

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	令和1年8月20日
<b>【発行者名】</b>	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 松下 隆史
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都港区愛宕二丁目5番1号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	植松 克彦
<b>【電話番号】</b>	03-5405-0784
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	グローバルC B オープン・高金利通貨コース グローバルC B オープン・円コース グローバルC B オープン（マネープールファンド）
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	各々につき、1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当ありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

2019年3月15日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものではありません。

**2【訂正箇所および訂正事項】**

## 第一部【証券情報】

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

## (2)内国投資信託受益証券の形態等

(以下略)

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社（2019年4月1日より、三井住友DSアセットマネジメント株式会社となります（予定）。以下、新会社名を記載します。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(以下略)

## (4)発行（売出）価格

(以下略)

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

(注)委託会社に対する照会先の情報は、2019年4月1日現在（予定）のものであります（以下同じ。）。

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

## (5)申込手数料

[各コース]

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、3.78%（税抜3.5%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

(以下略)

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

[マネープールファンド]

(以下略)

<訂正後>

## (2)内国投資信託受益証券の形態等

(以下略)

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友DSアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(以下略)

## (4)発行（売出）価格

(以下略)

照会先の名称	電話番号	ホームページ

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>
-----------------------	--------------	---

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

(5) 申込手数料

[各コース]

申込手数料は、申込価額(発行価格)に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、 $3.78\%^{*}$ (税抜3.5%)を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

(以下略)

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

\*消費税率が10%になった場合は、3.85%となります。

[マネープールファンド]

(以下略)

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

#### (1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

(以下略)

**2** 為替取引手法の異なる2つの通貨コースとマネープールファンドがあり、各ファンド間でスイッチングが可能です。

- 高金利通貨コース、円コースの2つの通貨コースとマネープールファンドの3つのファンドから構成されています。

(高金利通貨コース)

(以下略)

<G20構成国・地域> (2018年11月末現在)

(以下略)



注) 高金利通貨コースの3通貨は2018年11月末現在のものであり、今後市況動向等により取引対象通貨の見直しを行う場合があります。

(以下略)

**3** 毎月の決算日に、原則として収益の分配を目指します。

- 各コースの決算日は、毎月の19日(休業日の場合は翌営業日)とします。
- マネープールファンドの決算日は、毎年5月、11月の19日(休業日の場合は翌営業日)とします。
- 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- 収益分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額な場合等には、分配を行わないことがあります。
- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配のイメージ(マネープールファンドを除く)

(以下略)

下記は投資信託における「収益分配金に関する留意事項」を説明するものであり、当ファンドの分配金額や基準価額を示すものではありません。

### 収益分配金に関する留意事項

(以下略)

## (2) ファンドの沿革

(以下略)

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D Sアセットマネジメント株式会社へ承継（予定）

## (3) ファンドの仕組み

(以下略)

## 委託会社等の概況

- ・ 資本金の額 20億円（2019年4月1日現在（予定））
- ・ 会社の沿革 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立  
(以下略)  
2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更（予定）
- ・ 大株主の状況（2019年4月1日現在（予定））  
(以下略)

&lt;訂正後&gt;

## (1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

## ファンドの特色

(以下略)

**2** 為替取引手法の異なる2つの通貨コースとマネープールファンドがあり、各ファンド間でスイッチングが可能です。

- 高金利通貨コース、円コースの2つの通貨コースとマネープールファンドの3つのファンドから構成されています。

**(高金利通貨コース)**

(以下略)

&lt;G20構成国・地域&gt; (2019年6月末現在)

(以下略)



注) 高金利通貨コースの3通貨は2019年6月末現在のものであり、今後市況動向等により取引対象通貨の見直しを行う場合があります。

(以下略)

3

### 毎月の決算日に、原則として収益の分配を目指します。

- 各コースの決算日は、毎月の19日(休業日の場合は翌営業日)とします。
- マネーボールファンドの決算日は、毎年5月、11月の19日(休業日の場合は翌営業日)とします。
- 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- 分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額な場合等には、分配を行わないことがあります。
- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### 分配のイメージ(マネーボールファンドを除く)

(以下略)

下記は投資信託における「分配金に関する留意事項」を説明するものであり、当ファンドの分配金額や基準価額を示すものではありません。

#### 分配金に関する留意事項

(以下略)

#### (2) ファンドの沿革

(以下略)

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D Sアセットマネジメント株式会社へ承継

#### (3) ファンドの仕組み

(以下略)

##### 委託会社等の概況

- ・資本金の額 20億円(2019年6月末現在)
- ・会社の沿革 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立  
(以下略)  
2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更
- ・大株主の状況(2019年6月末現在)

(以下略)

## 2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

#### (2) 投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

(以下略)

投資信託証券の概要は、2018年11月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。

(以下略)

#### (3) 運用体制

(以下略)

委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務(保管・管理・計算等)を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

上記の運用体制は、2019年4月1日現在(予定)のものです。

(4) 配分方針

(以下略)

< 訂正後 >

(2) 投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要
------------------------

(以下略)

投資信託証券の概要は、2019年6月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。
--

(以下略)

(3) 運用体制

(以下略)

委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務(保管・管理・計算等)を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

(4) 配分方針

(以下略)

[次へ](#)



### 3 投資リスク

#### < リスクの管理体制 >

下線部は訂正部分を示します。

#### < 訂正前 >

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。（2019年4月1日現在（予定））

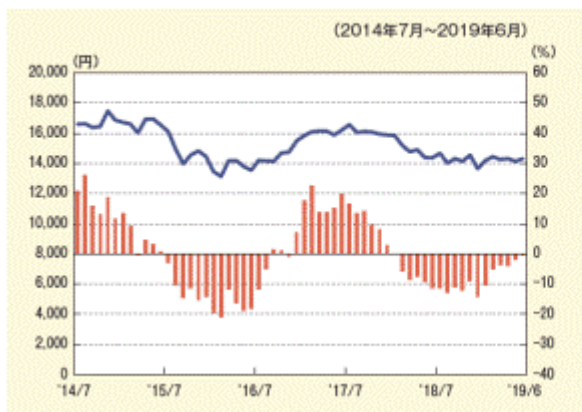
#### < 訂正後 >

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。

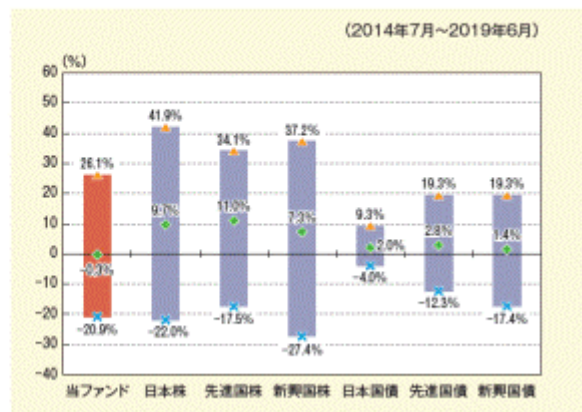
#### < 参考情報 >

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

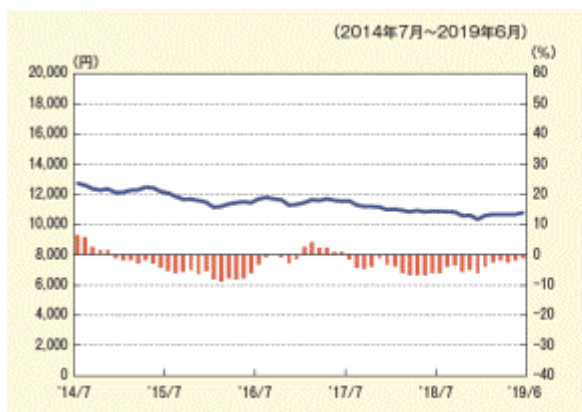
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移  
高金利通貨コース



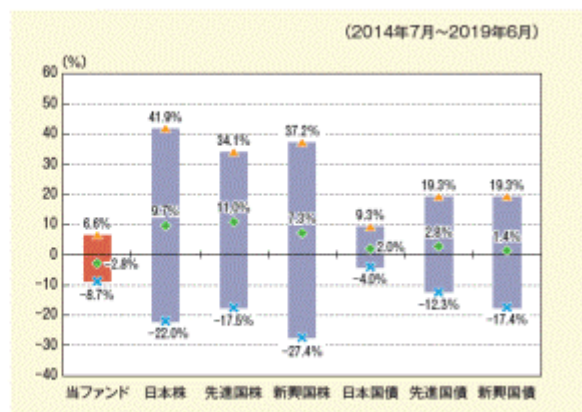
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
高金利通貨コース



円コース



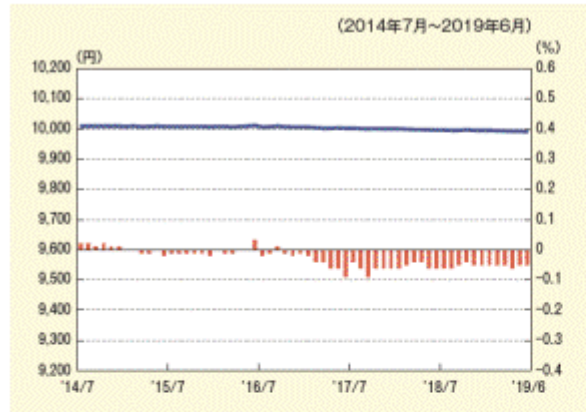
円コース



■ 年間騰落率 (右目盛)    — 分配金再投資基準価額 (左目盛)

