018	1,042,035	3,815,858
1,196,200	Charles Schwab Corp/The	Goldman Sachs	USD 40	19/1/2018	381,255	1,265,605
524,564	CIT Group Inc	Goldman Sachs	USD 42	19/1/2018	495,404	1,437,101
1,196,200	Citigroup	Goldman Sachs	USD 55	19/1/2018	640,523	3,475,876
419,751	CME Group Inc/IL	Goldman Sachs	USD 115	19/1/2018	1,179,547	2,567,831
733,547	Comerica Inc	Goldman Sachs	USD 55	19/1/2018	639,937	2,061,405
1,086,389	E*TRADE Financial Corp	Goldman Sachs	USD 35	19/1/2018	300,481	1,519,084
1,196,200	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs	USD 25	19/1/2018	222,492	814,372
1,079,976	Franklin Resources Inc	Goldman Sachs	USD 45	19/1/2018	591,689	1,790,678
1,196,200	JP Morgan	Goldman Sachs	USD 70	19/1/2018	1,800,252	6,316,744

コールに係る 契約数量	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/(損 失)(米ドル)	時価(米ド ル)
1,196,200	KeyCorp	Goldman Sachs	USD 15	19/1/2018	47,965	563,527
726,581	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	USD 55	19/1/2018	1,127,771	2,463,081
1,196,200	Manulife Financial Corp	Goldman Sachs	CAD 22	19/1/2018	(304,883)	316,524
1,196,200	Metlife Inc	Goldman Sachs	USD 52.5	19/1/2018	211,627	1,756,879
1,196,200	Morgan Stanley	Goldman Sachs	USD 35	19/1/2018	1,933,154	3,150,527
1,196,200	Regions Financial Corp	Goldman Sachs	USD 12	19/1/2018	9,785	358,238
809,316	State Street Corp	Goldman Sachs	USD 72.5	19/1/2018	3,904,077	5,456,184
1,196,200	SunTrust Bank Inc	Goldman Sachs	USD 55	19/1/2018	(525,672)	1,010,728
1,196,200	Synchrony Financial	Goldman Sachs	USD 35	19/1/2018	(276,849)	1,238,138
1,019,566	TD Ameritrade Holding Corp	Goldman Sachs	USD 40	19/1/2018	626,172	1,614,947
369,950	Travelers Cos Inc/The	Goldman Sachs	USD 135	19/1/2018	(490,906)	928,592
1,196,200	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs	USD 55	19/1/2018	297,037	2,997,219
980,759	Zions Bancorporation	Goldman Sachs	USD 35	19/1/2018	523,495	1,448,351
607,700	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 120	16/9/2016	(404,400)	3,132,414
593,125	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 125	16/9/2016	(1,560,676)	862,239
415,188	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 100	16/9/2016	1,267,706	10,356,171
293,636	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 127	21/10/2016	(559,762)	599,572
593,125	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 125	16/12/2016	(645,917)	2,580,683
320,288	SPDR Gold Trust	JP Morgan	USD 100	16/12/2016	851,350	8,045,018
416,000	Prudential Financial Inc	Morgan Stanley	USD 87.5	20/1/2017	(2,874,673)	595,461
7,849	SX5E Index Link	Morgan Stanley	EUR 3,125	17/3/2017	161,850	1,108,572
4,117	SX5E Index Link	Morgan Stanley	EUR 3,025	17/3/2017	(125,832)	814,912
4,112	SX5E Index Link	Morgan Stanley	EUR 3,025	17/3/2017	(176,106)	813,922
230,218	CBOE Volatility Index	Societe Generale	USD 22	16/11/2016	(161,649)	356,342
コールに係る 契約数量	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/(損 失)(米ドル)	時価(米ド ル)
592,507	SPDR Gold Trust	Societe Generale	USD 121	20/1/2017	1,778,076	4,275,789

372,678	Metlife Inc	UBS	USD 50	20/1/2017	(1,666,196)	132,700
339,400	Metlife Inc	UBS	USD 52.5	20/1/2017	(1,356,768)	50,174
690,538	Apple Inc	UBS	USD 110	15/9/2017	(1,598,517)	5,586,817
69	Biogen Inc	Exchange				
		Traded	USD 285	21/10/2016	73,184	205,965
6,066	SPDR Gold	Exchange				
	Shares	Traded	USD 125	30/9/2016	(2,068,751)	1,376,982
5,827	SPDR Gold	Exchange				
	Shares	Traded	USD 130	18/11/2016	(1,120,187)	1,124,611
合計(米ドル原資産エクスポージャー - 959,096,869米ドル)					(2,858,249)	111,080,834

(15) 買建スワップション明細表

2016年8月31日現在

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現損失 (米ドル)	時価 (米ドル)
USD	467,155,000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.14% Fixed semi-annually from 17/5/2017; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/2/2017	Deutsche Bank	15/11/2016	(1,355,217)	2,148,446
JPY	3,384,694,000	Fund purchases a put option (expiring 4/4/2018) to enter into an Interest Rate Swap (Deutsche Bank). If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 6/10/2018; and pays 1.07% Fixed semi-annually from 6/10/2018	Deutsche Bank	4/4/2018	(683,241)	30,591
GBP	235,700,000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 15/3/2017; and pays 1.62% Fixed semi-annually from 15/3/2017	Goldman Sachs	15/9/2016	(1,470,631)	-

GBP	235,700,000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating GBP LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 15/3/2017; and pays 1.22% Fixed semi-annually from 15/3/2017	Goldman Sachs	15/9/2016	(5,581,616)	99
-----	-------------	--	---------------	-----------	-------------	----

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現損失 (米ドル)	時価 (米ドル)
USD	234,840,000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/12/2016; and pays 1.475% Fixed semi-annually from 20/3/2017	Goldman Sachs	16/9/2016	(2,791,778)	895,210
USD	234,840,000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/12/2016; and pays 1.875% Fixed semi-annually from 20/3/2017	Goldman Sachs	16/9/2016	(867,583)	1,325
合計(米ドル原資産エクスポージャー - 588,548,559米ドル)					(12,750,066)	3,075,671

(16) 売建スワップション明細表

2016年8月31日現在

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益 (米ドル)	時価 (米ドル)
USD	(467,155,000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/2/2017; and pays 0.94% Fixed semi-annually from 17/5/2017	Deutsche Bank	15/11/2016	1,039,420	(759,127)

USD	(467,155,000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.44% Fixed semi-annually from 17/5/2017; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/2/2017	Deutsche Bank	15/11/2016	566,659	(1,150,136)
GBP	(471,400,000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.42% Fixed semi-annually from 15/3/2017; and pays Floating GBP LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 15/3/2017	Goldman Sachs	15/9/2016	5,849,096	(6)
USD	(469,680,000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.675% Fixed semi-annually from 20/3/2017; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/12/2016	Goldman Sachs	16/9/2016	3,508,838	(131,182)
USD	(233,477,800)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.25% Fixed semi-annually from 20/4/2017; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/1/2017	Goldman Sachs	18/10/2016	173,474	(953,056)
合計(米ドル原資産エクスポージャー - 963,999,008米ドル)					11,137,487	(2,993,507)

