

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年4月14日提出
【発行者名】	B N Yメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役会長兼社長 山口 省吾
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号 丸の内トラストタワー本館
【事務連絡者氏名】	明石 晃仁
【電話番号】	03(6756)4725
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	B N Yメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	(1)当初申込期間(平成28年10月3日から平成28年10月28日まで) 1,000億円を上限とします。 (2)継続申込期間(平成28年10月31日から平成29年10月13日まで) 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年9月16日付をもって提出し、平成28年10月2日にその届出の効力が生じた有価証券届出書（平成29年1月4日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の記載事項につきまして、有価証券報告書を提出しましたので、関係情報を新たな情報により訂正・更新を行うため、本訂正届出書を提出いたします。

2【訂正の内容】

原届出書の下記事項のうち、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部_____は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は、原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」の末尾には「中間財務諸表」の内容が追加されます。

第一部【証券情報】

(3)【発行(売出)価額の総額】

<訂正前>

当初申込期間：1,000億円を上限とします。

継続申込期間：5,000億円^{*}を上限とします。

*受益権1口当たりの発行価格に発行口数を乗じて得た金額の合計額です。

<訂正後>

(削除)

5,000億円^{*}を上限とします。

*受益権1口当たりの発行価格に発行口数を乗じて得た金額の合計額です。

(4)【発行(売出)価格】

<訂正前>

当初申込期間：1口=1円

継続申込期間：取得申込受付日の基準価額
(省略)

<訂正後>

(削除)

取得申込受付日の基準価額とします。

(省略)

(5)【申込手数料】

<訂正前>

3.78% (税抜 3.5%) を上限として販売会社 (下記「(8) 申込取扱場所」をご参照ください。) が定める申込手数料率^{*}を、取得申込日の基準価額 (当初申込期間中は、1口=1円) に乗じて得た額が申込手数料となります。ただし、税引後の収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として毎計算期間終了日の基準価額とし、申込手数料は無手数料となります。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

(省略)

<訂正後>

3.78% (税抜 3.5%) を上限として販売会社 (下記「(8) 申込取扱場所」をご参照ください。) が定める申込手数料率^{*}を、取得申込日の基準価額に乗じて得た額が申込手数料となります。ただし、税引後の収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として毎計算期間終了日の基準価額とし、申込手数料は無手数料となります。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

(省略)

(7)【申込期間】

<訂正前>

当初申込期間：平成28年10月3日から平成28年10月28日まで

継続申込期間：平成28年10月31日から平成29年10月13日まで

申込期間は、上記申込期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

<訂正後>

（削除）

平成28年10月31日から平成29年10月13日まで

申込期間は、上記申込期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（9）【払込期日】

<訂正前>

当初申込期間中は、取得申込者は、指定された日までに取得申込にかかる金額を販売会社に支払うもの
とします。当初申込期間における発行価額の総額は、当ファンドの信託設定日に販売会社より委託会社
の指定する口座を経由して、三菱UFJ信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の再信託
受託会社（日本マスタートラスト信託銀行株式会社）のファンド口座に払い込まれます。

継続申込期間中は、取得申込者は、申込みの販売会社が定める日までに取得申込にかかる金額を販売会
社に支払うものとします。継続申込期間における取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる
日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の再信託受託会社のファンド口座に払い込まれま
す。

<訂正後>

取得申込者は、申込みの販売会社が定める日までに取得申込にかかる金額を販売会社に支払うもの
とします。申込期間における取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定す
る口座を経由して三菱UFJ信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の再信託受託会社
（日本マスタートラスト信託銀行株式会社）のファンド口座に払い込まれます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成28年10月31日 ファンドの信託契約締結、運用開始（予定）

<訂正後>

平成28年10月31日 ファンドの信託契約締結、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（省 略）