◆ 平均値    ▲ 最大値    × 最小値

## 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 マネーボールファンド

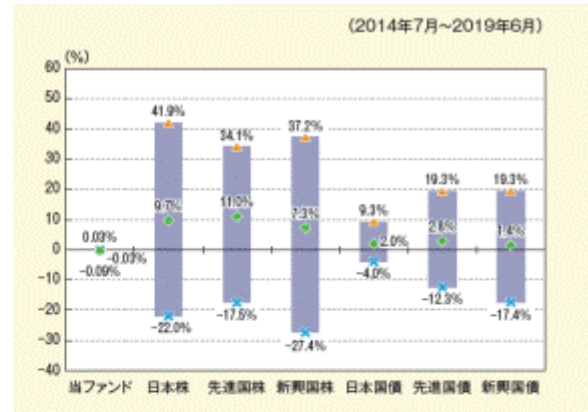


■ 年間騰落率（右目盛）    — 分配金再投資基準価額（左目盛）

※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※年間騰落率および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計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 マネーボールファンド



◆ 平均値    ▲ 最大値    × 最小値

※上記グラフは、上記期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・最小値を表示したものであり、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。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。

※ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しているため、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。

### <各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX（配当込み）	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
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)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村證券株式会社
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	FTSE Fixed Income LLC
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

(注)上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

[次へ](#)

## 4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

## (1) 申込手数料

[ 各コース ]

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、3.78%（税抜3.5%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

（以下略）

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

[ マネープールファンド ]

（以下略）

## (3) 信託報酬等

[ 各コース ]

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.053%（税抜0.975%）を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社の間の配分は以下の表のとおりです。

（以下略）

当ファンドが投資対象とする投資信託証券では、管理報酬等が年率0.67%程度かかりますので、当ファンドにおける実質的な信託報酬は年率1.723%（税込）程度です。

（以下略）

上記の委託会社、販売会社および受託会社の間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「購入後の情報提供、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」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

[ マネープールファンド ]

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、各月の前月の最終5営業日間の無担保コール翌日物レートの平均値（以下「コールレート」といいます。）に応じて、信託財産の純資産総額に年率0.648%（税抜0.60%）以内の率を乗じて得た金額とし、当該月の第1営業日の計上分より適用します。

（以下略）

上記の委託会社、販売会社および受託会社の間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「購入後の情報提供、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」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

（以下略）

## (4) その他の手数料等

（以下略）

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し次に掲げる率を乗じて得た額とし、各コースは各特定期末（毎年5月、11月に属する計算期末）または信託終了時に、マネープールファンドは各計算期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。

各コース	年率0.01026%（税抜0.0095%）以内の率
マネープールファンド	年率0.00648%（税抜0.0060%）以内の率

また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

信託財産留保額はありません。

## (5) 課税上の取扱い

(以下略)

\* 上記の内容は2018年11月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

<訂正後>

(1) 申込手数料

[各コース]

申込手数料は、申込価額(発行価格)に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、 $3.78\%^{*1}$ (税抜3.5%)を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

(以下略)

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

\* 消費税率が10%になった場合は、3.85%となります。

[マネープールファンド]

(以下略)

(3) 信託報酬等

[各コース]

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 $1.053\%^{*1}$ (税抜0.975%)を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社の間の配分は以下の表のとおりです。

(以下略)

当ファンドが投資対象とする投資信託証券では、管理報酬等が年率0.67%程度かかりますので、当ファンドにおける実質的な信託報酬は年率 $1.723\%^{*2}$ (税込)程度です。

(以下略)

上記の委託会社、販売会社および受託会社の間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「購入後の情報提供、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」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

\* 1 消費税率が10%になった場合は、年率1.0725%となります。

\* 2 消費税率が10%になった場合は、年率1.7425%となります。

[マネープールファンド]

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、各月の前月の最終5営業日間の無担保コール翌日物レートの平均値(以下「コールレート」といいます。)に応じて、信託財産の純資産総額に年率 $0.648\%^{*3}$ (税抜0.60%)以内の率を乗じて得た金額とし、当該月の第1営業日の計上分より適用します。

(以下略)

上記の委託会社、販売会社および受託会社の間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「購入後の情報提供、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」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

\* 3 消費税率が10%になった場合は、年率0.66%となります。

信託報酬は日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

(以下略)

(4) その他の手数料等

(以下略)

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し次に掲げる率を乗じて得た額とし、各コースは各特定期末(毎年5月、11月に属する計算期末)または信託終了時に、マネープールファンドは各計算期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。

各コース	年率0.01026% <sup>*1</sup> (税抜0.0095%)以内の率
マネープールファンド	年率0.00648% <sup>*2</sup> (税抜0.0060%)以内の率

また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

\*1 消費税率が10%になった場合は、年率0.01045%となります。

\*2 消費税率が10%になった場合は、年率0.0066%となります。

信託財産留保額はありません。

#### (5)課税上の取扱い

(以下略)

\*上記の内容は2019年6月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

[前へ](#) [次へ](#)

## 5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

グローバルC Bオープン・高金利通貨コース

## (1) 投資状況

(2019年6月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
親投資信託受益証券 (キャッシュ・マネジメント・マザーファンド)	日本	608,528	0.04%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	1,601,524,246	98.79%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		18,930,193	1.17%
純資産総額		1,621,062,967	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。

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2019年6月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	Global Convertible Bond Fund INR Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	1,037,874,365	0.5232 543,117,752	0.5269 546,856,002	- -	33.73%
2	Global Convertible Bond Fund BRL Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	8,280,213,261	0.0649 538,212,847	0.0647 535,729,797	- -	33.05%
3	Global Convertible Bond Fund AUD Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	1,005,694,666	0.5080 510,893,281	0.5160 518,938,447	- -	32.01%
4	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	598,533	1.0167 608,588	1.0167 608,528	- -	0.04%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	98.79%
親投資信託受益証券	0.04%
合計	98.83%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(2019年6月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(2019年6月末現在)

該当事項はありません。

## (3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(百万円)		1口当りの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
設定時 (2011年11月30日)	607	-	1.0000	-
第1特定期間末 (2012年5月21日)	16,403	16,874	0.9966	1.0466
第2特定期間末 (2012年11月19日)	26,966	28,233	1.0592	1.1192
第3特定期間末 (2013年5月20日)	29,247	30,593	1.3810	1.4410
第4特定期間末 (2013年11月19日)	22,467	23,652	1.1963	1.2563
第5特定期間末 (2014年5月19日)	17,930	18,874	1.2782	1.3382
第6特定期間末 (2014年11月19日)	15,803	16,573	1.2793	1.3393

第7特定期間末 (2015年5月19日)	11,654	12,308	1.1907	1.2507
第8特定期間末 (2015年11月19日)	7,225	7,719	0.9906	1.0506
第9特定期間末 (2016年5月19日)	5,265	5,651	0.8588	0.9188
第10特定期間末 (2016年11月21日)	4,367	4,698	0.8399	0.8999
第11特定期間末 (2017年5月19日)	3,848	4,134	0.8573	0.9173
第12特定期間末 (2017年11月20日)	3,219	3,472	0.7966	0.8566
第13特定期間末 (2018年5月21日)	2,478	2,657	0.6924	0.7404
2018年6月末日	2,312	-	0.6755	-
2018年7月末日	2,227	-	0.6829	-
2018年8月末日	2,039	-	0.6452	-
2018年9月末日	2,025	-	0.6521	-
2018年10月末日	1,939	-	0.6369	-
第14特定期間末 (2018年11月19日)	1,955	2,079	0.6462	0.6847
2018年11月末日	1,954	-	0.6520	-
2018年12月末日	1,699	-	0.6084	-
2019年1月末日	1,738	-	0.6284	-
2019年2月末日	1,741	-	0.6364	-
2019年3月末日	1,705	-	0.6250	-
2019年4月末日	1,669	-	0.6239	-
第15特定期間末 (2019年5月20日)	1,594	1,651	0.5999	0.6209
2019年5月末日	1,617	-	0.6126	-
2019年6月末日	1,621	-	0.6166	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

#### 分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(2011年11月30日～2012年5月21日)	0.0500
第2特定期間(2012年5月22日～2012年11月19日)	0.0600
第3特定期間(2012年11月20日～2013年5月20日)	0.0600
第4特定期間(2013年5月21日～2013年11月19日)	0.0600
第5特定期間(2013年11月20日～2014年5月19日)	0.0600
第6特定期間(2014年5月20日～2014年11月19日)	0.0600
第7特定期間(2014年11月20日～2015年5月19日)	0.0600
第8特定期間(2015年5月20日～2015年11月19日)	0.0600
第9特定期間(2015年11月20日～2016年5月19日)	0.0600
第10特定期間(2016年5月20日～2016年11月21日)	0.0600
第11特定期間(2016年11月22日～2017年5月19日)	0.0600
第12特定期間(2017年5月20日～2017年11月20日)	0.0600
第13特定期間(2017年11月21日～2018年5月21日)	0.0480
第14特定期間(2018年5月22日～2018年11月19日)	0.0385
第15特定期間(2018年11月20日～2019年5月20日)	0.0210

#### 収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(2011年11月30日～2012年5月21日)	4.7%
第2特定期間(2012年5月22日～2012年11月19日)	12.3%
第3特定期間(2012年11月20日～2013年5月20日)	36.0%
第4特定期間(2013年5月21日～2013年11月19日)	9.0%
第5特定期間(2013年11月20日～2014年5月19日)	11.9%
第6特定期間(2014年5月20日～2014年11月19日)	4.8%
第7特定期間(2014年11月20日～2015年5月19日)	2.2%
第8特定期間(2015年5月20日～2015年11月19日)	11.8%
第9特定期間(2015年11月20日～2016年5月19日)	7.2%
第10特定期間(2016年5月20日～2016年11月21日)	4.8%
第11特定期間(2016年11月22日～2017年5月19日)	9.2%
第12特定期間(2017年5月20日～2017年11月20日)	0.1%
第13特定期間(2017年11月21日～2018年5月21日)	7.1%
第14特定期間(2018年5月22日～2018年11月19日)	1.1%
第15特定期間(2018年11月20日～2019年5月20日)	3.9%

(注) 収益率 = (当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配付基準価額) ÷ 前特定期末分配付基準価額 × 100