金融デリバティブ商品の概要	時価 米ドル
スワップ	
クレジット・デフォルト・スワップ	31,413,670
通貨スワップ	(16,863,454)
金利スワップ	(6,799,554)
トータル・リターン・スワップ	499,657
スワップの時価	8,250,319
買建オプション/スワップション	
買建コールオプション	111,080,834
買建プットオプション	17,772,591
買建スワップション	3,075,671

買建オプション/スワップシヨンの時価	131,929,096
売建オプション/スワップシヨンの時価	
売建コールオプション	(18,112,715)
売建プットオプション	(18,294,837)
売建スワップシヨンの時価	(2,993,507)
売建オプション/スワップシヨンの時価	(39,401,059)
To Be Announced証券時価	314,854,275
	未実現利益/(損失)
	米ドル
先物取引	(8,422,386)
外国為替予約	4,278,042

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

グローバルドライブ（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジ

（平成29年 2月28日現在）

資産総額	819,488,046円
負債総額	365,898円
純資産総額（ - ）	819,122,148円
発行済口数	858,669,775口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9539円
（1万口当たり純資産額）	（9,539円）

グローバルドライブ（3ヵ月決算型）為替ヘッジなし

（平成29年 2月28日現在）

資産総額	10,948,328,744円
負債総額	18,136,841円
純資産総額（ - ）	10,930,191,903円
発行済口数	11,105,098,672口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9842円
（1万口当たり純資産額）	（9,842円）

（参考）グローバルドライブ・マザーファンド

（平成29年 2月28日現在）

資産総額	16,145,723,714円
負債総額	17,000,635円
純資産総額（ - ）	16,128,723,079円
発行済口数	13,227,608,979口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2193円
（1万口当たり純資産額）	（12,193円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣

の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a．資本金の額（平成29年 2月28日現在）

資本金の額	20億円	
会社が発行する株式総数	100,000株	（普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株）
発行済株式総数	40,000株	（普通株式24,490株、A種種類株式 15,510株）

種類株式の発行が可能

直近5カ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

b．会社の機構（平成29年 2月28日現在）

（イ）会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。

取締役会の議長は、原則として取締役社長があたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

（ロ）投資運用の意思決定機構

1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基

づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

「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、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

平成29年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,159,521,637,173
追加型株式投資信託	864	11,794,936,154,039
単位型公社債投資信託	56	310,769,912,650
単位型株式投資信託	107	760,943,242,478
合計	1,065	14,026,170,946,340

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第31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、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第32期中間会計期間（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、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更いたしました。

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	12,051,921	12,951,736
金銭の信託	14,169,657	13,094,914
前払費用	57,309	44,951
未収委託者報酬	4,622,292	4,460,404
未収運用受託報酬	1,737,052	1,859,778
未収投資助言報酬	2 312,206	2 277,603
未収収益	260,845	205,097
繰延税金資産	411,797	341,078
その他	46,782	40,689
流動資産計	33,669,865	33,276,255
固定資産		
有形固定資産	432,933	658,607
建物	1 138,967	1 29,219
車両運搬具	1 941	1 549
器具備品	1 243,908	1 184,683
建設仮勘定	49,116	444,155
無形固定資産	1,912,472	1,706,201
商標権	1 101	1 7
ソフトウェア	1 1,702,633	1 1,645,861
ソフトウェア仮勘定	202,399	53,036
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 188	1 146
投資その他の資産	4,343,365	6,497,772
投資有価証券	613,137	458,701
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
繰延税金資産	582,861	679,092
差入保証金	733,907	2,040,945
その他	96,862	89,835
固定資産計	6,688,771	8,862,580
資産合計	40,358,637	42,138,836

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		

預り金		1,605,579	966,681
未払金		2,515,377	2,055,332
未払償還金		49,873	49,873
未払手数料		1,836,651	1,744,274
その他未払金		628,852	261,185
未払費用	2	2,196,267	2
未払法人税等		1,539,263	1,223,957
未払消費税等		671,243	352,820
賞与引当金		722,343	728,769
その他		30,000	-
	流動負債計	9,280,074	8,404,128
固定負債			
退職給付引当金		868,928	997,396
役員退職慰労引当金		110,465	154,535
	固定負債計	979,394	1,151,932
負債合計		10,259,468	9,556,060
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		2,000,000	2,000,000
資本剰余金		2,428,478	2,428,478
資本準備金		2,428,478	2,428,478
利益剰余金		25,417,784	28,000,340
利益準備金		123,293	123,293
その他利益剰余金			
別途積立金		19,480,000	22,030,000
研究開発積立金		300,000	300,000
運用責任準備積立金		200,000	200,000
繰越利益剰余金		5,314,491	5,347,047
	株主資本計	29,846,262	32,428,818
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		252,905	153,956
	評価・換算差額等計	252,905	153,956
純資産合計		30,099,168	32,582,775
負債・純資産合計		40,358,637	42,138,836

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	28,170,831	30,188,445

運用受託報酬	7,064,021		7,595,678	
投資助言報酬	1,032,659		993,027	
その他営業収益	828,240		724,211	
営業収益計		37,095,752		39,501,363
営業費用				
支払手数料	12,416,659		12,946,176	
広告宣伝費	527,620		468,931	
公告費	288		258	
調査費	6,317,052		7,616,390	
調査費	4,129,778		4,969,812	
委託調査費	2,187,273		2,646,578	
委託計算費	385,121		412,257	
営業雑経費	488,963		548,183	
通信費	34,089		34,855	
印刷費	414,215		436,756	
協会費	24,177		23,698	
諸会費	37		40	
支払販売手数料	16,443		52,833	
営業費用計		20,135,705		21,992,198
一般管理費				
給料	5,260,910		5,382,757	
役員報酬	242,666		242,446	
給料・手当	4,378,307		4,431,015	
賞与	639,936		709,295	
交際費	37,625		43,975	
寄付金	2,697		2,628	
旅費交通費	242,164		254,276	
租税公課	127,947		180,892	
不動産賃借料	686,770		1,128,367	
退職給付費用	218,863		226,460	
固定資産減価償却費	628,056		902,248	
福利厚生費	33,310		36,173	
修繕費	13,807		31,617	
賞与引当金繰入額	722,343		728,769	
役員退職慰労引当金繰入額	50,327		49,320	
役員退職慰労金	25,501		5,250	
機器リース料	87		140	
事務委託費	231,303		251,913	
事務用消耗品費	67,208		70,839	
器具備品費	5,869		14,182	
諸経費	135,032		214,532	
一般管理費計		8,489,827		9,524,346
営業利益		8,470,220		7,984,819

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
	営業外収益			
受取配当金	17,346		25,274	
受取利息	2,404		2,079	
時効成立分配金・償還金	974		-	
為替差益	652		3,996	
雑収入	1,822		6,693	
営業外収益計		23,200		38,044
営業外費用				