委託会社の概況

（省 略）

c．資本金の額（平成28年8月末現在）

（省 略）

e．大株主の状況（平成28年8月末現在）

（省 略）

<訂正後>

（省 略）

委託会社の概況

（省 略）

c．資本金の額（平成29年3月末現在）

（省 略）

e．大株主の状況（平成29年3月末現在）

（省 略）

2【投資方針】

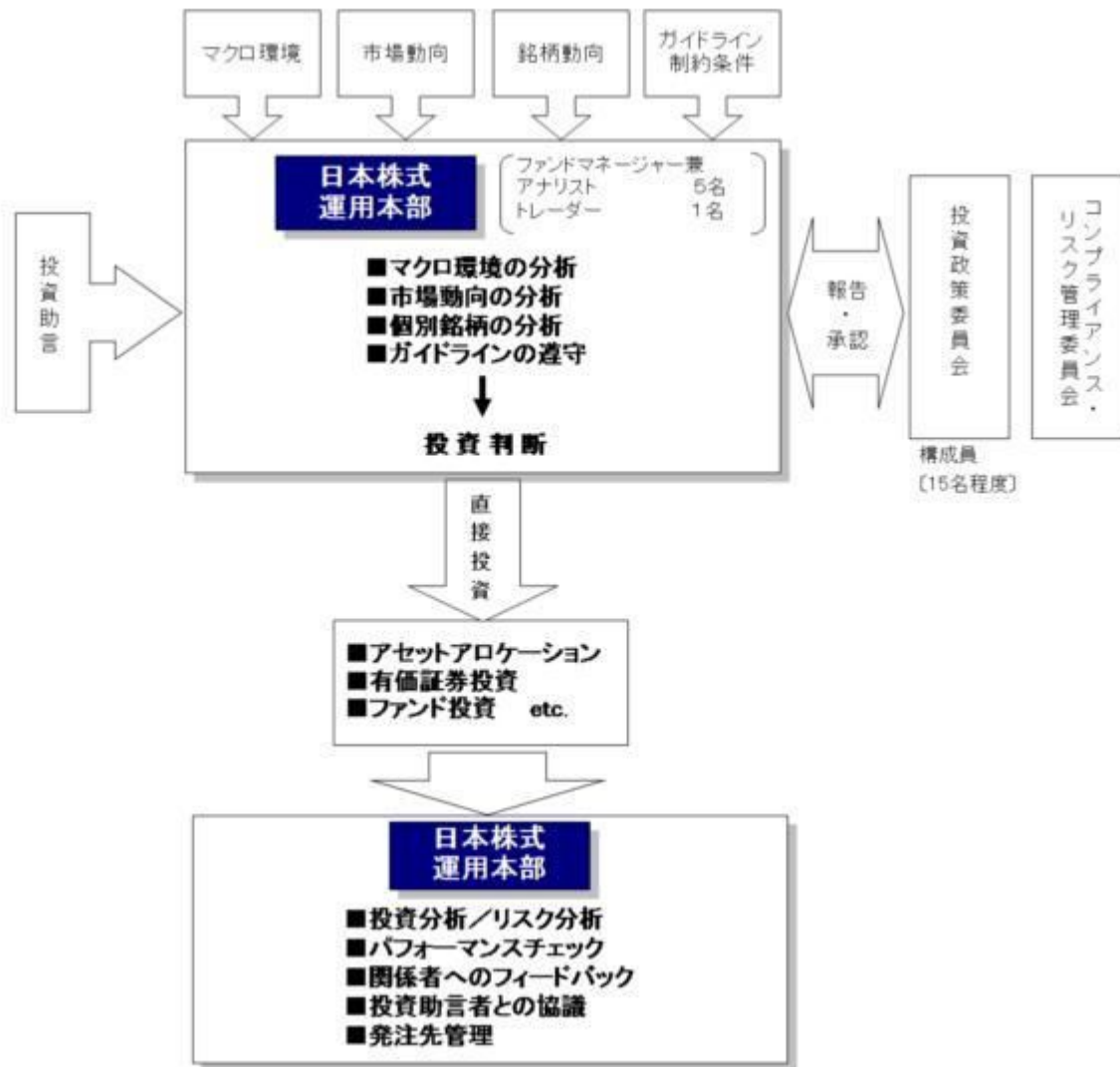
(3)【運用体制】

<訂正前>

— 当ファンドに関する委託会社の運用体制

- ・ 原則として毎月2回開催される投資政策委員会において、当ファンドの運用が、ファンドの投資基本方針、投資対象および投資制限に沿う形で行われているか、遵守状況の確認等を行います。
- ・ 同委員会では、併せて運用にかかる法令および運用ガイドライン等の遵守・違反発生状況、改善後の状況等がコンプライアンス・オフィサーより報告され、必要に応じて関係部署に対し改善指示を行います。

（下記「3 投資リスク」の「(2) リスク管理体制」と併せてご参照ください。）



（省略）

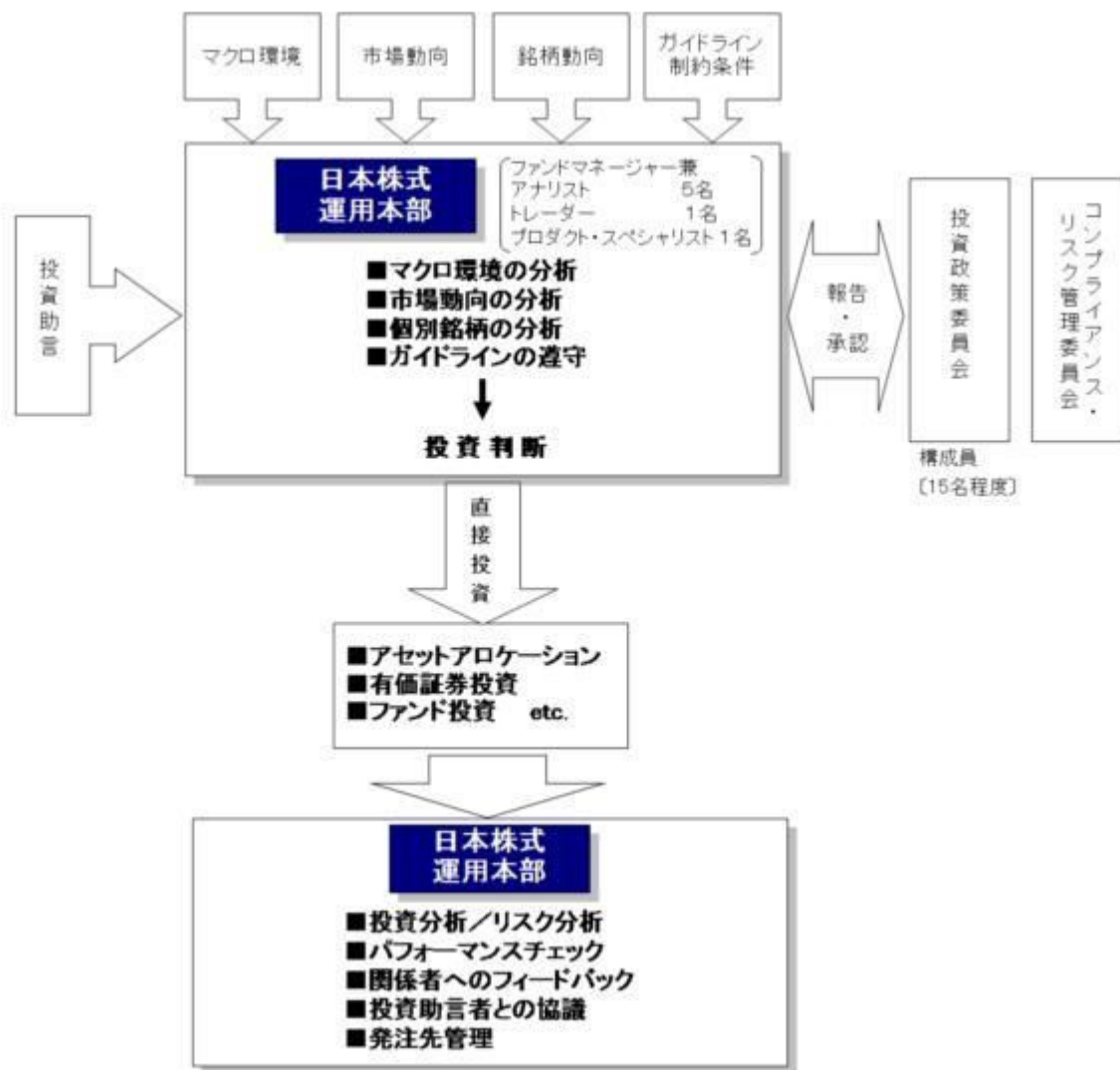
（注）上記の運用体制は2016年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

当ファンドに関する委託会社の運用体制

- ・ 原則として毎月開催される投資政策委員会において、当ファンドの運用が、ファンドの投資基本方針、投資対象および投資制限に沿う形で行われているか、遵守状況の確認等を行います。
- ・ 同委員会では、併せて運用にかかる法令および運用ガイドライン等の遵守・違反発生状況、改善後の状況等がコンプライアンス・オフィサーより報告され、必要に応じて関係部署に対し改善指示を行います。

（下記「3 投資リスク」の「（2）リスク管理体制」と併せてご参照ください。）



(省 略)

(注) 上記の運用体制は2017年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

(省 略)

(2) リスク管理体制

(省 略)

投資政策委員会 (原則毎月2回開催)	ファンドの運用計画案の審議、運用実績の評価、運用に関する法令および内部規則の遵守状況の確認、最良執行に関する方針の策定および確認を行っています。
コンプライアンス・リスク管理委員会 (原則毎月1回開催)	コンプライアンスおよびリスク管理にかかる審議・決定を行い、委託会社の法令遵守・リスク管理として必要な内部管理体制を確保します。