## (4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（2011年11月30日～2012年5月21日）	17,535,522,237	1,075,519,893
第2特定期間（2012年5月22日～2012年11月19日）	12,410,946,989	3,412,489,518
第3特定期間（2012年11月20日～2013年5月20日）	13,175,094,033	17,455,541,825
第4特定期間（2013年5月21日～2013年11月19日）	2,665,969,956	5,063,289,184
第5特定期間（2013年11月20日～2014年5月19日）	1,458,289,223	6,211,691,624
第6特定期間（2014年5月20日～2014年11月19日）	2,637,128,789	4,310,984,250
第7特定期間（2014年11月20日～2015年5月19日）	457,185,625	3,023,258,342
第8特定期間（2015年5月20日～2015年11月19日）	198,754,497	2,691,799,046
第9特定期間（2015年11月20日～2016年5月19日）	154,558,266	1,317,596,262
第10特定期間（2016年5月20日～2016年11月21日）	110,427,789	1,041,368,618
第11特定期間（2016年11月22日～2017年5月19日）	108,980,278	819,978,218
第12特定期間（2017年5月20日～2017年11月20日）	121,406,254	569,309,026
第13特定期間（2017年11月21日～2018年5月21日）	75,963,843	537,587,847
第14特定期間（2018年5月22日～2018年11月19日）	72,153,210	625,482,526
第15特定期間（2018年11月20日～2019年5月20日）	30,269,101	399,258,776

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## グローバルC Bオープン・円コース

## (1) 投資状況

（2019年6月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	841,580	0.03%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	3,250,345,366	97.56%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		80,308,012	2.41%
純資産総額		3,331,494,958	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。

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（2019年6月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	Global Convertible Bond Fund JPY Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	5,397,451,621	0.6007 3,242,249,191	0.6022 3,250,345,366	- -	97.56%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	827,757	1.0167 841,663	1.0167 841,580	- -	0.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	97.56%
親投資信託受益証券	0.03%
合計	97.59%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（2019年6月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（2019年6月末現在）

該当事項はありません。

## (3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （2011年11月30日）	840	-	1.0000	-
第1特定期間末 （2012年5月21日）	32,298	32,744	1.0393	1.0643



第2特定期間末 (2012年11月19日)	50,248	51,406	1.0838	1.1138
第3特定期間末 (2013年5月20日)	69,795	71,520	1.1314	1.1614
第4特定期間末 (2013年11月19日)	57,667	59,369	1.0969	1.1269
第5特定期間末 (2014年5月19日)	47,434	48,800	1.1149	1.1449
第6特定期間末 (2014年11月19日)	34,654	35,752	1.0515	1.0815
第7特定期間末 (2015年5月19日)	24,444	25,259	1.0292	1.0592
第8特定期間末 (2015年11月19日)	16,535	17,134	0.9313	0.9613
第9特定期間末 (2016年5月19日)	12,621	13,081	0.8853	0.9153
第10特定期間末 (2016年11月21日)	10,188	10,570	0.8489	0.8789
第11特定期間末 (2017年5月19日)	8,743	9,077	0.8419	0.8719
第12特定期間末 (2017年11月20日)	6,343	6,614	0.7764	0.8064
第13特定期間末 (2018年5月21日)	4,915	5,077	0.7369	0.7589
2018年6月末日	4,360	-	0.7353	-
2018年7月末日	4,241	-	0.7315	-
2018年8月末日	4,110	-	0.7270	-
2018年9月末日	4,017	-	0.7230	-
2018年10月末日	3,816	-	0.7026	-
第14特定期間末 (2018年11月19日)	3,779	3,871	0.7036	0.7196
2018年11月末日	3,754	-	0.7045	-
2018年12月末日	3,566	-	0.6857	-
2019年1月末日	3,551	-	0.7013	-
2019年2月末日	3,508	-	0.7053	-
2019年3月末日	3,463	-	0.7042	-
2019年4月末日	3,432	-	0.7029	-
第15特定期間末 (2019年5月20日)	3,394	3,424	0.6969	0.7029
2019年5月末日	3,415	-	0.7022	-
2019年6月末日	3,331	-	0.7084	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

#### 分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(2011年11月30日～2012年5月21日)	0.0250
第2特定期間(2012年5月22日～2012年11月19日)	0.0300
第3特定期間(2012年11月20日～2013年5月20日)	0.0300
第4特定期間(2013年5月21日～2013年11月19日)	0.0300
第5特定期間(2013年11月20日～2014年5月19日)	0.0300
第6特定期間(2014年5月20日～2014年11月19日)	0.0300
第7特定期間(2014年11月20日～2015年5月19日)	0.0300
第8特定期間(2015年5月20日～2015年11月19日)	0.0300
第9特定期間(2015年11月20日～2016年5月19日)	0.0300
第10特定期間(2016年5月20日～2016年11月21日)	0.0300
第11特定期間(2016年11月22日～2017年5月19日)	0.0300
第12特定期間(2017年5月20日～2017年11月20日)	0.0300
第13特定期間(2017年11月21日～2018年5月21日)	0.0220
第14特定期間(2018年5月22日～2018年11月19日)	0.0160
第15特定期間(2018年11月20日～2019年5月20日)	0.0060

#### 収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(2011年11月30日～2012年5月21日)	6.4%
第2特定期間(2012年5月22日～2012年11月19日)	7.2%
第3特定期間(2012年11月20日～2013年5月20日)	7.2%
第4特定期間(2013年5月21日～2013年11月19日)	0.4%
第5特定期間(2013年11月20日～2014年5月19日)	4.4%
第6特定期間(2014年5月20日～2014年11月19日)	3.0%
第7特定期間(2014年11月20日～2015年5月19日)	0.7%
第8特定期間(2015年5月20日～2015年11月19日)	6.6%

第9特定期間（2015年11月20日～2016年5月19日）	1.7%
第10特定期間（2016年5月20日～2016年11月21日）	0.7%
第11特定期間（2016年11月22日～2017年5月19日）	2.7%
第12特定期間（2017年5月20日～2017年11月20日）	4.2%
第13特定期間（2017年11月21日～2018年5月21日）	2.3%
第14特定期間（2018年5月22日～2018年11月19日）	2.3%
第15特定期間（2018年11月20日～2019年5月20日）	0.1%

（注）収益率 = （当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配落基準価額） ÷ 前特定期末分配落基準価額 × 100

#### （4）設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（2011年11月30日～2012年5月21日）	32,509,196,361	1,430,942,682
第2特定期間（2012年5月22日～2012年11月19日）	23,691,332,699	8,407,691,102
第3特定期間（2012年11月20日～2013年5月20日）	33,795,805,804	18,470,374,109
第4特定期間（2013年5月21日～2013年11月19日）	5,323,771,311	14,439,292,113
第5特定期間（2013年11月20日～2014年5月19日）	2,481,448,202	12,506,961,189
第6特定期間（2014年5月20日～2014年11月19日）	1,991,498,129	11,579,578,603
第7特定期間（2014年11月20日～2015年5月19日）	191,122,976	9,397,718,303
第8特定期間（2015年5月20日～2015年11月19日）	94,556,004	6,091,524,022
第9特定期間（2015年11月20日～2016年5月19日）	402,757,778	3,899,960,325
第10特定期間（2016年5月20日～2016年11月21日）	70,246,320	2,325,486,153
第11特定期間（2016年11月22日～2017年5月19日）	61,782,498	1,678,534,978
第12特定期間（2017年5月20日～2017年11月20日）	59,239,242	2,274,421,412
第13特定期間（2017年11月21日～2018年5月21日）	38,885,320	1,537,998,839
第14特定期間（2018年5月22日～2018年11月19日）	25,172,129	1,325,295,465
第15特定期間（2018年11月20日～2019年5月20日）	8,666,965	508,875,884

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### グローバルC B オープン（マネーパブルファンド）

##### （1）投資状況

（2019年6月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	2,025,186	100.00%
純資産総額		2,025,186	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。

##### （2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（2019年6月末現在）

イ．主要銘柄の明細

銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1 キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券	1,991,921	1.0167 2,025,188	1.0167 2,025,186	- -	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

##### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

##### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（2019年6月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（2019年6月末現在）

該当事項はありません。

##### （3）運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （2011年11月30日）	1	-	1.0000	-

第1計算期間末 (2012年5月21日)	5	-	1.0003	-
第2計算期間末 (2012年11月19日)	44	-	1.0005	-
第3計算期間末 (2013年5月20日)	32	-	1.0006	-
第4計算期間末 (2013年11月19日)	67	-	1.0008	-
第5計算期間末 (2014年5月19日)	15	-	1.0009	-
第6計算期間末 (2014年11月19日)	18	-	1.0009	-
第7計算期間末 (2015年5月19日)	13	-	1.0009	-
第8計算期間末 (2015年11月19日)	18	-	1.0008	-
第9計算期間末 (2016年5月19日)	17	-	1.0009	-
第10計算期間末 (2016年11月21日)	12	-	1.0006	-
第11計算期間末 (2017年5月19日)	12	-	1.0001	-
第12計算期間末 (2017年11月20日)	12	-	1.0002	-
第13計算期間末 (2018年5月21日)	8	-	0.9997	-
2018年6月末日	8	-	0.9996	-
2018年7月末日	8	-	0.9996	-
2018年8月末日	8	-	0.9995	-
2018年9月末日	8	-	0.9995	-
2018年10月末日	5	-	0.9997	-
第14計算期間末 (2018年11月19日)	5	-	0.9996	-
2018年11月末日	5	-	0.9995	-
2018年12月末日	5	-	0.9995	-
2019年1月末日	5	-	0.9995	-
2019年2月末日	5	-	0.9994	-
2019年3月末日	2	-	0.9993	-
2019年4月末日	2	-	0.9992	-
第15計算期間末 (2019年5月20日)	2	-	0.9991	-
2019年5月末日	2	-	0.9992	-
2019年6月末日	2	-	0.9991	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