金銭の信託運用損		163,033		305,368	
時効成立後支払分配金・償還金		65		-	
外国税支払損失		47,515		-	
営業外費用計			210,614		305,368
経常利益			8,282,806		7,717,494
特別利益					
投資有価証券売却益		-		3,377	
特別利益計			-		3,377
特別損失					
固定資産除却損	1	12,988		624	
固定資産売却損	2	-		2,653	
ゴルフ会員権売却損		1,080		-	
ゴルフ会員権評価損		-		6,307	
関係会社株式評価損		202,477		-	
特別損失計			216,547		9,584
税引前当期純利益			8,066,259		7,711,286
法人税、住民税及び事業税			2,969,684		2,557,305
法人税等調整額			29,428		27,424
法人税等合計			2,940,256		2,584,730
当期純利益			5,126,003		5,126,556

(3) 【株主資本等変動計算書】

第30期（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
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開 発積立 金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変更による累積的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の積立				2,350,000			2,350,000	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003

株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変更による 累積的影響額		131,037
会計方針の変更を反映 した当期首残高	243,159	27,291,419
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

第31期（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								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開 発積立 金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
会計方針の変更による 累積的影響額									
会計方針の変更を反映 した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
当期純利益							5,126,556	5,126,556	5,126,556
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)									

当期変動額合計	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556	2,582,556	2,582,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	252,905	30,099,168
会計方針の変更による累積的影響額		
会計方針の変更を反映した当期首残高	252,905	30,099,168
当期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の積立		-
当期純利益		5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	98,949	98,949
当期変動額合計	98,949	2,483,607
当期末残高	153,956	32,582,775

重要な会計方針

項目	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。</p> <p>数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理</p> <p>過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
<p>「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)</p> <p>(1) 概要 本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。</p> <p>(2) 適用予定日 平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。</p> <p>(3) 当該会計基準等の適用による影響 当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。</p>

会計上の見積りの変更

第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社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資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 8 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
建物	582,075	767,802
車両運搬具	3,981	4,374
器具備品	735,461	562,853
商標権	836	930
ソフトウェア	2,015,473	2,613,791
電信電話専用施設利用権	1,408	1,451

2. 関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

（千円）

		第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	311,994	276,211
流動負債	未払費用	492,035	622,004

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	0	182
ソフトウェア	12,988	442

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	-	2,653

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000

合計	24,000	-	-	24,000
----	--------	---	---	--------

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成28年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(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

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブ取引は、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であります。

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替及び市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

第30期(平成27年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

第31期(平成28年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	26,427,656	26,427,656	-
(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払法人税等

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）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
非上場株式	80,246	77,696
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
差入保証金	733,907	2,040,945

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

前事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィス等の不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期（平成27年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

第31期（平成28年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
(1) 預金	12,951,736	-	-	-
合計	12,951,736	-	-	-

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円、第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他(投資信託)	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額80,246千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第31期(平成28年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	365,683	146,101	219,581
債券	-	-	-
その他(投資信託)	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額77,696千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
該当事項はありません。

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他有価証券	5,927	3,377	-

7. 減損処理を行った有価証券
 該当事項はありません。

(金銭の信託関係)

1. 運用目的の金銭の信託

第30期 (平成27年3月31日現在)

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額(千円)	当事業年度の損益に含まれた 評価差額(千円)
運用目的の金銭の信託	14,169,657	2,544,066

第31期 (平成28年3月31日現在)

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額(千円)	当事業年度の損益に含まれた 評価差額(千円)
運用目的の金銭の信託	13,094,914	825,986

2. 満期保有目的の金銭の信託
 該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
 該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度(非積立型制度であります)を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)	
	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035

会計方針の変更による累積的影響額	203,600	-
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	89,550	79,449
未認識過去勤務費用	14,556	9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
割引率	0.89%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期事業年度43,461千円、第31期事業年度44,193千円であります。

(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

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
--	------------------------	------------------------

繰延税金資産	(千円)	(千円)
未払事業税	118,238	79,702
未払事業所税	5,527	5,581
賞与引当金	239,095	224,898
未払法定福利費	30,557	28,395
未払確定拠出年金掛金	2,650	2,500
外国税支払損失	15,727	-
資産除去債務	-	13,244
減価償却超過額(一括償却資産)	2,158	3,389
減価償却超過額	130,844	136,503
繰延資産償却超過額(税法上)	2,710	1,339
退職給付引当金	281,232	305,591
役員退職慰労引当金	35,724	47,318
ゴルフ会員権評価損	1,940	3,768
関係会社株式評価損	176,106	166,740
その他有価証券評価差額金	-	1,196
繰延税金資産合計	1,042,515	1,020,171
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	47,855	-
繰延税金負債合計	47,855	-
差引繰延税金資産の純額	994,659	1,020,171

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差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の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

「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)が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。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する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上

に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額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。

有形固定資産

当社は、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

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	30,188,445	8,588,706	724,211	39,501,363

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額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。

有形固定資産

当社は、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

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その他 の関係 会社	第一生命 保険株式 会社	東京 都千 代田 区	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の 助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投 資助言 報酬	237,575

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その他 の関係 会社	第一生命 保険株式 会社	東京 都千 代田 区	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の 助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	795,405	未収投 資助言 報酬	207,235

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預り 資産の運 用	当社預り資産 の運用の顧問 料の支払	658,756	未払 費用	235,583
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預り 資産の運 用	当社預り資産 の運用の顧問 料の支払	383,980	未払 費用	173,074

DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-
-------------------------	-------------------	-------------	-------	--------------	-------	-----------	-------	---------	---	---

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000千GBP	資産の運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	800,617	未払費用	308,974
								増資の引受	912,600	-	-
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	473,948	未払費用	157,130

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
そ の	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売	2,217,439	未払手数料	306,365
								代行手数料			
								預金の預入(純額)	551,351	現金・預金	11,276,198
							受取利息	2,139	未収収益	71	

他の関係会社の子会社	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	兼務1名	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払 業務委託料の支払	407,531 8,540	未払費用 未払金	240,725 6,501
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の追加(純額) 信託報酬の支払	3,500,000 8,254	金銭の信託	14,169,657

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)		
						役員 の兼 任等	事業上 の関係						
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	兼務1名	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売	3,023,040	未払手数料	372,837		
								代行手数料		879,733		現金・預金	12,155,931
								預金の預入(純額)		1,787		未収収益	
							受取利息						
その他の関係会社の子会社	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	兼務1名	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払 業務委託料の支払	557,013 8,540	未払費用 未払金	292,861 7,581		

社	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京 都 中央 区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信 託財産 の運用	信託元本の払 戻 (純額)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の支 払	8,336		

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (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	1,254,132円02銭	1,357,615円66銭
1株当たり当期純利益金額	213,583円46銭	213,606円51銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(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

(単位：千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
(資産の部)	
流動資産	
現金・預金	11,605,537
金銭の信託	11,792,364
前払費用	122,161
未収委託者報酬	4,755,701
未収運用受託報酬	2,465,934