(省 略)

(省 略)

(注) 上記の管理体制は2016年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(省 略)

(3) 参考情報

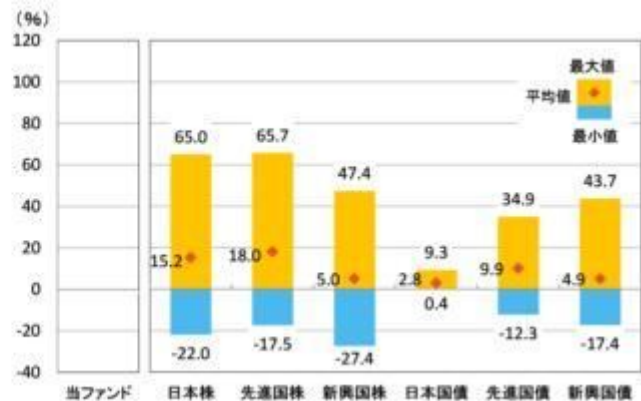
当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

当ファンドと代表的な資産クラス との騰落率の比較

グラフは、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

(2011年8月～2016年7月)

* 当ファンドは2016年10月31日に当初の設定を行う予定のため、掲載しておりません。



(左図) について

* 当ファンドは2016年10月31日に当初の設定を行う予定のため、掲載しておりません。

(右図) について

* グラフは、2011年8月～2016年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

なお、当ファンドについては、2016年10月31日に当初の設定を行う予定のため、掲載しておりません。

* 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。

(省略)

<訂正後>

(省略)

(2) リスク管理体制

(省略)

投資政策委員会 (原則毎月1回開催)	ファンドの運用計画案の審議、運用実績の評価、運用に関する法令および内部規則の遵守状況の確認、最良執行に関する方針の策定および確認を行っています。
-----------------------	--

コンプライアンス・ リスク管理委員会 (原則毎月1回開催)	コンプライアンスおよびリスク管理に関わる事項等の審議・決定を行い、委託会社の法令遵守・リスク管理として必要な内部管理態勢を確保します。
-------------------------------------	---

(省略)

(省略)

(注) 上記の管理体制は2017年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(省略)

(3) 参考情報

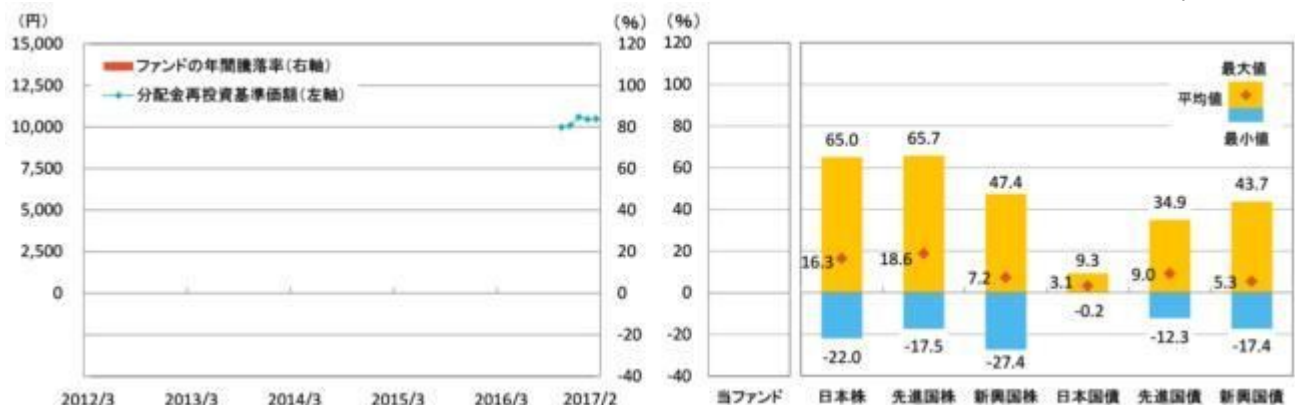
当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

当ファンドと代表的な資産クラス との騰落率の比較

グラフは、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

(2012年3月～2017年2月)

(2012年3月～2017年2月)



（左図）について

- * 当ファンドは、設定日（2016年10月31日）から1年経過していないため、各月末における直近1年間の騰落率を表示することができません。
- * 年間騰落率は、税引き前収益分配金を分配時に再投資したものとして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。また、分配金再投資基準価額は、税引き前収益分配金を分配時に再投資したものとして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

（右図）について

- * グラフは、2012年3月～2017年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。
なお、当ファンドについては、設定日が2016年10月31日のため、直近1年間の騰落率を表示することができません。
- 当ファンドについては、税引き前収益分配金を分配時に再投資したものとして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

- * 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。

（省 略）

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

<訂正前>

3.78%（税抜 3.5%）を上限として販売会社が定める申込手数料率^{*}を、取得申込日の基準価額（当初申込期間中は、1口＝1円）に乗じて得た額が申込手数料となります。ただし、税引後の収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として毎計算期間終了日の基準価額とし、申込手数料は無手数料となります。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

（省 略）

<訂正後>

3.78%（税抜 3.5%）を上限として販売会社が定める申込手数料率^{*}を、取得申込日の基準価額に乗じて得た額が申込手数料となります。ただし、税引後の収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として毎計算期間終了日の基準価額とし、申込手数料は無手数料となります。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

（省 略）

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（省 略）

個人、法人別の課税の取扱いについて

（省 略）

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、平成28年4月1日より創設される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

（省 略）

（注）「課税上の取扱い」の内容は平成28年8月末現在のものであり、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。課税上の取扱い等については、税務専門家に相談することをお勧めします。

<訂正後>

（省 略）

個人、法人別の課税の取扱いについて

（省 略）

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、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

（省 略）

（注）「課税上の取扱い」の内容は平成29年3月末現在のものであり、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。課税上の取扱い等については、税務専門家に相談することをお勧めします。

5【運用状況】

<更新後>

以下は2017年2月28日現在です。

（1）【投資状況】

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	18,774,841,760	90.45
投資信託受益証券	日本	1,575,952,720	7.59
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		406,923,673	1.96
合計（純資産総額）		20,757,718,153	100.00