#### 分配の推移

該当事項はありません。

#### 収益率の推移

期間	収益率
第1期(2011年11月30日～2012年5月21日)	0.0%
第2期(2012年5月22日～2012年11月19日)	0.0%
第3期(2012年11月20日～2013年5月20日)	0.0%
第4期(2013年5月21日～2013年11月19日)	0.0%
第5期(2013年11月20日～2014年5月19日)	0.0%
第6期(2014年5月20日～2014年11月19日)	0.0%
第7期(2014年11月20日～2015年5月19日)	0.0%
第8期(2015年5月20日～2015年11月19日)	0.0%
第9期(2015年11月20日～2016年5月19日)	0.0%
第10期(2016年5月20日～2016年11月21日)	0.0%
第11期(2016年11月22日～2017年5月19日)	0.0%
第12期(2017年5月20日～2017年11月20日)	0.0%
第13期(2017年11月21日～2018年5月21日)	0.0%
第14期(2018年5月22日～2018年11月19日)	0.0%
第15期(2018年11月20日～2019年5月20日)	0.1%

(注) 収益率 = (当計算期末分配付基準価額 - 前計算期末分配落基準価額) ÷ 前計算期末分配落基準価額 × 100

#### (4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1期(2011年11月30日～2012年5月21日)	5,762,539	0

第2期(2012年5月22日~2012年11月19日)	46,474,208	7,721,318
第3期(2012年11月20日~2013年5月20日)	25,098,343	36,769,329
第4期(2013年5月21日~2013年11月19日)	107,880,652	73,345,831
第5期(2013年11月20日~2014年5月19日)	31,608,971	83,571,849
第6期(2014年5月20日~2014年11月19日)	16,072,533	13,391,017
第7期(2014年11月20日~2015年5月19日)	29,808,729	34,728,865
第8期(2015年5月20日~2015年11月19日)	18,494,045	13,197,298
第9期(2015年11月20日~2016年5月19日)	19,929,975	21,240,634
第10期(2016年5月20日~2016年11月21日)	4,242,051	8,988,214
第11期(2016年11月22日~2017年5月19日)	3,311,739	3,682,013
第12期(2017年5月20日~2017年11月20日)	26,291,744	25,836,711
第13期(2017年11月21日~2018年5月21日)	15,321,550	18,948,120
第14期(2018年5月22日~2018年11月19日)	305,144	4,032,908
第15期(2018年11月20日~2019年5月20日)	73,702	3,191,346

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

(参考)マザーファンドの運用状況

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

(1)投資状況

(2019年6月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
地方債証券	日本	60,202,380	1.59%
特殊債券	日本	1,406,390,820	37.21%
社債券	日本	801,771,300	21.21%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,511,550,304	39.99%
純資産総額		3,779,914,804	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。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2019年6月末現在)

イ.主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	2 政保地方公共団 日本	特殊債券 -	418,000,000	100.96 422,030,456	100.05 418,234,498	1.4000 2019/07/12	11.06%
2	85 政保道路機構 日本	特殊債券 -	320,000,000	101.44 324,627,200	100.13 320,435,840	1.4000 2019/07/31	8.48%
3	100 政保道路機構 日本	特殊債券 -	157,000,000	101.27 159,004,890	101.03 158,617,571	1.4000 2020/02/28	4.20%
4	93 政保道路機構 日本	特殊債券 -	147,000,000	100.91 148,339,170	100.62 147,920,661	1.4000 2019/11/29	3.91%
5	20 政保西日本道 日本	特殊債券 -	110,000,000	101.44 111,589,500	100.12 110,138,930	1.4000 2019/07/29	2.91%
6	10政保地方公共団 日本	特殊債券 -	100,000,000	101.33 101,338,000	101.02 101,022,200	1.3000 2020/03/13	2.67%
7	69 東京急行電鉄 日本	社債券 -	100,000,000	100.91 100,912,000	100.52 100,526,700	1.7000 2019/10/25	2.66%
8	295 北陸電力 日本	社債券 -	100,000,000	100.94 100,942,000	100.32 100,327,500	1.4340 2019/09/25	2.65%
9	22 ホンダファイナンス 日本	社債券 -	100,000,000	100.38 100,382,000	100.22 100,229,000	0.5610 2019/12/20	2.65%
10	44 名古屋鉄道 日本	社債券 -	100,000,000	100.69 100,690,000	100.19 100,194,900	2.0500 2019/08/02	2.65%
11	2 大日本印刷 日本	社債券 -	100,000,000	101.65 101,653,000	100.14 100,145,900	1.7050 2019/07/30	2.65%
12	9 長谷工コ-ポ 日本	社債券 -	100,000,000	100.41 100,419,000	100.12 100,120,100	0.4400 2019/11/05	2.65%
13	164 オリックス 日本	社債券 -	100,000,000	101.05 101,058,000	100.11 100,117,600	1.1460 2019/08/07	2.65%
14	110 三菱地所 日本	社債券 -	100,000,000	100.35 100,353,000	100.10 100,109,600	0.5710 2019/09/13	2.65%
15	10政保地方公共6 日本	特殊債券 -	90,000,000	100.03 90,033,300	100.02 90,026,280	0.3850 2019/07/24	2.38%
16	167 神奈川県公債 日本	地方債証券 -	60,000,000	100.96 60,581,400	100.33 60,202,380	1.5200 2019/09/20	1.59%

17	56 日本政策金融 日本	特殊債券 -	60,000,000	100.00 60,003,600	99.99 59,994,840	0.0010 2019/09/20	1.59%
----	-----------------	-----------	------------	----------------------	---------------------	----------------------	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
特殊債券	37.21%
社債券	21.21%
地方債証券	1.59%
合計	60.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(2019年6月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(2019年6月末現在)

該当事項はありません。

(参考情報)

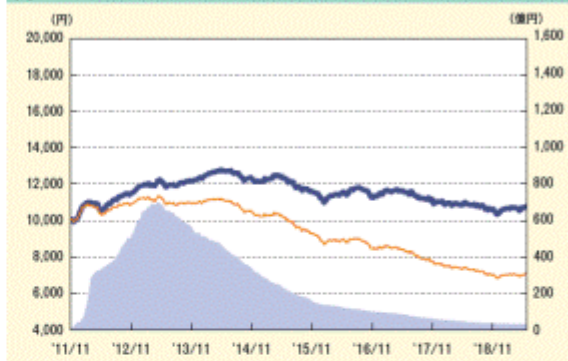
2019年6月28日 現在

基準価額・純資産の推移 (設定日～2019年6月28日)

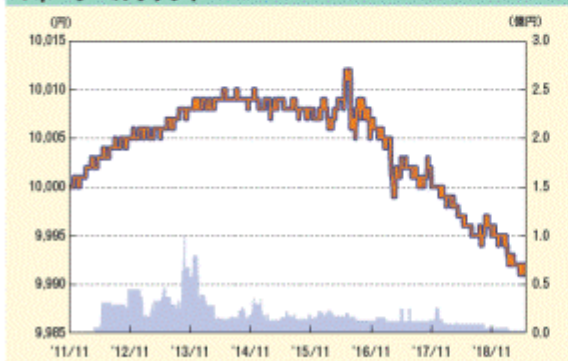
高金利通貨コース



円コース



マネーボールファンド



■ 純資産総額：右目盛  
— 基準価額：左目盛  
— 分配金再投資基準価額：左目盛

\* 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計算しております。

## 分配の推移

	高金利通貨コース	円コース		マネーボールファンド
2019年 6月	35円	10円	2019年 5月	0円
2019年 5月	35円	10円	2018年11月	0円
2019年 4月	35円	10円	2018年 5月	0円
2019年 3月	35円	10円	2017年11月	0円
2019年 2月	35円	10円	2017年 5月	0円
直近1年間累計	560円	200円	設定来累計	0円
設定来累計	8,210円	4,000円		

\*分配金は1万円当たり、税引前

## 主要な資産の状況

### 高金利通貨コース

投資銘柄	投資比率
Global Convertible Bond Fund INR Class	33.7%
Global Convertible Bond Fund BRL Class	33.0%
Global Convertible Bond Fund AUD Class	32.0%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.0%

### 円コース

投資銘柄	投資比率
Global Convertible Bond Fund JPY Class	97.6%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.0%

### マネーボールファンド

投資銘柄	投資比率
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	100.0%

\*投資比率は全て純資産総額対比

## ■ 参考情報(上位10銘柄)

### グローバル・コンバーティブル・ボンド・ファンド

	投資銘柄	国名	クーポン	償還日	業種	投資比率
1	AABAR INVESTMENTS PJSC	アラブ首長国	0.500%	2020/3/27	銀行	4.8%
2	SHIP FINANCE INTL LTD	ノルウェー	5.750%	2021/10/15	エネルギー	4.7%
3	TESLA INC	米国	1.250%	2021/3/1	自動車・自動車部品	3.6%
4	CHINA RAILWAY CONSTRUCT	中国	1.500%	2021/12/21	資本財	3.5%
5	BAGAN CAPITAL LTD	香港	0.000%	2021/9/23	公益事業	3.1%
6	SHANGHAI PORT GROUP BVI	中国	0.000%	2021/8/9	銀行	2.8%
7	HARVEST INTERNATIONAL CO	中国	0.000%	2022/11/21	耐久消費財・アパレル	2.5%
8	CAPITALAND LTD	シンガポール	1.850%	2020/6/19	不動産	2.4%
9	CHINA OVRES FIN KY 5	香港	0.000%	2023/1/5	不動産	2.4%
10	RAG-STIFTUNG	ドイツ	0.000%	2024/10/2	素材	2.3%

\*投資比率はグローバル・コンバーティブル・ボンド・ファンドの純資産総額対比

\*業種は世界産業分類基準(GICS)

### キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

	投資銘柄	種別	投資比率
1	2 政保地方公共団	特殊債券	11.1%
2	85 政保道路機構	特殊債券	8.5%
3	100 政保道路機構	特殊債券	4.2%
4	93 政保道路機構	特殊債券	3.9%
5	20 政保西日本道	特殊債券	2.9%
6	10 政保地方公共団	特殊債券	2.7%
7	69 東京急行電鉄	社債券	2.7%
8	295 北陸電力	社債券	2.7%
9	22 ホンダファイナンス	社債券	2.7%
10	44 名古屋鉄道	社債券	2.7%

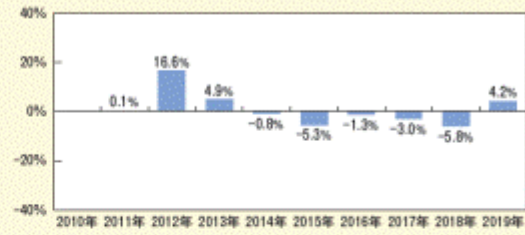
\*投資比率はキャッシュ・マネジメント・マザーファンドの純資産総額対比

## 年間収益率の推移

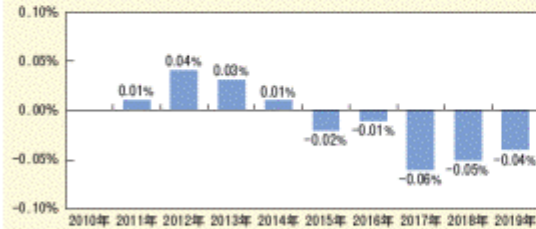
### 高金利通貨コース



### 円コース



### マネーボールファンド



\*ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2011年は当初設定日(2011年11月30日)から年末までの収益率、2019年は6月末までの収益率です。

\*ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

\*ファンドには、ベンチマークはありません。

- ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

[前へ](#)



## 第2【管理及び運営】

### 3 資産管理等の概要

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(5)その他

(以下略)

公告(2019年4月1日現在(予定))

委託会社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。

(以下略)

<訂正後>

(5)その他

(以下略)

公告

委託会社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。

(以下略)

## 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

グローバルCBオープン・高金利通貨コース

グローバルCBオープン・円コース

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、財務諸表に記載されている金額は、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、当特定期間（平成30年11月20日から令和1年5月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

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、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。
2. 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15期計算期間（平成30年11月20日から令和1年5月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)



## 1 財務諸表

## グローバルC Bオープン・高金利通貨コース

## (1) 貸借対照表

区分	前期 平成30年11月19日現在 金額（円）	当期 令和1年5月20日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	10,941,132	-
コール・ローン	27,177,614	32,951,504
投資信託受益証券	1,929,651,162	1,571,820,637
親投資信託受益証券	608,767	608,528
未収入金	5,200,515	-
流動資産合計	1,973,579,190	1,605,380,669
資産合計	1,973,579,190	1,605,380,669
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,592,696	9,301,232
未払解約金	5,325,378	149,998
未払受託者報酬	44,977	37,891
未払委託者報酬	1,709,224	1,440,028
その他未払費用	110,217	89,129
流動負債合計	17,782,492	11,018,278
負債合計	17,782,492	11,018,278
純資産の部		
元本等		
元本	3,026,484,810	2,657,495,135
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,070,688,112	1,063,132,744
（分配準備積立金）	1,958,522,815	1,773,882,979
元本等合計	1,955,796,698	1,594,362,391
純資産合計	1,955,796,698	1,594,362,391
負債純資産合計	1,973,579,190	1,605,380,669

## (2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日 金額（円）	当期 自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	663,648,498	138,561,718
受取利息	108	40
有価証券売買等損益	680,142,034	199,729,079
営業収益合計	16,493,428	61,167,321
営業費用		

支払利息	16,160	9,803
受託者報酬	289,972	234,768
委託者報酬	11,020,515	8,922,810
その他費用	110,999	90,619
営業費用合計	11,437,646	9,258,000
営業利益又は営業損失( )	27,931,074	70,425,321
経常利益又は経常損失( )	27,931,074	70,425,321
当期純利益又は当期純損失( )	27,931,074	70,425,321
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	1,235,381	3,180,204
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,101,224,984	1,070,688,112
剰余金増加額又は欠損金減少額	205,130,504	143,369,304
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	205,130,504	143,369,304
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,421,834	11,167,328
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,421,834	11,167,328
分配金	123,476,105	57,401,491
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,070,688,112	1,063,132,744

[次へ](#)

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。  また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において、確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、当計算期末が休日のため、平成30年11月20日から令和1年5月20日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成30年11月19日現在	令和1年5月20日現在
1. 元本状況		
期首元本額	3,579,814,126円	3,026,484,810円
期中追加設定元本額	72,153,210円	30,269,101円
期中一部解約元本額	625,482,526円	399,258,776円
2. 受益権の総数	3,026,484,810口	2,657,495,135口
3. 元本の欠損	1,070,688,112円	1,063,132,744円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																								
自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日	自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日																																																								
<p>分配金の計算過程</p> <p>第78期計算期間末（平成30年6月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,958,549,396円（1万口当たり8,575.72円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い24,149,407円（1万口当たり70円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>97,728,118円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>1,164,539,640円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,696,281,638円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>2,958,549,396円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,575.72円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>24,149,407円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(70円)</td></tr> </table> <p>第79期計算期間末（平成30年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,887,783,406円（1万口当たり8,801.92円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い22,966,001円（1万口当たり70円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>97,179,807円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>1,112,062,571円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,678,541,028円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>2,887,783,406円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(8,801.92円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	97,728,118円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,164,539,640円	分配準備積立金	1,696,281,638円	分配可能額	2,958,549,396円	（1万口当たり分配可能額）	(8,575.72円)	収益分配金	24,149,407円	（1万口当たり収益分配金）	(70円)	配当等収益（費用控除後）	97,179,807円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,112,062,571円	分配準備積立金	1,678,541,028円	分配可能額	2,887,783,406円	（1万口当たり分配可能額）	(8,801.92円)	<p>分配金の計算過程</p> <p>第84期計算期間末（平成30年12月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,915,123,453円（1万口当たり10,446.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い9,767,019円（1万口当たり35円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>135,997,187円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>975,809,361円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,803,316,905円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>2,915,123,453円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(10,446.31円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>9,767,019円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(35円)</td></tr> </table> <p>第85期計算期間末（平成31年1月21日）に、投資信託約款に基づき計算した2,880,427,583円（1万口当たり10,411.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い9,683,215円（1万口当たり35円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>969,938,934円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>1,910,488,649円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>2,880,427,583円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(10,411.31円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	135,997,187円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	975,809,361円	分配準備積立金	1,803,316,905円	分配可能額	2,915,123,453円	（1万口当たり分配可能額）	(10,446.31円)	収益分配金	9,767,019円	（1万口当たり収益分配金）	(35円)	配当等収益	0円	有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	969,938,934円	分配準備積立金	1,910,488,649円	分配可能額	2,880,427,583円	（1万口当たり分配可能額）	(10,411.31円)
配当等収益（費用控除後）	97,728,118円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	1,164,539,640円																																																								
分配準備積立金	1,696,281,638円																																																								
分配可能額	2,958,549,396円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(8,575.72円)																																																								
収益分配金	24,149,407円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	(70円)																																																								
配当等収益（費用控除後）	97,179,807円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	1,112,062,571円																																																								
分配準備積立金	1,678,541,028円																																																								
分配可能額	2,887,783,406円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(8,801.92円)																																																								
配当等収益（費用控除後）	135,997,187円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	975,809,361円																																																								
分配準備積立金	1,803,316,905円																																																								
分配可能額	2,915,123,453円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(10,446.31円)																																																								
収益分配金	9,767,019円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	(35円)																																																								
配当等収益	0円																																																								
有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																								
収益調整金	969,938,934円																																																								
分配準備積立金	1,910,488,649円																																																								
分配可能額	2,880,427,583円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(10,411.31円)																																																								

収益分配金	22,966,001円
（1万口当たり収益分配金）	（70円）

第80期計算期間末（平成30年8月20日）に、投資信託約款に基づき計算した2,921,743,504円（1万口当たり9,051.63円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い22,595,050円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	103,198,148円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,098,997,010円
分配準備積立金	1,719,548,346円
分配可能額	2,921,743,504円
（1万口当たり分配可能額）	（9,051.63円）
収益分配金	22,595,050円
（1万口当たり収益分配金）	（70円）

第81期計算期間末（平成30年9月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,901,153,460円（1万口当たり9,327.55円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い21,772,141円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	107,594,814円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,063,916,651円
分配準備積立金	1,729,641,995円
分配可能額	2,901,153,460円
（1万口当たり分配可能額）	（9,327.55円）
収益分配金	21,772,141円
（1万口当たり収益分配金）	（70円）

第82期計算期間末（平成30年10月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,946,988,986円（1万口当たり9,639.32円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い21,400,810円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	116,544,448円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,057,803,513円
分配準備積立金	1,772,641,025円
分配可能額	2,946,988,986円
（1万口当たり分配可能額）	（9,639.32円）
収益分配金	21,400,810円
（1万口当たり収益分配金）	（70円）

第83期計算期間末（平成30年11月19日）に、投資信託約款に基づき計算した3,024,650,157円（1万口当たり9,993.94円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い10,592,696円（1万口当たり35円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	128,511,271円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,055,534,646円
分配準備積立金	1,840,604,240円
分配可能額	3,024,650,157円
（1万口当たり分配可能額）	（9,993.94円）
収益分配金	10,592,696円
（1万口当たり収益分配金）	（35円）

収益分配金	9,683,215円
（1万口当たり収益分配金）	（35円）

第86期計算期間末（平成31年2月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,855,846,977円（1万口当たり10,376.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い9,632,965円（1万口当たり35円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	970,655,373円
分配準備積立金	1,885,191,604円
分配可能額	2,855,846,977円
（1万口当たり分配可能額）	（10,376.31円）
収益分配金	9,632,965円
（1万口当たり収益分配金）	（35円）