未収投資助言報酬		261,221
未収収益		181,959
繰延税金資産		329,236
その他		122,804
	流動資産計	31,636,922
固定資産		
有形固定資産		1,541,889
建物	1	6,517
器具備品	1	152,176
建設仮勘定		1,383,196
無形固定資産		1,613,174
ソフトウェア		1,421,245
ソフトウェア仮勘定		184,656
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権		124
投資その他の資産		6,281,765
投資有価証券		441,519
関係会社株式		3,229,196
繰延税金資産		713,716
差入保証金		1,808,323
その他		89,010
	固定資産計	9,436,830
	資産合計	41,073,753

(単位：千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,080,224
未払金	2,651,649
未払償還金	49,873
未払手数料	1,865,871
その他未払金	735,905
未払費用	2,673,720
未払法人税等	907,554
未払消費税等	69,484
賞与引当金	724,711
訴訟損失引当金	30,000
その他	21,000

	流動負債計	8,158,344
固定負債		
退職給付引当金		1,027,049
	固定負債計	1,027,049
負債合計		9,185,394
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		2,428,478
資本準備金		2,428,478
利益剰余金		27,317,845
利益準備金		123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		24,580,000
研究開発積立金		300,000
運用責任準備積立金		200,000
繰越利益剰余金		2,114,551
	株主資本計	31,746,323
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		142,035
	評価・換算差額等計	142,035
純資産合計		31,888,358
負債・純資産合計		41,073,753

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第32期中間会計期間	
	(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	14,454,974	
運用受託報酬	3,732,759	
投資助言報酬	456,986	
その他営業収益	323,793	
	営業収益計	18,968,513
営業費用		
支払手数料	6,111,449	
広告宣伝費	108,789	
公告費	428	
調査費	3,764,163	
調査費	2,639,714	
委託調査費	1,124,449	
委託計算費	216,712	
営業雑経費	278,529	
通信費	17,844	
印刷費	212,004	
協会費	11,277	
諸会費	18	
支払販売手数料	37,384	

		営業費用計	
一般管理費			
給料		2,330,263	
役員報酬		124,419	
給料・手当		2,205,843	
交際費		16,973	
寄付金		13,268	
旅費交通費		100,973	
租税公課		148,041	
不動産賃借料		1,329,821	
退職給付費用		121,590	
固定資産減価償却費	1	353,322	
福利厚生費		11,020	
修繕費		10,082	
賞与引当金繰入額		724,711	
役員退職慰労金		63,072	
機器リース料		146	
事務委託費		182,857	
事務用消耗品費		37,442	
器具備品費		236,524	
諸経費		58,359	
	一般管理費計		5,738,473
営業利益			2,749,968

(単位：千円)

		第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日)	
営業外収益			
受取配当金		7,882	
受取利息		341	
為替差益		32,301	
雑収入		4,836	
	営業外収益計		45,361
営業外費用			
金銭の信託運用損		59,768	
	営業外費用計		59,768
経常利益			2,735,561
特別損失			
固定資産除却損		2,820	
固定資産売却損		1,780	
訴訟損失引当金繰入額		30,000	
	特別損失計		34,601
税引前中間純利益			2,700,960
法人税、住民税及び事業税			856,976
法人税等調整額			17,520
法人税等合計			839,455
中間純利益			1,861,504

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間(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
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							1,861,504	1,861,504	1,861,504
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額 (純額)									
当中間期変動額合 計	-	-	-	2,550,000	-	-	3,232,495	682,495	682,495
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	24,580,000	300,000	200,000	2,114,551	27,317,845	31,746,323

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	153,956	32,582,775
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の積立		-
中間純利益		1,861,504
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額 (純額)	11,921	11,921
当中間期変動額合 計	11,921	694,416
当中間期末残高	142,035	31,888,358

重要な会計方針

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

第32期中間会計期間
(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。
 なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。

追加情報

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1. 「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。 2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第32期中間会計期間末 (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	建物 ... 790,504千円 器具備品 ... 596,199千円

(中間損益計算書関係)

項目	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1. 減価償却実施額	有形固定資産 ... 57,752千円 無形固定資産 ... 295,570千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(金融商品関係)

第32期中間会計期間末(平成28年9月30日現在)

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。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,605,537	11,605,537	-
(2) 金銭の信託	11,792,364	11,792,364	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	363,823	363,823	-
資産計	23,761,725	23,761,725	-
(1) 未払法人税等	907,554	907,554	-
負債計	907,554	907,554	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払法人税等

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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	77,696
関係会社株式	3,229,196
差入保証金	1,808,323

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額3,229,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
3. その他有価証券			
区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	349,644	146,101	203,542
債券	-	-	-
その他(投資信託)	14,179	13,000	1,179
小計	363,823	159,101	204,721
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	363,823	159,101	204,721

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額77,696千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（金銭の信託関係）

第32期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在）
1．満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。
2．その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外） 該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）

第32期中間会計期間（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、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	14,454,974	4,189,745	323,793	18,968,513

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額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。

有形固定資産

当社は、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

顧客の名称又は氏名	営業収益 （千円）
第一生命グループ	1,928,739

（注）第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （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	1,328,681円	62銭
1株当たり中間純利益金額	77,562円	67銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）
中間純利益	1,861,504千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,861,504千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1．結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2．企業結合日

平成28年10月1日

3．企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5．交付した株式数

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

6．企業結合の主な目的

当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、みずほフィナンシャルグループと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

7．取得企業を決定するに至った主な根拠

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるみずほフィナンシャルグループが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

8．実施予定の会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3．企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

（参考）みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該（参考）において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並

びに同規則第2条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

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

2 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53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、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間(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、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	江見 睦生 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子 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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づ

き、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。
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)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.XRBLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	湯原	尚 印
業務執行社員			
指定有限責任社員	公認会計士	山野	浩 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、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、みずほ投信投資顧問株式会社の平成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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。

(1)貸借対照表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
固定資産		
有形固定資産		
建物(純額)	124,850	100,000
工具、器具及び備品(純額)	71,443	90,655
リース資産(純額)	2,140	818
有形固定資産合計	198,434	191,474
無形固定資産		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
投資その他の資産		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
負債の部		
流動負債		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
未払金		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033

未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
固定負債		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600
資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	4,716,474	4,716,474
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	17,872,927	19,042,177
自己株式	-	377,863
株主資本合計	24,635,002	25,426,389
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	726,935	137,791
純資産合計	25,361,937	25,564,180
負債純資産合計	29,973,099	29,654,112

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405

営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767
営業外費用合計	85,321	9,688
経常利益	1,975,847	2,600,528
特別利益		
投資有価証券売却益	10,500	-
特別利益合計	10,500	-
特別損失		
減損損失	1	51,292
事業再構築費用	2	125,173
外国税負担損失	3	53,547
貸倒引当金繰入		19,534
特別損失合計		249,548
税引前当期純利益	1,736,799	2,600,528
法人税、住民税及び事業税	616,760	839,827
法人税等調整額	16,247	40,166
法人税等合計	633,008	879,993
当期純利益	1,103,790	1,720,534