（注）投資比率は、当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。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
						単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	日本	投資信託	TOPIX運動型上場投資信託		999,970	1,571.04	1,571,002,084	1,576	1,575,952,720	7.59
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,116,400	726.93	811,555,277	738.40	824,349,760	3.97
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	87,400	8,360.64	730,720,096	8,362.00	730,838,800	3.52
4	日本	株式	日本電産	電気機器	58,200	10,564.98	614,882,303	10,490.00	610,518,000	2.94
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	127,000	4,496.45	571,049,467	4,377.00	555,879,000	2.68
6	日本	株式	積水化学工業	化学	282,000	1,928.09	543,723,764	1,855.00	523,110,000	2.52
7	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	81,800	6,814.43	557,420,600	6,365.00	520,657,000	2.51
8	日本	株式	横河電機	電気機器	273,500	1,724.70	471,705,767	1,749.00	478,351,500	2.30
9	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	111,500	4,768.09	531,642,379	4,207.00	469,080,500	2.26
10	日本	株式	ニフコ	化学	80,100	6,044.90	484,196,815	5,750.00	460,575,000	2.22
11	日本	株式	日東電工	化学	47,900	8,816.34	422,302,808	9,460.00	453,134,000	2.18
12	日本	株式	ダイキン工業	機械	40,800	11,250.80	459,032,957	10,665.00	435,132,000	2.10
13	日本	株式	SCSK	情報・通信業	101,600	4,205.54	427,283,630	4,140.00	420,624,000	2.03
14	日本	株式	日立製作所	電気機器	675,000	651.74	439,927,456	618.80	417,690,000	2.01
15	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	107,100	3,815.27	408,616,007	3,757.00	402,374,700	1.94
16	日本	株式	SMC	機械	12,500	27,682.99	346,037,397	31,850.00	398,125,000	1.92
17	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	258,600	1,588.46	410,776,722	1,512.00	391,003,200	1.88
18	日本	株式	パーク24	不動産業	122,200	3,108.29	379,833,508	3,155.00	385,541,000	1.86
19	日本	株式	テンブホールディングス	サービス業	202,200	1,949.16	394,121,026	1,903.00	384,786,600	1.85
20	日本	株式	キーエンス	電気機器	8,700	41,888.12	364,426,725	43,460.00	378,102,000	1.82
21	日本	株式	五洋建設	建設業	703,800	565.20	397,788,823	531.00	373,717,800	1.80

22	日本	株式	マツダ	輸送用機器	228,000	1,818.45	414,607,714	1,576.00	359,328,000	1.73
23	日本	株式	ディスコ	機械	21,200	14,308.82	303,347,098	16,890.00	358,068,000	1.72
24	日本	株式	オムロン	電気機器	73,100	4,590.70	335,580,170	4,830.00	353,073,000	1.70
25	日本	株式	光通信	情報・通信業	31,600	10,695.20	337,968,320	11,000.00	347,600,000	1.67
26	日本	株式	良品計画	小売業	14,600	21,712.82	317,007,177	23,750.00	346,750,000	1.67
27	日本	株式	参天製薬	医薬品	215,000	1,438.90	309,364,230	1,610.00	346,150,000	1.67
28	日本	株式	日機装	精密機器	276,200	1,049.56	289,888,472	1,230.00	339,726,000	1.64
29	日本	株式	ニチアス	ガラス・土石製品	319,000	1,140.27	363,746,130	1,054.00	336,226,000	1.62
30	日本	株式	ポーラ・オルビスホールディングス	化学	30,900	10,386.45	320,941,413	10,730.00	331,557,000	1.60

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

種類別および業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	14.16
		化学	10.09
		輸送用機器	9.06
		機械	8.87
		情報・通信業	7.22
		銀行業	6.65
		小売業	4.21
		医薬品	3.55
		建設業	3.32
		不動産業	3.04
		サービス業	3.03
		その他製品	2.85
		食料品	1.94
		精密機器	1.64
		ガラス・土石製品	1.62
		卸売業	1.56
		陸運業	1.46
		金属製品	1.38
		非鉄金属	1.33
		電気・ガス業	1.24
保険業	1.18		
その他金融業	1.06		
投資信託受益証券	国内	-	7.59
	合計		98.04

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

2017年2月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産額の推移は次のとおりです。

計算期間	年月日	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期末	（2017年1月16日）	20,199,587,697	20,199,587,697	1.0642	1.0642

2016年10月末日	10,706,575,633	-	0.9989	-
11月末日	15,829,909,900	-	1.0092	-
12月末日	19,493,794,219	-	1.0602	-
2017年 1月末日	20,220,513,052	-	1.0460	-
2月末日	20,757,718,153	-	1.0483	-

(注) 月末日とはその月の最終営業日を指します。

【分配の推移】

計算期間	1口当たりの分配金(円)
第1期(2016年10月31日～2017年 1月16日)	0

【収益率の推移】

計算期間	収益率(%)
第1期(2016年10月31日～2017年 1月16日)	6.4

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。なお、第1期については、前期末基準価額を1万口当たり10,000円として計算しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

(単位:口)

計算期間	設定口数	解約口数	残存口数
第1期(2016年10月31日～2017年 1月16日)	19,456,457,389	475,012,206	18,981,445,183

(注1) 第1期の設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

(注2) 上記数字は全て本邦内における設定および解約の実績です。

参考情報

<更新後>

3 運用実績

(2017年2月28日現在)

基準価額・純資産総額の推移 (設定日(2016年10月31日)～2017年2月28日)



(注)基準価額は、1万口当たり信託報酬控除後です。

分配の推移 (1万口当たり、税引き前)

2017年 1月	0円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

主要な資産の状況

組入上位10銘柄

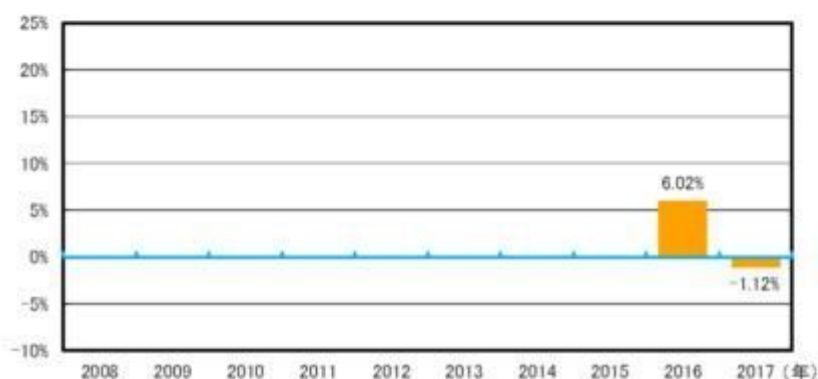
銘柄名	国/地域	種類	業種	投資比率 (%)
1 TOPIX連動型上場投資信託	日本	投資信託 受益証券	—	7.59
2 三菱UFJ フィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	3.97
3 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	3.52
4 日本電産	日本	株式	電気機器	2.94
5 三井住友 フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	2.68
6 積水化学工業	日本	株式	化学	2.52
7 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	2.51
8 横河電機			電気機器	2.30
9 富士重工業	日本	株式	輸送用機器	2.26
10 ニッポ	日本	株式	化学	2.22