第87期計算期間末（平成31年3月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,827,213,063円（1万口当たり10,341.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い9,568,655円（1万口当たり35円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	968,504,608円
分配準備積立金	1,858,708,455円
分配可能額	2,827,213,063円
（1万口当たり分配可能額）	（10,341.31円）
収益分配金	9,568,655円
（1万口当たり収益分配金）	（35円）

第88期計算期間末（平成31年4月19日）に、投資信託約款に基づき計算した2,782,234,653円（1万口当たり10,306.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い9,448,405円（1万口当たり35円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後）	0円
収益調整金	958,690,460円
分配準備積立金	1,823,544,193円
分配可能額	2,782,234,653円
（1万口当たり分配可能額）	（10,306.31円）
収益分配金	9,448,405円
（1万口当たり収益分配金）	（35円）

第89期計算期間末（令和1年5月20日）に、投資信託約款に基づき計算した2,729,596,124円（1万口当たり10,271.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い9,301,232円（1万口当たり35円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後）	0円
収益調整金	946,411,913円
分配準備積立金	1,783,184,211円
分配可能額	2,729,596,124円
（1万口当たり分配可能額）	（10,271.31円）
収益分配金	9,301,232円
（1万口当たり収益分配金）	（35円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成30年11月20日 至 令和1年5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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング及びファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理及びコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベル及び頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員及びリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
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、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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 令和1年5月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、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	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

前期（平成30年11月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	-
投資信託受益証券	100,670,341
合計	100,670,341

当期（令和1年5月20日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	60
投資信託受益証券	77,855,477
合計	77,855,537

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成30年11月19日現在）

該当事項はありません。

当期（令和1年5月20日現在）

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

当期（自平成30年11月20日 至 令和1年5月20日）

市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (1口当たり情報)

前期 平成30年11月19日現在	当期 令和1年5月20日現在
1口当たり純資産額 0.6462円 「1口 = 1円(10,000口 = 6,462円)」	1口当たり純資産額 0.5999円 「1口 = 1円(10,000口 = 5,999円)」

## (4) 附属明細表

## 有価証券明細表

## &lt;株式以外の有価証券&gt;

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	Global Convertible Bond Fund AUD Class	1,022,245,047	517,255,993	
	投資信託受益証券	Global Convertible Bond Fund BRL Class	8,413,061,969	512,355,473	
	投資信託受益証券	Global Convertible Bond Fund INR Class	1,054,061,375	542,209,171	
	親投資信託 受益証券	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド	598,533	608,528	
合計		4銘柄	10,489,966,924	1,572,429,165	

[前へ](#) [次へ](#)

## &lt;参考&gt;

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分	平成30年11月19日現在 金額（円）	令和1年5月20日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	264,256,368	-
コール・ローン	656,408,990	1,262,029,160
地方債証券	300,807,700	60,303,660
特殊債券	1,794,349,437	1,843,590,614
社債券	803,667,200	1,102,966,500
未収利息	6,269,726	7,566,356
前払費用	949,062	1,677,645
流動資産合計	3,826,708,483	4,278,133,935
資産合計	3,826,708,483	4,278,133,935
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,002,286	10,070,039
その他未払費用	4,414	-
流動負債合計	7,006,700	10,070,039
負債合計	7,006,700	10,070,039
純資産の部		
元本等		
元本	3,755,424,240	4,197,780,224
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	64,277,543	70,283,672
元本等合計	3,819,701,783	4,268,063,896
純資産合計	3,819,701,783	4,268,063,896
負債純資産合計	3,826,708,483	4,278,133,935

[前へ](#)   [次へ](#)

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年11月19日現在	令和1年5月20日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	4,227,483,512円	3,755,424,240円
期中追加設定元本額	2,524,213,951円	1,996,058,907円
期中一部解約元本額	2,996,273,223円	1,553,702,923円
元本の内訳		
S M B C ファンドラップ・G-REIT	67,642,057円	76,229,410円
S M B C ファンドラップ・ヘッジファンド	268,729,275円	265,573,216円
S M B C ファンドラップ・欧州株	86,707,361円	98,937,259円
S M B C ファンドラップ・新興国株	42,202,543円	63,023,818円
S M B C ファンドラップ・コモディティ	24,631,794円	25,098,764円
S M B C ファンドラップ・米国債	113,329,429円	132,654,870円
S M B C ファンドラップ・欧州債	84,336,738円	67,200,294円
S M B C ファンドラップ・新興国債	50,720,054円	58,168,842円
S M B C ファンドラップ・日本グロース株	151,404,628円	166,218,067円
S M B C ファンドラップ・日本中小型株	36,315,527円	37,669,836円
S M B C ファンドラップ・日本債	984,141,232円	935,060,720円
D C 日本国債プラス	588,182,688円	954,130,649円
エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）	64,113,128円	51,957,325円
エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）	221,395,846円	182,065,325円
エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）	10,294,833円	9,563,328円
エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）	348,003,985円	298,672,016円
エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）	8,917,913円	7,248,550円
エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）	100,237,710円	72,405,037円
エマージング・ボンド・ファンド（マネー・プールファンド）	233,419,702円	357,151,547円
大和住銀 中国株式ファンド（マネー・ポートフォリオ）	57,949,855円	138,128,395円
エマージング好配当株オープン マネー・ポートフォリオ	3,083,869円	3,185,230円
エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）	1,838,022円	1,562,021円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（円コース）	1,737,078円	787,730円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（中国・インド・インドネシア通貨コース）	1,813,140円	649,345円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（BRICs通貨コース）	911,529円	777,374円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（世界6地域通貨コース）	5,932,501円	4,351,761円
米国短期社債戦略ファンド2015-12（為替ヘッジあり）	245,556円	245,556円
米国短期社債戦略ファンド2015-12（為替ヘッジなし）	245,556円	245,556円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（マネー・プールファンド）	38,101,914円	38,100,822円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・アジア3通貨コース	25,232,902円	24,850,843円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・円コース	1,772,287円	1,735,377円
アジア・ハイ・インカム・ファンド（マネー・プールファンド）	4,841,769円	996,733円
日本株厳選ファンド・円コース	270,889円	270,889円
日本株厳選ファンド・ブラジルリアルコース	18,658,181円	18,658,181円
日本株厳選ファンド・豪ドルコース	679,887円	679,887円
日本株厳選ファンド・アジア3通貨コース	9,783円	9,783円
株式&通貨 資源ダブルフォーカス（毎月分配型）	4,007,475円	4,007,475円
日本株225・米ドルコース	49,237円	49,237円



日本株 2 2 5 ・ ブラジルリアルコース	393,895円	393,895円
日本株 2 2 5 ・ 豪ドルコース	147,711円	147,711円
日本株 2 2 5 ・ 資源 3 通貨コース	49,237円	49,237円
グローバル C B オープン ・ 高金利通貨コース	598,533円	598,533円
グローバル C B オープン ・ 円コース	827,757円	827,757円
グローバル C B オープン（マネーボールファンド）	5,059,490円	1,995,361円
オーストラリア高配当株プレミアム（毎月分配型）	1,057,457円	1,057,457円
スマート・ストラテジー・ファンド（毎月決算型）	12,541,581円	12,541,581円
スマート・ストラテジー・ファンド（年 2 回決算型）	4,566,053円	4,566,053円
ボンド・アンド・カレンシー トータルリターン・ファンド（毎月決算型）	14,309円	14,309円
ボンド・アンド・カレンシー トータルリターン・ファンド（年 2 回決算型）	12,837円	12,837円
カナダ高配当株ツイン（毎月分配型）	66,417,109円	66,417,109円
日本株厳選ファンド・米ドルコース	196,696円	196,696円
日本株厳選ファンド・メキシコペソコース	196,696円	196,696円
日本株厳選ファンド・トルコリラコース	196,696円	196,696円
エマージング・ボンド・ファンド・カナダドルコース（毎月分配型）	428,129円	413,811円
エマージング・ボンド・ファンド・メキシコペソコース（毎月分配型）	4,082,464円	3,500,184円
カナダ高配当株ファンド	984円	984円
短期米ドル社債オープン＜為替ヘッジなし＞（毎月分配型）	98,290円	98,290円
短期米ドル社債ファンド2015-06（為替ヘッジあり）	98,242円	-
短期米ドル社債ファンド2015-06（為替ヘッジなし）	98,242円	-
短期米ドル社債オープン＜為替ヘッジあり＞（毎月分配型）	98,242円	98,242円
米国短期社債戦略ファンド2015-10（為替ヘッジあり）	149,304円	149,304円
米国短期社債戦略ファンド2015-10（為替ヘッジなし）	215,194円	215,194円
米国短期社債戦略ファンド2017-03（為替ヘッジあり）	1,751,754円	1,751,754円
世界リアルアセット・バランス（毎月決算型）	1,451,601円	1,451,601円
世界リアルアセット・バランス（資産成長型）	2,567,864円	2,567,864円
合計	3,755,424,240円	4,197,780,224円
2. 受益権の総数	3,755,424,240口	4,197,780,224口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月20日 至 令和 1 年 5 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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング及びファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理及びコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベル及び頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員及びリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
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、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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和 1 年 5 月20日現在

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、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	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成30年11月19日現在)

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額(円)
地方債証券	1,216,600
特殊債証券	4,373,929
社債証券	2,445,200
合計	8,035,729

「計算期間」とは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年7月26日から平成30年11月19日まで)を指しております。

(令和1年5月20日現在)

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額(円)
地方債証券	277,740
特殊債証券	12,363,002
社債証券	4,928,300
合計	17,569,042

「計算期間」とは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年7月26日から令和1年5月20日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成30年11月19日現在)

該当事項はありません。

(令和1年5月20日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成30年11月20日 至 令和1年5月20日)

市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(1口当たり情報)

平成30年11月19日現在	令和1年5月20日現在
1口当たり純資産額 1.0171円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,171円)」	1口当たり純資産額 1.0167円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,167円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