(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			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本						
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		その他利益剰余金					
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	6,988,395	17,121,579	23,883,654
当期変動額							
剰余金の配当					352,443	352,443	352,443
当期純利益					1,103,790	1,103,790	1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計					751,347	751,347	751,347
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	24,635,002

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41,248	41,248	23,842,406
当期変動額			
剰余金の配当			352,443
当期純利益			1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	768,183	768,183	768,183
当期変動額合計	768,183	768,183	1,519,530
当期末残高	726,935	726,935	25,361,937

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	
	資本剰余金	

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

	株主資本							自己株式	株主資本合計
	利益剰余金						利益剰余金合計		
	利益準備金	その他利益剰余金			繰越利益剰余金				
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金						
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	-	24,635,002	
当期変動額									
剰余金の配当					551,284	551,284		551,284	
当期純利益					1,720,534	1,720,534		1,720,534	
自己株式の取得							377,863	377,863	
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計					1,169,250	1,169,250	377,863	791,386	
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177	377,863	25,426,389	

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	726,935	726,935	25,361,937
当期変動額			
剰余金の配当			551,284
当期純利益			1,720,534
自己株式の取得			377,863
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	589,143	589,143	589,143
当期変動額合計	589,143	589,143	202,242
当期末残高	137,791	137,791	25,564,180

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）
を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日において発生していると認められる額を計上しております。

(4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

「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）

1. 概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

2. 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

当社は、「追加情報」に記載のとおり、当社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会

社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社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認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ27,598千円減少しております。

追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社(代表取締役社長 西 恵正)、みずほ信託銀行株式会社(取締役社長 中野 武夫)、みずほ投信投資顧問株式会社(取締役社長 中村 英剛)及び新光投信株式会社(取締役社長 後藤 修一)間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne株式会社
2. 代表者 : 西 恵正(現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長)
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1-8-2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額		1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物	111,156千円	建物	136,006千円
工具、器具及び備品	277,249千円	工具、器具及び備品	226,657千円
リース資産	16,185千円	リース資産	17,508千円

(損益計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額(千円)
本社(東京都港区)	除却対象資産	建物	23,139
本社(東京都港区)	除却対象資産	工具器具備品	4,253
本社(東京都港区)	除却対象資産	原状回復費用	23,900

レイアウト変更により現行オフィス内部造作等の除却が決定した資産につき、「除却対象資産」としてグルーピングを行い、平成27年3月31日時点の帳簿価額および原状回復費用を減損損失(51,292千円)として特別損失に計上しました。

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当するものではありません。

(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)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

2 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成26年6月11日 第51回定時株主総会	普通株式	352,443,450	335	平成26年3月31日	平成26年6月12日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	利益剰余金	524	平成27年3月31日	平成27年6月12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. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	-	13,662	-	13,662

(変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成27年6月11日 第52回定時株主総会	普通株式	551,284,680	524	平成27年3月31日	平成27年6月12日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引(借主側)

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

(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

当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、1年以

内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としています。

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っています。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,801,864	20,801,864	-
(2) 未収委託者報酬	1,827,951	1,827,951	-
(3) 未収運用受託報酬	1,812,198	1,812,198	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	4,054,289	4,054,289	-
資産計	28,496,304	28,496,304	-
(1) 未払手数料	819,341	819,341	-
負債計	819,341	819,341	-
デリバティブ取引(1)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(3,601)	(3,601)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	327	327	-
デリバティブ取引計	(3,274)	(3,274)	-

(1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	20,903,257	20,903,257	-
(2) 未収委託者報酬	2,183,032	2,183,032	-
(3) 未収運用受託報酬	1,713,643	1,713,643	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,282,026	3,282,026	-
資産計	28,081,960	28,081,960	-
(1) 未払手数料	838,064	838,064	-
負債計	838,064	838,064	-
デリバティブ取引(1)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(220)	(220)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1,564)	(1,564)	-
デリバティブ取引計	(1,784)	(1,784)	-

(1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負債

(1) 未払手数料

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	60,720	60,720

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,800,853	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,827,951	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,812,198	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	127,840	-	-	-	-	3,300,657
合計	24,568,844	-	-	-	-	3,300,657

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,902,546	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	2,183,032	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,713,643	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

(有価証券関係)

1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	3,740,183	2,664,442	1,075,740
小計	3,740,183	2,664,442	1,075,740
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	314,105	316,720	2,615
小計	314,105	316,720	2,615
合計	4,054,289	2,981,163	1,073,125

当事業年度(平成28年3月31日)

種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託	2,698,875	2,500,000	198,875
小計	2,698,875	2,500,000	198,875
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託	583,151	583,423	271
小計	583,151	583,423	271
合計	3,282,026	3,083,423	198,603

2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものはありません。

3 当事業年度中に解約・償還したその他有価証券
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	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	102,729	953	2,197
合計	102,729	953	2,197

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	解約・償還額(千円)	解約・償還益の合計額 (千円)	解約・償還損の合計額 (千円)
証券投資信託	738,178	106,977	2,920
合計	738,178	106,977	2,920

(デリバティブ取引関係)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連
前事業年度(平成27年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	197,054	-	3,601	3,601
	合計	197,054	-	3,601	3,601

当事業年度(平成28年3月31日)

区分	取引の種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	148,005	-	220	220
	合計	148,005	-	220	220

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
株式関連
前事業年度(平成27年3月31日)

ヘッジ会計 の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に 係る損益を認 識する方法	株価指数先物取引 売建	投資有価証券	131,145	-	3,325
	買建	投資有価証券	277,953	-	3,652
	合計		409,098	-	327

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	株価指数先物取引				
	売建	投資有価証券	117,467	-	147
	買建	投資有価証券	179,836	-	1,711
合計			297,303	-	1,564

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	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)
退職給付引当金の期首残高	357,258千円	331,766千円
退職給付費用	150,018	51,208
退職給付の支払額	21,349	-
制度への拠出額	103,177	66,102
退職給付引当金の期末残高	331,766	346,659

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	669,318千円	727,842千円
年金資産	1,001,084	1,074,502
貸借対照表に計上された前払年金費用	331,766	346,659

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度58,362千円 当事業年度51,208千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

(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)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円
ソフトウェア償却超過額	69,263	52,651
賞与引当金損金算入限度超過額	108,734	98,134
社会保険料損金不算入額	15,665	14,233
役員退職慰労引当金	34,461	45,488
未払事業税	30,421	39,817

その他	93,137	58,782
繰延税金資産小計	356,479	313,659
評価性引当額	24,103	22,331
繰延税金資産合計	332,375	291,328
繰延税金負債		
前払年金費用	107,027	106,147
その他有価証券評価差額金	346,190	60,812
繰延税金負債合計	453,218	166,959
繰延税金資産の純額	120,843	124,368

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差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3 法人税等の税率の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

「所得税法等の一部を改正する法律」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）及び当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

〔関連情報〕

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益（千円）	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	2,629,803	資産運用業