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類別および業種別組入比率

種類	業種	投資比率 (%)
株式	電気機器	14.16
	化学	10.09
	輸送用機器	9.06
	機械	8.87
	情報・通信業	7.22
	銀行業	6.65
	小売業	4.21
	医薬品	3.55
	建設業	3.32
	その他	23.32
投資信託受益証券		7.59
現金・預金・その他の 資産(負債控除後)		1.96
合計		100.00

年間収益率の推移 (暦年ベース)



(注1)2016年は設定日(10月31日)から年末までの収益率です。

2017年は2月末までの収益率です。

(注2)当ファンドにはベンチマークはありません。

- ・運用実績等について、別途月次等で開示している場合があります。この場合、委託会社のホームページで閲覧することができます。
- ・運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（省 略）

(2) 受益権の申込み

（省 略）

申込価額は、取得申込受付日の基準価額（当初申込期間中は、1口 = 1円）とします。

（省 略）

<訂正後>

（省 略）

(2) 受益権の申込み

（省 略）

申込価額は、取得申込受付日の基準価額とします。

（省 略）

第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

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

なお、財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款第39条により、平成28年10月31日から平成29年1月16日までとなっております。

(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1期計算期間（平成28年10月31日から平成29年1月16日まで）の財務諸表について、P w C あらた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】

B N Yメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (平成29年 1月16日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,685,916,383
株式	18,054,716,950
投資信託受益証券	889,262,130
未収配当金	18,899,300
流動資産合計	20,648,794,763
資産合計	20,648,794,763
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	118,439,600
前受金	360,000
未払解約金	262,331,846
未払受託者報酬	1,511,656
未払委託者報酬	64,245,255
その他未払費用	2,318,709
流動負債合計	449,207,066
負債合計	449,207,066
純資産の部	
元本等	
元本	18,981,445,183
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	1,218,142,514
(分配準備積立金)	1,071,438,824
元本等合計	20,199,587,697
純資産合計	20,199,587,697
負債純資産合計	20,648,794,763

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 (自 平成28年10月31日 至 平成29年 1月16日)
営業収益	
受取配当金	19,784,900
有価証券売買等損益	1,184,005,402
派生商品取引等損益	37,325,704
その他収益	2,587,394
営業収益合計	1,169,051,992
営業費用	
受託者報酬	1,511,656
委託者報酬	64,245,255
その他費用	2,771,165
営業費用合計	68,528,076
営業利益又は営業損失()	1,100,523,916
経常利益又は経常損失()	1,100,523,916
当期純利益又は当期純損失()	1,100,523,916
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	29,085,092
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	148,846,828
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	148,846,828
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,143,138
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,143,138
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	1,218,142,514

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<ul style="list-style-type: none"> ・株式、投資信託受益証券 移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 ・金融商品取引所に上場されている株式、投資信託受益証券 原則として、金融商品取引所における計算期間末日の最終相場で評価しております。 同計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には、当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合には、当該取引所における同計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<ul style="list-style-type: none"> ・市場デリバティブ取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	<ul style="list-style-type: none"> ・受取配当金の計上基準 受取配当金は、原則として株式の配当金落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<ul style="list-style-type: none"> ・第1期計算期間は、信託約款第39条により平成28年10月31日(設定日)から平成29年1月16日までとしております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (平成29年1月16日現在)
1. 受益権の総数	18,981,445,183口

2.1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		1,0642円 (10,642円)
3.差入代用有価証券	株式	2,678,264,200円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 (自 平成28年10月31日 至 平成29年 1月16日)	
1.分配金の計算過程	計算期末における費用控除後の配当等収益(20,809,309円)、費用控除後の有価証券売買等損益(1,050,629,515円)、信託約款に規定する収益調整金(146,703,690円)及び分配準備積立金(0円)より、分配可能額は1,218,142,514円(1万口当たり641.74円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品の運用をしております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権・金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3)注記表」及び「(4)附属明細表」に記載しております。これらは、有価証券の運用による信用リスク、市場リスク(価格変動リスク・流動性リスク)に晒されております。デリバティブ取引には、先物取引が含まれており、当ファンドは当該デリバティブ取引により決済不履行リスク及び市場リスク(価格変動リスク・流動性リスク)に晒されております。当該デリバティブ取引は投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避する目的のみならず、効率的で長期的な運用に資する目的で用いられることもあります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては投資リスク管理に関する委員会を設け、運用リスクの管理を行っております。コンプライアンス・リスク管理部門は運用リスクの管理において、信託約款等の遵守状況や、市場リスク及び信用リスク等のモニターを行い、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行っております。

金融商品の時価等に関する事項

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は時価または時価の近似値と考えられる帳簿価額で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との間に重要な差額はありませぬ。
2.時価の算定方法	(1)株式、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。 (2)派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)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、帳簿価額は時価と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。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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います。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額また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に係る市場リスクを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第1期 (自 平成28年10月31日 至 平成29年 1月16日)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株 式	1,088,431,349
投資信託受益証券	27,675,380
合 計	1,116,106,729

(デリバティブ取引に関する注記)

(株式関連)

区分	種類	第1期 (平成29年1月16日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,421,540,000	-	11,303,500,000	118,040,000
	合計	-	-	-	118,040,000

(注)時価の算定方法

1. 市場デリバティブ取引の残高表示は、契約額によっております。
2. 市場デリバティブ取引の評価においては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本額の変動

項目	第1期 (平成29年1月16日現在)
期首元本額	10,718,463,610円
期中追加設定元本額	8,737,993,779円
期中一部解約元本額	475,012,206円

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表(平成29年1月16日現在)

(イ)株式

次表の通りです。

種類	通貨	銘柄	株数	評価単価(円)	評価額(円)	備考
株式	日本円	東鉄工業	98,500	3,165.00	311,752,500	
		五洋建設	672,500	566.00	380,635,000	
		日本たばこ産業	102,400	3,819.00	391,065,600	代用有価証券 102,400株
		ダイセル	251,200	1,281.00	321,787,200	
		積水化学工業	269,500	1,930.00	520,135,000	
		ポーラ・オルビス ホールディングス	29,500	10,380.00	306,210,000	
		日東電工	45,800	8,798.00	402,948,400	
		ニフコ	76,700	6,060.00	464,802,000	
		アステラス製薬	247,000	1,591.50	393,100,500	代用有価証券 247,000株
		参天製薬	205,400	1,436.00	294,954,400	
		ニチアス	360,000	1,140.00	410,400,000	
		U A C J	855,000	333.00	284,715,000	
		リンナイ	30,200	9,600.00	289,920,000	
		ディスコ	20,300	14,250.00	289,275,000	
		S M C	11,900	27,595.00	328,380,500	
		ダイキン工業	35,600	11,235.00	399,966,000	
		アネスト岩田	197,200	1,150.00	226,780,000	
		キトー	116,300	1,298.00	150,957,400	
		スター精密	140,200	1,594.00	223,478,800	
		日立製作所	644,000	652.30	420,081,200	