&lt;株式以外の有価証券&gt;

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
円	地方債証券	167 神奈川県公債	60,000,000	60,303,660	
	特殊債証券	7 政保原賠・廃炉	120,000,000	119,999,400	
	特殊債証券	80 政保道路機構	105,000,000	105,049,245	
	特殊債証券	82 政保道路機構	200,000,000	200,333,000	
	特殊債証券	85 政保道路機構	320,000,000	320,917,760	
	特殊債証券	93 政保道路機構	147,000,000	148,136,016	
	特殊債証券	100 政保道路機構	157,000,000	158,794,039	
	特殊債証券	8 政保地方公営機	100,000,000	100,017,000	
	特殊債証券	2 政保地方公共団	418,000,000	418,906,224	
	特殊債証券	10政保地方公共団	100,000,000	101,123,800	
	特殊債証券	56 日本政策金融	60,000,000	59,998,980	
	特殊債証券	20 政保西日本道	110,000,000	110,315,150	
	社債証券	9 長谷工コ-ポ	100,000,000	100,144,100	
	社債証券	2 第一三共	100,000,000	100,165,400	
	社債証券	69 新日本製鐵	100,000,000	100,036,000	

社債券	10 小松製作所	100,000,000	100,017,800	
社債券	2 大日本印刷	100,000,000	100,306,000	
社債券	22 ホンダファイナンス	100,000,000	100,280,100	
社債券	164 オリックス	100,000,000	100,230,200	
社債券	110 三菱地所	100,000,000	100,174,100	
社債券	69 東京急行電鉄	100,000,000	100,713,600	
社債券	44 名古屋鉄道	100,000,000	100,412,300	
社債券	295 北陸電力	100,000,000	100,486,900	
合計 23銘柄		2,997,000,000	3,006,860,774	

[前へ](#) [次へ](#)

## &lt;参考&gt;

当ファンドは、「Global Convertible Bond Fund AUD Class」、「Global Convertible Bond Fund BRL Class」および「Global Convertible Bond Fund INR Class」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「投資信託受益証券」は、この投資信託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。

この投資信託は、2017年11月30日に計算期間が終了し、米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は作成され、現地において独立監査人による財務書類の監査を受けております。

以下の「貸借対照表」、「損益計算書」、「純資産変動計算書」および「有価証券明細表」等は、「Global Convertible Bond Fund」の2017年11月30日現在の財務諸表の原文を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

## 貸借対照表

2017年11月30日現在

(米ドルで表示)

## 資産の部

有価証券（公正価値）（取得原価 USD 98,700,203）	USD	83,304,355
現金		1,879
外国為替予約取引に係る評価益		744,617
未収入金：		
有価証券売却分		121,071
利息		341,203
<b>資産 合計</b>		<b>84,513,125</b>

## 負債の部

外国為替予約取引に係る評価損		267,711
受入証拠金		170,000
カストディアン宛未払い金		71
未払金：		
有価証券購入分		119,235
受益証券買戻分		220,470
未払運用報酬		89,923
専門家報酬		71,823
カストディーフィー		28,711
管理会社報酬		13,541
名義書換代理人報酬		6,665
為替管理報酬		3,279
<b>負債 合計</b>		<b>991,429</b>

## 純資産

	USD	83,521,696
Class A - AUD Class	USD	8,761,951
Class B - BRL Class		9,637,616
Class C - INR Class		9,922,621
Class D - JPY Class		55,199,508
	USD	83,521,696

**発行済み受益証券**

Class A - AUD Class	1,375,570,116
Class B - BRL Class	3,589,880,263
Class C - INR Class	1,516,500,355
Class D - JPY Class	8,762,687,040

**受益証券一口あたりの純資産**

Class A - AUD Class	USD	0.0064
Class B - BRL Class	USD	0.0027
Class C - INR Class	USD	0.0065
Class D - JPY Class	USD	0.0063

**損益計算書(2017年11月30日に終了した年度)****(米ドルで表示)****収益**

受取利息	USD	3,538,442
受取配当金(源泉税 USD (368)控除後)		241,868
<b>収益 合計</b>		<b>3,780,310</b>

**費用**

運用報酬	667,789
専門家報酬	205,795
カストディーフィー	83,456
管理会社報酬	39,863
名義書換代理人報酬	18,548
受託会社報酬	13,015
為替管理報酬	10,771
ファンド設立費用	5,045
その他費用	8,872
<b>費用 合計</b>	<b>1,053,154</b>

**純利益****2,727,156****実現及び未実現(損)益:****実現損:**

有価証券	(1,706,422)
外国為替取引及び外国為替予約取引	(485,496)
<b>実現損 合計</b>	<b>(2,191,918)</b>

**未実現益の変動:**

有価証券	3,217,668
外国為替取引及び外国為替予約取引	1,665,237

未実現益の変動 合計		4,882,905
実現及び未実現益 合計		2,690,987
運用による純資産の増額	USD	5,418,143
純資産変動計算書(2017年11月30日に終了した年度)		(米ドルで表示)
運用による純資産の増(減)額		
純益	USD	2,727,156
実現損		(2,191,918)
未実現益の変動額		4,882,905
運用による純資産の増額		5,418,143
受益者への分配額		(17,777,769)
ファンドの受益証券の取引による純資産の減額		(30,115,476)
純資産の減額		(42,475,102)
純資産		
期首		125,996,798
期末	USD	83,521,696

添付の注記は、本財務諸表の不可欠の部分である。

[前へ](#) [次へ](#)

## 有価証券明細表 (2017年11月30日現在)

額面	銘柄名	公正価値
	固定利付証券 (93.2%)	(USD)
	オーストラリア (3.0%)	
	転換社債券 (3.0%)	
	Paladin Energy, Ltd.	
USD 5,951,000	7.00% due 03/31/20	2,487,518
	<b>転換社債券 計</b>	<b>2,487,518</b>
	<b>オーストラリア 計 (取得原価USD 5,841,223)</b>	<b>2,487,518</b>
	オーストリア (3.2%)	
	転換社債券 (3.2%)	
	Steinhoff Finance Holding GmbH	
EUR 1,700,000	1.25% due 10/21/23	1,710,277
EUR 700,000	4.00% due 01/30/21	944,192
	<b>転換社債券 計</b>	<b>2,654,469</b>
	<b>オーストリア 計 (取得原価USD 2,894,627)</b>	<b>2,654,469</b>
	ベルギー (0.2%)	
	転換社債券 (0.2%)	
	Ablynx NV	
EUR 100,000	3.25% due 05/27/20	185,410
	<b>転換社債券 計</b>	<b>185,410</b>
	<b>ベルギー 計 (取得原価USD 165,116)</b>	<b>185,410</b>

**中国 (8.4%)****転換社債券 (8.4%)**

	China Railway Construction Corp. Ltd.		
CNY 6,000,000	1.50% due 12/21/21		872,222
	China Yangtze Power International BVI 1 Ltd.		
USD 650,000	0.00% due 11/09/21		698,181
	CRRC Corp. Ltd.		
USD 750,000	0.00% due 02/05/21		776,625
	Ctrip.com International, Ltd.		
USD 1,300,000	1.99% due 07/01/25		1,479,562
	Harvest International Co.		
HKD 7,000,000	0.00% due 11/21/22		895,144
	Kunlun Energy Co. Ltd.		
CNH 3,000,000	1.63% due 07/25/19		481,967
	Semiconductor Manufacturing International Corp.		
USD 250,000	0.00% due 07/07/22		319,375
	Shanghai Port Group BVI Holding Co. Ltd.		
USD 858,000	0.00% due 08/09/21		858,429
	Strategic International Group, Ltd.		
EUR 200,000	0.00% due 07/21/22		284,375
	Zhejiang Expressway Co. Ltd.		
EUR 300,000	0.00% due 04/21/22		356,990

**転換社債券 計**

---

**7,022,870**

---

**中国 計 (取得原価USD 7,221,805)**

---

**7,022,870**

---

**フランス (2.8%)****転換社債券 (2.8%)**



		Archer Obligations S.A.	
EUR	300,000	0.00% due 03/31/23	384,533
		Carrefour S.A.	
USD	400,000	0.00% due 06/14/23	367,200
		Cie Generale des Etablissements Michelin	
USD	400,000	0.00% due 01/10/22	431,800
		Elis S.A.	
EUR	257,985	0.00% due 10/06/23	324,510
		Genfit	
EUR	221,023	3.50% due 10/16/22	262,914

額面	銘柄名	公正価値
	<b>固定利付証券 (93.2%) (続き)</b>	(USD)
	<b>フランス (2.8%) (続き)</b>	
	<b>転換社債券 (2.8%) (続き)</b>	
	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	
USD	470,000 0.00% due 02/16/21	580,920
	<b>転換社債券 計</b>	<b>2,351,877</b>
	<b>フランス 計 (取得原価USD 2,340,648)</b>	<b>2,351,877</b>
	<b>ドイツ (3.3%)</b>	
	<b>転換社債券 (3.3%)</b>	
	Deutsche Wohnen SE	
EUR	1,000,000 0.33% due 07/26/24	1,270,449
	Fresenius SE & Co. KGaA	
EUR	900,000 0.00% due 01/31/24	1,070,432