当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益(千円)	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	3,061,207	資産運用業

[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]

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社は、資産運用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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当するものはありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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	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)
同一の親会社をもつ会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田区	14,040 億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,833,692	未払手数料	361,219
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託 銀行株式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託 銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	13,851,610	未収委託者報酬	1,661,682

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	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)
同一の親会社をもつ会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田区	14,040 億円	銀行業	なし	投資信託の販売	支払手数料	3,542,264	未払手数料	336,556
同一の親会社をもつ会社	みずほ信託 銀行株式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託 銀行業	なし	信託財産の管理	委託者報酬	14,108,529	未収委託者報酬	2,053,638

(注) 1. 上記の金額のうち、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

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(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	24,106.70円	24,618.62円
1株当たり当期純利益金額	1,049.16円	1,639.16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、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
普通株式に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,103,790	1,720,534
期中平均株式数(株)	1,052,070	1,049,643

(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

(単位： 千円)

	第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		4,120,018
未収委託者報酬		2,064,997
未収運用受託報酬		1,959,028
繰延税金資産		140,728
その他		398,383
貸倒引当金		1,207
流動資産合計		8,681,950
固定資産		
有形固定資産		
工具、器具及び備品(純額)		62,971
有形固定資産合計	1	62,971
無形固定資産		12,767
投資その他の資産		
投資有価証券		815,525
繰延税金資産		73,719
その他		638,830
貸倒引当金		19,404
投資その他の資産合計		1,508,671
固定資産合計		1,584,410
資産合計		10,266,360
負債の部		
流動負債		
未払金		793,859
未払費用		1,675,771
未払法人税等		253,697
賞与引当金		319,200
その他		221,869
流動負債合計		3,264,398
固定負債		
役員退職慰労引当金		57,860
時効後支払損引当金		7,256

固定負債合計	65,116
負債合計	3,329,515
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,045,600
資本剰余金	
資本準備金	2,266,400
その他資本剰余金	1,103,259
資本剰余金合計	3,369,659
利益剰余金	
利益準備金	128,584
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	1,777,567
利益剰余金合計	1,906,152
自己株式	377,863
株主資本合計	6,943,548
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	6,703
評価・換算差額等合計	6,703
純資産合計	6,936,845
負債純資産合計	10,266,360

(2) 中間損益計算書

(単位： 千円)

	第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		7,935,613
運用受託報酬		2,105,866
営業収益合計		10,041,479
営業費用及び一般管理費	1	9,415,997
営業利益		625,482
営業外収益		
受取配当金		19,694
受取利息		439
有価証券解約益		76,483
有価証券償還益		3,474
時効到来償還金等		727
雑収入		17,708
営業外収益合計		118,528
営業外費用		
有価証券解約損		96
有価証券償還損		12
雑損失		6,303
営業外費用合計		6,412
経常利益		737,598
特別利益		700
特別損失		11,641
税引前中間純利益		726,657
法人税、住民税及び事業税		236,054
法人税等調整額		26,308
法人税等合計		209,746
中間純利益		516,910

(3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(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			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当中間期変動額				
積立金取崩				
剰余金の配当			1,346,815	1,346,815
中間純利益				
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				
当中間期変動額合計			1,346,815	1,346,815
当中間期末残高	2,045,600	2,266,400	1,103,259	3,369,659

	株主資本					
	利益剰余金					
	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計
配当準備 積立金		退職慰労積 立金	別途 積立金	繰越利益剰余 金		
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	8,908,993	19,042,177
当中間期変動額						
積立金取崩		104,600	100,000	9,800,000	10,004,600	-
剰余金の配当					17,652,936	17,652,936
中間純利益					516,910	516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計		104,600	100,000	9,800,000	7,131,425	17,136,025
当中間期末残高	128,584	-	-	-	1,777,567	1,906,152

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	自己株式	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	377,863	25,426,389	137,791	137,791	25,564,180
当中間期変動額					
積立金取崩		-			-
剰余金の配当		18,999,751			18,999,751
中間純利益		516,910			516,910
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			144,494	144,494	144,494
当中間期変動額合計		18,482,840	144,494	144,494	18,627,334
当中間期末残高	377,863	6,943,548	6,703	6,703	6,936,845

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却方法

- (1) 有形固定資産
定率法を採用しております。
- (2) 無形固定資産
定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

- (1) 貸倒引当金
当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
- (2) 賞与引当金
従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。
- (3) 退職給付引当金（前払年金費用）
従業員に対する退職給付に備えるため、中間決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、中間決算日において発生していると認められる額を計上しております。
- (4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）
役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。
- (5) 時効後支払損引当金
時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項
消費税等の会計処理
消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（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）

	第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	476,786千円

（中間損益計算書関係）

	第54期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1 減価償却実施額	有形固定資産 114,327千円
	無形固定資産 15千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,052,070	-	-	1,052,070

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	13,662	-	-	13,662

3 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発効日
平成28年6月10日 第53回定時株主総会	普通株式	17,652,936,000	利益剰余金	17,000	平成28年3月31日	平成28年6月13日
		1,346,815,176	資本剰余金	1,297	平成28年3月31日	平成28年6月13日
	合計	18,999,751,176		18,297		

(金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。(注2)を参照ください。)

(単位：千円)

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	4,120,018	4,120,018	-
(2) 未収委託者報酬	2,064,997	2,064,997	-
(3) 未収運用受託報酬	1,959,028	1,959,028	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	754,805	754,805	-
資産計	8,898,851	8,898,851	-
(1) 未払手数料	785,089	785,089	-
負債計	785,089	785,089	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負 債

(1) 未払手数料

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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	60,720

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

1 その他有価証券

種類	中間貸借対照表計上額 (千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
証券投資信託	151,830	150,000	1,830
小計	151,830	150,000	1,830
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
証券投資信託	602,975	614,467	11,491
小計	602,975	614,467	11,491
合計	754,805	764,467	9,661

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

顧客の種類等	営業収益(千円)	関連するセグメント名
適格機関投資家 A	1,177,474	資産運用業

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	6,680.26円

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第54期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1株当たり中間純利益金額	497.79円
(算定上の基礎)	

中間純利益金額(千円)	516,910
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	516,910
普通株式の期中平均株式数(株)	1,038,408

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(重要な後発事象)

当社(以下「MHAM」という)は、平成28年7月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日

平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

(参考) 新光投信株式会社の経理状況

1. 財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社(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。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条および第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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56期事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 伊藤 志保

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 福村 寛

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」に掲げられている新光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56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、新光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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の統合基本合意書に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる主要事項を内定している。

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

- () 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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	湯原	尚 印
業務執行社員			
指定有限責任社員	公認会計士	山野	浩 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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光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57期事業年度の間会計期間(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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にD I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

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

（注2）X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160

有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
流動資産合計	20,404,659	21,767,367
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 12,687	2 0
構築物（純額）	2 1,444	2 0
器具・備品（純額）	2 86,688	2 44,868
有形固定資産合計	100,820	44,868
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
無形固定資産合計	86,278	57,152
投資その他の資産		
投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
未払金		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372