日本電産	55,500	10,555.00	585,802,500	代用有価証券 55,500株
大崎電気工業	208,000	1,175.00	244,400,000	
オムロン	70,800	4,580.00	324,264,000	
横河電機	261,300	1,724.00	450,481,200	
日本光電工業	116,700	2,622.00	305,987,400	
キーエンス	4,100	83,610.00	342,801,000	
いすゞ自動車	200,100	1,513.00	302,751,300	
トヨタ自動車	78,200	6,827.00	533,871,400	代用有価証券 78,200株
マツダ	217,900	1,825.50	397,776,450	
富士重工業	106,500	4,779.00	508,963,500	
シマノ	12,300	18,850.00	231,855,000	
日機装	270,900	1,048.00	283,903,200	
バンダイナムコ ホールディングス	101,200	3,230.00	326,876,000	
三菱鉛筆	55,800	6,220.00	347,076,000	
メタウォーター	87,100	2,775.00	241,702,500	
山九	447,000	701.00	313,347,000	
光通信	31,000	10,700.00	331,700,000	
S C S K	97,000	4,210.00	408,370,000	
ソフトバンクグループ	83,500	8,350.00	697,225,000	
トラスコ中山	108,400	2,567.00	278,262,800	
ジェイアイエヌ	38,700	5,880.00	227,556,000	
ツルハホールディングス	26,000	11,190.00	290,940,000	
良品計画	13,900	21,730.00	302,047,000	
三菱UFJ フィナンシャル・グループ	1,066,700	726.00	774,424,200	代用有価証券 1,066,700株
三井住友 フィナンシャルグループ	121,400	4,496.00	545,814,400	
アニコム ホールディングス	105,600	2,295.00	242,352,000	
全国保証	57,600	4,005.00	230,688,000	
スター・マイカ	93,800	1,940.00	181,972,000	
パーク24	116,900	3,110.00	363,559,000	
テンブホールディングス	193,200	1,948.00	376,353,600	
総合警備保障	55,000	4,550.00	250,250,000	
合計			18,054,716,950	

(口) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額 / 口数	評価額	備考
投資信託受益証券	日本円	TOPIX連動型上場投資信託	566,770	889,262,130	
合計				889,262,130	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「(3) 注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

<更新後>

【純資産額計算書】

(平成29年2月28日現在)

資産総額	24,303,524,493円
負債総額	3,545,806,340円
純資産総額(-)	20,757,718,153円

発行済数量	19,801,983,598口
1単位当たり純資産額(/)	1.0483円
(1万口当たり純資産額)	(10,483円)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

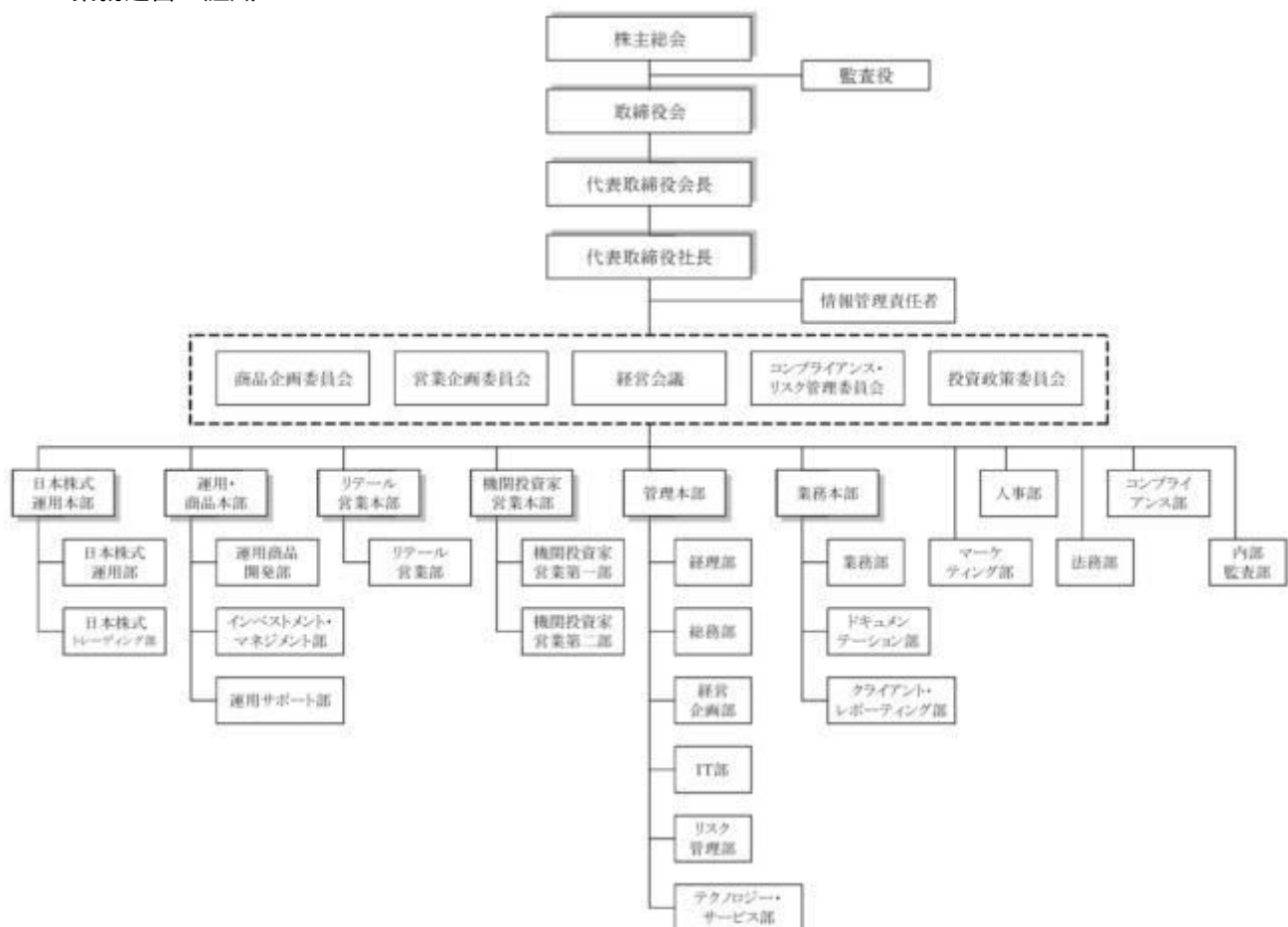
(1) 資本金の額（平成28年8月末現在）

（省 略）

(2) 委託会社の機構（平成28年8月末現在）

（省 略）

業務運営の組織



取締役会は、委託会社の業務執行に関する重要事項を決定します。代表取締役は、委託会社を代表し、全般の業務執行について統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、監査役は、会計監査および業務監査を行います。

（注）上記の組織図は平成28年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

運用体制

（省 略）

- ・原則として毎月2回開催される投資政策委員会において、ファンドの運用ならびにファンドの運用の指図権限を委託している投資顧問会社の運用が、ファンドの投資基本方針、投資対象、投資制限および運用委託契約に沿う形で行われているか、遵守状況の確認等を行います。
- ・B N Yメロン・グループ（「ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・コーポレーション」の傘下にある運用会社等のグループ企業）のリサーチ力・運用ノウハウを活用します。

（注）上記の運用体制は平成28年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

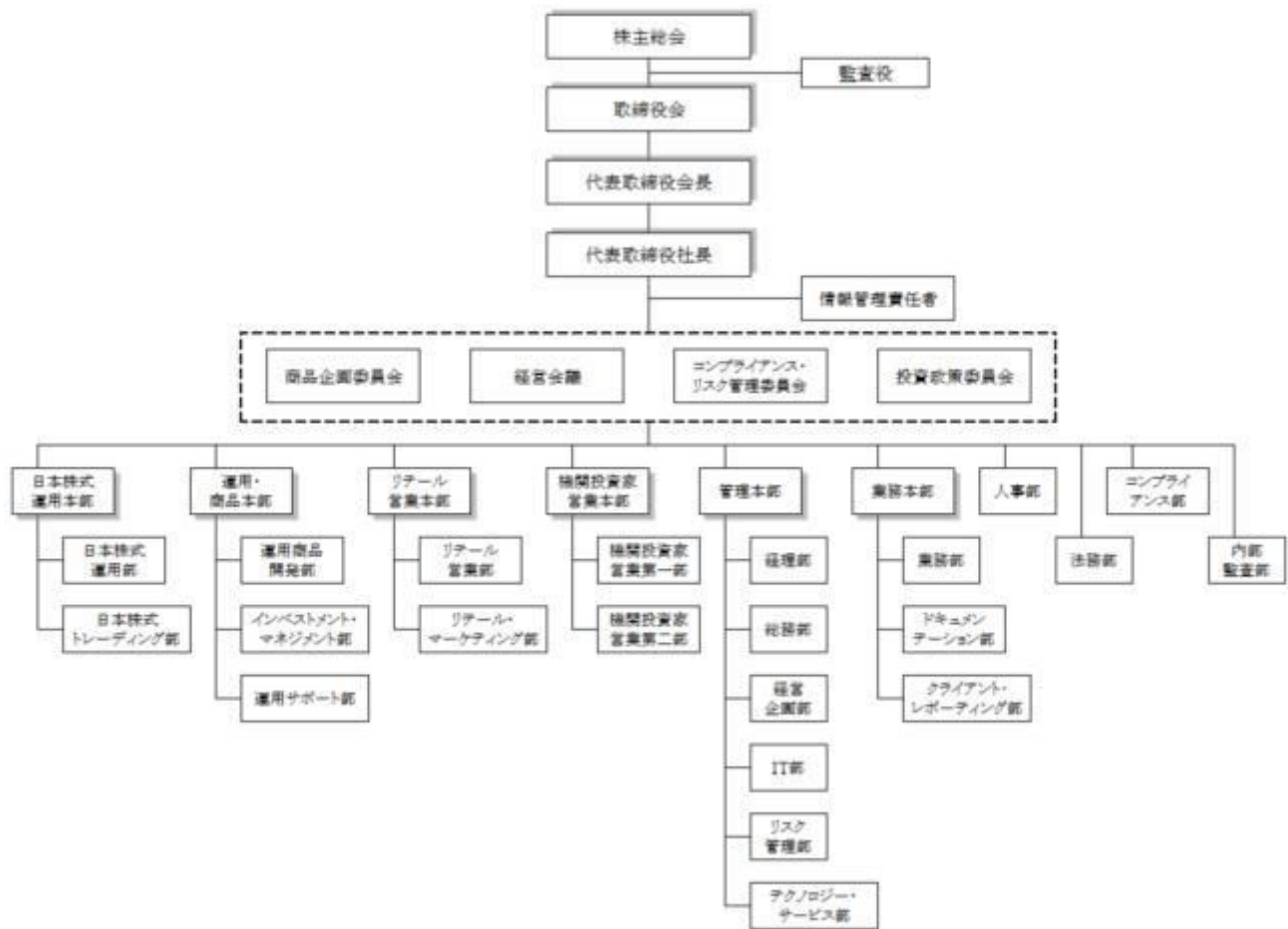
(1) 資本金の額（平成29年3月末現在）

（省 略）

(2) 委託会社の機構（平成29年3月末現在）

（省 略）

業務運営の組織



取締役会は、委託会社の業務執行に関する重要事項を決定します。代表取締役は、委託会社を代表し、全般の業務執行について統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、監査役は、会計監査および業務監査を行います。

（注）上記は平成29年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

運用体制

（省 略）

- ・原則として毎月開催される投資政策委員会において、ファンドの運用ならびにファンドの運用の指図権限を委託している投資顧問会社の運用が、ファンドの投資基本方針、投資対象、投資制限および運用委託契約に沿う形で行われているか、遵守状況の確認等を行います。
- ・B N Yメロン・グループ（「ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・コーポレーション」の傘下にある運用会社等のグループ企業）のリサーチ力・運用ノウハウを活用します。

（注）上記の運用体制は平成29年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務及び第二種金融商品取引業を行っています。

平成29年2月末現在、委託会社の運用する投資信託の本数、純資産額の合計は次のとおりです。（ただし、親投資信託を除きます。）

ファンドの種類	本数	純資産額合計 (百万円)
公募証券投資信託	23	125,849
追加型株式投資信託	23	125,849

追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	0	0
単体型公社債投資信託	0	0
私募証券投資信託	19	930,071
合計	42	1,055,920

3【委託会社等の経理状況】

[注記事項]

<追加>

（中間財務諸表）

1. 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20期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。
3. 中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

（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・預金		3,561,378
未収委託者報酬		480,728
未収運用受託報酬		2,004,194
未収収益		111,684
未収入金		64,140
前払費用		50,288
仮払金		8,607
繰延税金資産		104,076
流動資産計		6,385,098
固定資産		
有形固定資産		
器具備品	*1	1,808
リース資産	*1	9,624
有形固定資産計		11,432
無形固定資産		
ソフトウェア	*2	127,242
無形固定資産計		127,242
投資その他の資産		
投資有価証券		2,158
長期差入保証金		126,476
長期前払費用		4,502
繰延税金資産		121,940
投資その他の資産計		255,077
固定資産計		393,752
資産合計		6,778,850
負債の部		
流動負債		