その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
固定負債		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
純資産の部		
株主資本		
資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744
評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

(2) 損益計算書

(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)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	35,876,795	39,283,623

運用受託報酬		238,412		232,145
営業収益合計		36,115,207		39,515,769
営業費用				
支払手数料	1	18,252,669	1	19,472,734
広告宣伝費		456,430		507,020
公告費		548		469
調査費				
調査費		623,792		841,825
委託調査費		5,966,340		7,419,125
図書費		5,254		4,879
調査費合計		6,595,388		8,265,830
委託計算費		1,352,318		1,711,366
営業雑経費				
通信費		32,335		30,454
印刷費		103,093		1,022
協会費		18,150		19,367
諸会費		3,300		3,117
その他		41,594		44,518
営業雑経費合計		198,475		98,480
営業費用合計		26,855,830		30,055,901
一般管理費				
給料				
役員報酬		96,445		91,205
給料・手当		1,368,552		1,480,875
賞与		336,076		428,776
給料合計		1,801,073		2,000,857
交際費		11,426		10,708
寄付金		3,198		2,346
旅費交通費		100,386		109,240
租税公課		68,508		90,795
不動産賃借料		206,753		205,671
賞与引当金繰入		451,000		547,750
役員賞与引当金繰入		66,000		22,000
役員退職慰労引当金繰入		24,930		22,210
退職給付費用		191,900		169,238
減価償却費		70,676		102,532
諸経費		573,824		647,510
一般管理費合計		3,569,678		3,930,859
営業利益		5,689,698		5,529,008

(単位：千円)

前事業年度	当事業年度
(自 平成26年4月 1日	(自 平成27年4月 1日
至 平成27年3月31日)	至 平成28年3月31日)

営業外収益		
受取配当金	163,006	65,772
有価証券利息	3,853	3,333
受取利息	10,741	10,751
時効成立分配金・償還金	5,080	923
受取保険金	-	10,300
雑益	487	2,845
営業外収益合計	183,170	93,926
営業外費用		
支払利息	26	3
時効成立後支払分配金・償還金	3,083	5,532
雑損	3,261	556
営業外費用合計	6,371	6,092
経常利益	5,866,496	5,616,842
特別利益		
投資有価証券売却益	68,179	225,965
外国税支払損失引当金戻入益	-	43,200
特別利益合計	68,179	269,166
特別損失		
固定資産除却損	3,177	13,017
投資有価証券売却損	54,613	60,150
投資有価証券評価損	10,952	62,800
外国税支払損失引当金繰入額	184,111	-
訴訟損失引当金繰入額	30,000	10,000
合併関連費用	2	2
その他特別損失	22,227	-
特別損失合計	305,082	310,625
税引前当期純利益	5,629,593	5,575,383
法人税、住民税及び事業税	2,111,379	1,832,729
法人税等調整額	66,999	19,773
法人税等合計	2,044,380	1,852,503
当期純利益	3,585,212	3,722,880

(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				
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	
				別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165

会計方針の変更による累積的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
利益剰余金合計					
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

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					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 別途積立金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益						
自己株式の消却			72,415	72,415		

利益剰余金から 資本剰余金への振替			72,415	72,415		
株主資本以外の項目の当期 変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-
当期末残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自 己 株 式	株 主 資 本 合 計	その他有価 証券評価差 額金	
	その他利益 剰余金	利 益 剰余金 合 計				
当期首残高	3,981,245	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	3,446,341	3,446,341		3,446,341		3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880
自己株式の消却			72,415	-		-
利益剰余金から資本剰 余金への振替	72,415	72,415		-		-
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)				-	187,941	187,941
当期変動額合計	204,122	204,122	72,415	276,538	187,941	88,597
当期末残高	4,185,368	13,445,861	-	20,731,861	94,744	20,826,605

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)

時価のないもの

総平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

(4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(5) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

(6) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(7) 執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 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

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（未適用の会計基準）

「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）

(1) 概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

(2) 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

(追加情報)

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 アセットマネジメントOne株式会社
2. 代表者 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 東京都千代田区丸の内1-8-2
4. 統合日 平成28年10月1日

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払手数料	777,631千円	570,839千円

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	573,602千円	657,201千円

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次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)
支払手数料	9,189,399千円	8,452,937千円

2. 特別損失における合併関連費用の内訳は次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)
固定資産・敷金の償却	-千円	140,257千円
その他	-千円	24,400千円
合計	-千円	164,657千円

（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）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	-	1,823,250

2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

3．配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25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．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	9,386	1,813,864

(変動事由の概要)

自己株式の消却

2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	9,386	-

(変動事由の概要)

自己株式の消却

3．配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

（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

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券

などにより、通常の取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行ってまいります。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

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。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注）2.参照）。

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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。

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(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。

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品 (単位: 千円)

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

当事業年度(平成28年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

(有価証券関係)

1. 関連会社株式

関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額

77,100千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載して
おりません。

2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
	合計	8,102,802	7,685,493	417,309

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて
困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成28年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
	合計	6,159,600	6,023,210	136,389

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて

て困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3．売却したその他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613

当事業年度（平成28年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について62,800千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

2．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(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)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,424,739	1,348,083
会計方針の変更による累積的影響額	71,902	-

会計方針の変更を反映した期首残高	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	31,927	53,747
退職給付の支払額	73,269	60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
年金資産の期首残高	1,157,054	1,329,170
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の発生額	108,961	128,633
事業主からの拠出額	78,464	77,164
退職給付の支払額	38,450	28,253
年金資産の期末残高	1,329,170	1,282,678

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成27年3月31日)	(平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,111,797	1,185,792
年金資産	1,329,170	1,282,678
	217,373	96,885
非積立型制度の退職給付債務	236,285	253,099
未積立退職給付債務	18,912	156,213
未認識数理計算上の差異	270,020	387,977
未認識過去勤務費用	10,703	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764
退職給付引当金	155,806	146,617
前払年金費用	396,211	378,381
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用(注1)	119,135	124,139
利息費用	9,476	6,074
期待運用収益	23,141	33,229

数理計算上の差異の費用処理額	85,138	64,424
過去勤務費用の費用処理額	16,055	10,703
確定給付制度に係る退職給付費用	174,553	150,705

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

(5)年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%
現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	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)
割引率	0.0720% ~ 1.625%	0.0120% ~ 0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

(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)	当事業年度 (平成28年3月31日)
--	-----------------------	-----------------------

繰延税金資産		
賞与引当金	170,920千円	182,614千円
減価償却超過額	896	25,871
退職給付引当金	70,882	71,201
役員退職慰労引当金	12,688	14,799
投資有価証券評価損	15,033	19,229
非上場株式評価損	25,733	24,425
未払事業税	90,342	57,445
外国税支払損失引当金	60,867	-
訴訟損失引当金	9,918	12,344
その他	87,621	120,305
繰延税金資産小計	544,905	528,236
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	544,905	528,236
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	134,624	56,708
前払年金費用	127,817	115,860
繰延税金負債合計	262,442	172,568
繰延税金資産の純額	282,463	355,668