未払金		119,777
未払費用		2,547,509
預り金		16,712
未払法人税等		129,135
未払消費税等	*3	59,998
仮受金		26,138
賞与引当金		265,100
リース債務		3,761
流動負債計		3,168,133
固定負債		
退職給付引当金		382,060
リース債務		6,032
固定負債計		388,093
負債合計		3,556,226
純資産の部		
株主資本		
資本金		795,000
資本剰余金		
資本準備金		695,000
資本剰余金計		695,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,732,515
利益剰余金計		1,732,515
株主資本計		3,222,515
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		109
評価・換算差額等計		109
純資産合計		3,222,624
負債・純資産合計		6,778,850

(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		1,191,700
運用受託報酬		2,541,479
その他営業収益		353,034
営業収益計		4,086,214
営業費用		2,722,006
営業費用計		2,722,006
一般管理費	*1	1,162,754
営業利益		201,454
営業外収益		121
営業外費用		16,797
経常利益		184,778
税引前中間純利益		184,778
法人税、住民税及び事業税		116,368
法人税等調整額		57,605
中間純利益		126,014

(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				評価・換算 差 額 等	純資産合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	株主資本 合 計	その他有価証券 評価差額金	
		資本準備金	そ の 他 利益剰余金 繰越利益 剰 余 金			
当期首残高	795,000	695,000	1,606,500	3,096,500	116	3,096,616
当中間期変動額						
中間純利益			126,014	126,014		126,014
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					6	6
当中間期変動額合計	-	-	126,014	126,014	6	126,008
当中間期末残高	795,000	695,000	1,732,515	3,222,515	109	3,222,624

[注記事項]

(重要な会計方針)

期 別	当中間会計期間 (自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日)
項 目	
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 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）
2. 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） 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりです。 器具備品 3年～20年 (2) 無形固定資産 定額法によっております。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。 (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額法を採用しております。 (4) 長期前払費用 定額法によっております。
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給に備えるため、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 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。
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 消費税及び地方消費税の会計処理は、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。
5. 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。

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
*1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。	
器具備品	14,854千円
リース資産	9,078千円
*2. 無形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。	
ソフトウェア	126,536千円
*3. 消費税等の取り扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「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)

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. 減価償却実施額は以下のとおりであります。	
有形固定資産	2,024千円
無形固定資産	21,458千円

(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. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	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)
発行済株式 普通株式	15,900	-	-	15,900

(リース取引関係)

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. ファイナンス・リース取引	
所有権移転外ファイナンス・リース取引	
(1) リース資産の内容	
有形固定資産	
コピー機	
(2) リース資産の減価償却方法	
中間財務諸表作成の基本となる重要な事項「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。	

(金融商品関係)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額

(1)現金・預金	3,561,378	3,561,378	-
(2)未収委託者報酬	480,728	480,728	-
(3)未収運用受託報酬	2,004,194	2,004,194	-
(4)未収収益	111,684	111,684	-
(5)未収入金	64,140	64,140	-
(6)長期差入保証金	126,476	105,347	21,128
(7)投資有価証券 その他の有価証券	2,158	2,158	-
資産計	6,350,758	6,329,629	21,128
(1)未払費用	2,547,509	2,547,509	-
負債計	2,547,509	2,547,509	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法ならびに有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金・預金

預金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、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収収益、(5) 未収入金

短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから当該帳簿価額によっております。

(6) 長期差入保証金

長期差入保証金については、返還予定時期に基づき、合理的に見積もった将来キャッシュ・フローをその期間に応じた無リスクの利率で割り引いた現在価値によっております。

(7) 投資有価証券

投資有価証券は当社設定の投資信託であります。これらの時価は公表されている基準価額によっております。

負 債

(1) 未払費用

短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから当該帳簿価額によっております。

(有価証券関係)

1. その他有価証券

当中間会計期間（平成28年9月30日）

（単位：千円）

区 分	種 類	取得原価	中間貸借対照表 計上額	差 額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	2,000	2,158	158
	小 計	2,000	2,158	158
合 計		2,000	2,158	158

2. 売却したその他有価証券

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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(企業結合等関係)

該当事項はありません。

(貸貸等不動産関係)

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）

当社の報告セグメントは、「投資運用業」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

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他営業収益	合計
外部顧客への売上高	1,191,700	2,541,479	353,034	4,086,214

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位：千円)

日本	ヨーロッパ	アメリカ	その他	合計
2,571,879	46,149	1,464,307	3,878	4,086,214

(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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益	関連するセグメント名
BNYメロン・インターナショナル・マネジメント・リミテッド	1,316,402	投資運用業

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	202,680.80円
1株当たり中間純利益金額	7,925.46円
(注) 1. 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。	
2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。	
中間純利益(千円)	126,014
普通株式に係る中間純利益(千円)	126,014
普通株式に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	15,900

(重要な後発事項)

該当事項はありません。

5【その他】

<訂正前>

(省略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、委託会社および当ファンドに重要な影響を与えると予想される事実はありません。また、訴訟はありません。

<訂正後>

(省 略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、委託会社および当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。また、訴訟はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

名称 : 三菱UFJ信託銀行株式会社
 資本金の額 : 324,279百万円（平成28年3月末現在）
 (省 略)

<参考：再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
 資本金の額 : 10,000百万円（平成28年3月末現在）
 (省 略)

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
1	東海東京証券株式会社	6,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
2	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
3	宇都宮証券株式会社	301百万円	
4	ほくほくTT証券株式会社	1,250百万円	

ほくほくTT証券株式会社の資本金の額は、平成29年1月4日現在です。

(3) 投資助言会社

名称 : 日興グローバルラップ株式会社
 資本金の額 : 1,499百万円（平成28年3月末現在）
 (省 略)

<訂正後>

(1) 受託会社

名称 : 三菱UFJ信託銀行株式会社
 資本金の額 : 324,279百万円（平成28年9月末現在）
 (省 略)

<参考：再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
 資本金の額 : 10,000百万円（平成28年9月末現在）
 (省 略)

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (平成28年9月末現在)	事業の内容
1	東海東京証券株式会社	6,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
2	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
3	宇都宮証券株式会社	301百万円	
4	ほくほくTT証券株式会社	1,250百万円	

ほくほくTT証券株式会社の資本金の額は、平成29年1月4日現在です。

(3) 投資助言会社

名称 : 日興グローバルラップ株式会社

資本金の額：1,499百万円（平成28年9月末現在）
（省略）

独立監査人の監査報告書

平成29年3月15日

B N Yメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社
取締役会 御 中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

鶴田 光夫

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B N Yメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンドの平成28年10月31日から平成29年1月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、B N Yメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンドの平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

B N Yメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL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29年1月5日

B N Yメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦
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、「委託会社等の経理の状況」に掲げられているB N Yメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第20期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、B N Yメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社の平成28年9月30日現在の財務状態並びに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）の経営成績の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（注）上記は、当社が、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。