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	372,215千円	326,063千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	-	29,604
固定負債 - 長期繰延税金負債	89,752	-

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差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の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

「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）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行わ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する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については30.62%となります。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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）

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（会社等の場合に限る）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	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	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	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

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	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	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	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接7.73	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,452,937	未払手数料	570,839

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をも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	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	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	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

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	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	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	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	16,314

同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	96,300	その他未払金	8,725
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,163	その他未払金	1,728

(注) 1. 上記(ア)～(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社(非上場)

(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	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45銭

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

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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)
当期純利益金額(千円)	3,585,212	3,722,880
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数(千株)	1,813	1,813

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金

7,314,360

有価証券	101,520
未収委託者報酬	3,004,856
未収運用受託報酬	74,687
繰延税金資産	281,201
その他	334,195
流動資産合計	11,110,820
固定資産	
有形固定資産	
器具・備品（純額）	31,241
建設仮勘定	3,819
有形固定資産合計	1 35,061
無形固定資産	
ソフトウェア	52,424
ソフトウェア仮勘定	20,936
その他	91
無形固定資産合計	73,452
投資その他の資産	
投資有価証券	2,589,863
長期繰延税金資産	22,056
前払年金費用	352,195
その他	29,332
投資その他の資産合計	2,993,448
固定資産合計	3,101,961
資産合計	14,212,782

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金

未払収益分配金	153
未払償還金	4,216
未払手数料	1,406,798
その他未払金	284,198
未払金合計	1,695,367

未払費用	801,111
未払法人税等	850,492
未払消費税等	2 113,638
賞与引当金	382,000
訴訟損失引当金	70,000
流動負債合計	3,912,609

固定負債

退職給付引当金	160,185
固定負債合計	160,185

負債合計	4,072,794
------	-----------

純資産の部

株主資本

資本金	4,524,300
資本剰余金	
資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700

利益剰余金	
-------	--

利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	2,473,372
利益剰余金合計	2,833,866
株主資本合計	10,119,866
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	20,122
評価・換算差額等合計	20,122
純資産合計	10,139,988
負債純資産合計	14,212,782

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	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)	
営業収益		
委託者報酬		19,468,460
運用受託報酬		95,090
営業収益合計		19,563,551
営業費用及び一般管理費	1	16,721,767
営業利益		2,841,783
営業外収益		
受取配当金		32,758
有価証券利息		522
受取利息		2,296
時効成立分配金・償還金		10
その他		531
営業外収益合計		36,119
営業外費用		
その他		34
営業外費用合計		34
経常利益		2,877,868
特別利益		
固定資産売却益		1,354
投資有価証券売却益		9,179
特別利益合計		10,533
特別損失		
固定資産売却損		3,996
投資有価証券評価損		58,055
固定資産除却損		50
訴訟損失引当金繰入額		30,000
合併関連費用		11,926
特別損失合計		104,028
税引前中間純利益		2,784,373
法人税、住民税及び事業税		795,495
法人税等調整額		85,212
法人税等合計		880,707
中間純利益		1,903,666

(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				
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	
				別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	4,185,368
当中間期変動額					
別途積立金取崩				8,900,000	8,900,000
剰余金の配当					12,515,661
中間純利益					1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	8,900,000	1,711,995
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	-	2,473,372

	株主資本		評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	利益剰余金合計			
当期首残高	13,445,861	20,731,861	94,744	20,826,605
当中間期変動額				
別途積立金取崩	-	-		-
剰余金の配当	12,515,661	12,515,661		12,515,661
中間純利益	1,903,666	1,903,666		1,903,666
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			74,622	74,622
当中間期変動額合計	10,611,995	10,611,995	74,622	10,686,617
当中間期末残高	2,833,866	10,119,866	20,122	10,139,988

[注記事項]

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法により償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により翌期から費用処理することとしております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

(中間貸借対照表関係)

1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	498,091千円

2. 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次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)
有形固定資産	9,695千円
無形固定資産	9,425千円

(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)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,813,864	-	-	1,813,864

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月15日 取締役会	普通株式	12,515,661	6,900	平成28年7月5日	平成28年7月27日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

(金融商品関係)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、含まれておりません(注)2.参照)。

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)

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	7,314,360	7,314,360	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	2,415,231	2,415,231	-
(3) 未収委託者報酬	3,004,856	3,004,856	-
(4) 未払手数料	1,406,798	1,406,798	-

(注)1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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。

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(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。

(4) 未払手数料

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. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	276,151

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

1. 関連会社株式

関連会社株式(中間貸借対照表計上額 77,100千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上 額が取得原価を超え るもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債 等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	921,189	730,244	190,944
	小計	921,189	730,244	190,944
中間貸借対照表計上 額が取得原価を超え ないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債 等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,494,041	1,656,021	161,979
	小計	1,494,041	1,656,021	161,979
	合計	2,415,231	2,386,265	28,965

(注)非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

[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。

[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。

[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）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	5,590円26銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	10,139,988
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	10,139,988
普通株式の発行済株式数(株)	1,813,864
普通株式の自己株式数(株)	-
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	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)
(2) 1株当たり中間純利益金額	1,049円50銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,903,666
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載しておりません。

（追加情報）

役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

繰延税金資産

「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。

（重要な後発事象）

当社(以下「新光投信」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及びみずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

a. 定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

b. 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) みずほ信託銀行株式会社（「受託者」）

a．資本金の額

平成28年3月末日現在、247,369百万円

b．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

（資本金の額は平成28年3月末日現在）

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき、銀行業務を営んでいます。
みずほ信託銀行株式会社	247,369	銀行法に基づき銀行業を営むと共に、兼営法に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

- (1) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理
- (2) 投資信託財産の計算
- (3) その他上記業務に付随する一切の業務

「販売会社」は以下の業務を行います。

- (1) 募集・販売の取り扱い
- (2) 受益者に対する一部解約事務
- (3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (4) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付
- (6) 受益者に対する運用報告書の交付
- (7) 所得税および地方税の源泉徴収
- (8) その他上記業務に付随する一切の業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

(持株比率5%以上を記載します。)

<再信託受託会社の概要>

- 名称 : 資産管理サービス信託銀行株式会社
- 業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部(投資信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(資産管理サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当特定期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成28年 8月31日	臨時報告書
平成28年 9月15日	有価証券届出書
平成28年 9月30日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年11月18日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年11月18日	有価証券報告書
平成28年11月30日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山内 正彦 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 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DIAMアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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、DIAMアセットマネジメント株式会社の平成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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年4月7日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野浩

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルドライブ（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジの平成28年8月19日から平成29年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルドライブ（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジの平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

アセットマネジメントOne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

- () 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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成29年4月7日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原 尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルドライブ（3ヵ月決算型）為替ヘッジなしの平成28年8月19日から平成29年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルドライブ（3ヵ月決算型）為替ヘッジなしの平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

アセットマネジメントOne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

- () 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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原	尚 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野	浩 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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