		Symrise AG		
EUR	300,000	0.24% due 06/20/24		405,280
		<b>転換社債券 計</b>		<b>2,746,161</b>
		<b>ドイツ 計 (取得原価USD 2,679,212)</b>		<b>2,746,161</b>
		<b>香港 (3.2%)</b>		
		<b>転換社債券 (3.2%)</b>		
		Bagan Capital, Ltd.		
USD	937,000	0.00% due 09/23/21		995,094
		Baosteel Hong Kong Investment Co. Ltd.		
USD	350,000	0.00% due 12/01/18		369,469
		China Overseas Finance Investment Cayman V, Ltd.		
USD	1,000,000	0.00% due 01/05/23		1,048,500
		PB Issuer No 4 Ltd.		
USD	300,000	3.25% due 07/03/21		298,350
		<b>転換社債券 計</b>		<b>2,711,413</b>
		<b>香港 計 (取得原価USD 2,656,212)</b>		<b>2,711,413</b>
		<b>インド (1.5%)</b>		
		<b>転換社債券 (1.5%)</b>		
		Jaiprakash Power Ventures, Ltd.		
USD	10,250,000	7.00% due 02/13/49 <sup>(a)</sup>		1,273,050
		<b>転換社債券 計</b>		<b>1,273,050</b>
		<b>インド 計 (取得原価USD 11,339,052)</b>		<b>1,273,050</b>
		<b>イタリア (0.4%)</b>		

**転換社債券 (0.4%)**

		Snam SpA	
EUR	300,000	0.00% due 03/20/22	375,769

**転換社債券 計****375,769****イタリア 計 (取得原価USD 369,130)****375,769****日本 (10.8%)****転換社債券 (9.7%)**

		AEON Financial Service Co. Ltd.	
JPY	20,000,000	0.00% due 09/13/19	195,791
		ANA Holdings, Inc.	
JPY	90,000,000	0.00% due 09/19/24	856,530
		Ezaki Glico Co. Ltd.	
JPY	20,000,000	0.00% due 01/30/24	189,446
		Gunma Bank, Ltd.	
USD	300,000	0.00% due 10/11/19	312,375
		Kansai Paint Co. Ltd.	
JPY	100,000,000	0.00% due 06/17/22	993,030
		Kyushu Electric Power Co., Inc.	
JPY	100,000,000	0.00% due 03/31/22	946,115
		Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	
JPY	120,000,000	0.00% due 03/29/24	1,229,168
		Mitsui OSK Lines, Ltd.	
USD	500,000	0.00% due 04/24/20	482,938
		SBI Holdings, Inc.	
JPY	20,000,000	0.00% due 09/14/22	221,393

**額面 銘柄名****公正価値**

## 固定利付証券 (93.2%) (続き)

(USD)

## 日本 (10.8%) (続き)

## 転換社債券 (9.7%) (続き)

Sony Corp.

JPY 80,000,000 0.00% due 09/30/22 893,615

Terumo Corp.

JPY 80,000,000 0.00% due 12/06/21 1,013,181

Yamaguchi Financial Group, Inc.

USD 700,000 0.83% due 03/26/20 <sup>(b)</sup> 734,300

## 転換社債券 計

8,067,882

## 社債券 (1.1%)

Kawasaki Kisen Kaisha, Ltd.

100,000,000 0.00% due 09/26/18 925,785

## 社債券 計

925,785

## 日本 計 (取得原価USD 8,767,412)

8,993,667

## ルクセンブルグ(0.6%)

## 社債券 (0.6%)

Oryx S.A.

USD 500,000 2.92% due 09/11/18 <sup>(b)</sup> 500,800

## 社債券 計

500,800

## ルクセンブルグ 計 (取得原価USD 492,911)

500,800

## マレーシア (2.1%)

## 転換社債券 (2.1%)

		Cahaya Capital, Ltd.	
USD	1,115,000	0.00% due 09/18/21	1,109,565
		Indah Capital, Ltd.	
SGD	850,000	0.00% due 10/24/18	651,698
		<b>転換社債券 計</b>	<b>1,761,263</b>
		<b>マレーシア 計 (取得原価USD 1,744,546)</b>	<b>1,761,263</b>
		<b>オランダ (2.6%)</b>	
		<b>転換社債券 (2.6%)</b>	
		Ichor Coal NV	
EUR	4,100,000	5.00% due 06/07/19	2,130,223
		<b>転換社債券 計</b>	<b>2,130,223</b>
		<b>オランダ 計 (取得原価USD 5,802,191)</b>	<b>2,130,223</b>
		<b>ノルウェー (4.8%)</b>	
		<b>転換社債券 (4.8%)</b>	
		Marine Harvest ASA	
EUR	500,000	0.13% due 11/05/20	698,031
		Ship Finance International, Ltd.	
USD	3,100,000	5.75% due 10/15/21	3,307,313
		<b>転換社債券 計</b>	<b>4,005,344</b>
		<b>ノルウェー 計 (取得原価USD 3,828,746)</b>	<b>4,005,344</b>
		<b>フィリピン (1.0%)</b>	
		<b>転換社債券 (1.0%)</b>	
		AYC Finance, Ltd.	
USD	750,000	0.50% due 05/02/19	822,187

<b>転換社債券 計</b>	<b>822,187</b>
----------------	----------------

フィリピン (取得原価USD 825,938)	822,187
-------------------------	---------

シンガポール (2.9%)

転換社債券 (2.9%)

CapitalLand, Ltd.

SGD	2,000,000	1.85% due 06/19/20	1,469,191
-----	-----------	--------------------	-----------

Suntec Real Estate Investment Trust

SGD	500,000	1.75% due 09/05/21	381,403
-----	---------	--------------------	---------

SGD	750,000	1.75% due 11/30/24	555,050
-----	---------	--------------------	---------

<b>転換社債券 計</b>	<b>2,405,644</b>
----------------	------------------

シンガポール 計 (取得原価USD 2,489,494)	2,405,644
------------------------------	-----------

額面	銘柄名	公正価値
----	-----	------

固定利付証券 (93.2%) (続き)	(USD)
---------------------	-------

南アフリカ (0.3%)

転換社債券 (0.3%)

Remgro Jersey GBP, Ltd.

GBP	200,000	2.63% due 03/22/21	263,244
-----	---------	--------------------	---------

<b>転換社債券 計</b>	<b>263,244</b>
----------------	----------------

南アフリカ 計 (取得原価USD 265,442)	263,244
---------------------------	---------

スペイン (0.6%)

転換社債券 (0.6%)

	Telefonica Participaciones SAU		
EUR	400,000	0.00% due 03/09/21	475,185
	<b>転換社債券 計</b>		<b>475,185</b>
	<b>スペイン 計 (取得原価USD 471,331)</b>		<b>475,185</b>
	<b>スウェーデン (0.4%)</b>		
	<b>転換社債券 (0.4%)</b>		
	Recipharm AB		
SEK	3,000,000	2.75% due 10/06/21	344,315
	<b>転換社債券 計</b>		<b>344,315</b>
	<b>スウェーデン 計 (取得原価USD 358,942)</b>		<b>344,315</b>
	<b>台湾 (3.1%)</b>		
	<b>転換社債券 (3.1%)</b>		
	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.		
USD	400,000	0.00% due 11/06/22	406,000
	TPK Holding Co., Ltd.		
USD	500,000	0.00% due 04/08/20	516,562
	United Microelectronics Corp.		
USD	1,000,000	0.00% due 05/18/20	1,112,500
	Zhen Ding Technology Holding, Ltd.		
USD	500,000	0.00% due 06/26/19	523,250
	<b>転換社債券 計</b>		<b>2,558,312</b>
	<b>台湾 計 (取得原価USD 2,558,875)</b>		<b>2,558,312</b>
	<b>アラブ首長国連邦 (6.2%)</b>		

**転換社債券 (6.2%)**

	Aabar Investments PJSC		
EUR 3,800,000	0.50% due 03/27/20		4,158,544

	DP World, Ltd.		
USD 1,000,000	1.75% due 06/19/24		1,047,500

**転換社債券 計****5,206,044****アラブ首長国連邦 計 (取得原価USD 4,386,086)****5,206,044****イギリス (12.5%)****転換社債券 (12.5%)**

	BP Capital Markets PLC		
GBP 500,000	1.00% due 04/28/23		807,114

	Helical Bar Jersey, Ltd.		
GBP 2,000,000	4.00% due 06/17/19		2,705,946

	Intu Jersey 2, Ltd.		
GBP 300,000	2.88% due 11/01/22		379,699

	J Sainsbury PLC		
GBP 3,000,000	2.88% due 12/29/49 <sup>(c)</sup> , <sup>(d)</sup> , <sup>(e)</sup>		4,097,160

	Premier Oil Finance Jersey, Ltd.		
USD 2,400,000	2.50% due 05/31/22		2,439,048

**転換社債券 計****10,428,967****イギリス 計 (取得原価USD 9,810,216)****10,428,967****アメリカ (19.3%)****転換社債券 (18.9%)**

	BioMarin Pharmaceutical, Inc.		
USD 400,000	0.60% due 08/01/24		390,500



		Blackhawk Network Holdings, Inc.	
USD	650,000	1.50% due 01/15/22	675,594

		DISH Network Corp.	
USD	2,800,000	3.38% due 08/15/26	3,134,250

額面	銘柄名	公正価値
----	-----	------

	<b>固定利付証券 (93.2%) (続き)</b>	( USD )
--	----------------------------	---------

	<b>アメリカ (19.3%) (続き)</b>	
--	--------------------------	--

	<b>転換社債券 (18.9%) (続き)</b>	
--	---------------------------	--

		Dycom Industries, Inc.	
USD	300,000	0.75% due 09/15/21	388,125

		Finisar Corp.	
USD	300,000	0.50% due 12/15/33 <sup>(c)</sup>	303,375

		FireEye, Inc.	
USD	2,000,000	1.63% due 06/01/35 <sup>(c)</sup>	1,861,250

		Herbalife, Ltd.	
USD	750,000	2.00% due 08/15/19	763,125

		Nuance Communications, Inc.	
USD	450,000	1.00% due 12/15/35 <sup>(c)</sup>	424,687

		NuVasive, Inc.	
USD	450,000	2.25% due 03/15/21	523,969

		ON Semiconductor Corp.	
USD	1,350,000	1.00% due 12/01/20	1,675,687

		Pattern Energy Group, Inc.	
USD	500,000	4.00% due 07/15/20	513,437

		Proofpoint, Inc.	
--	--	------------------	--

USD	200,000	0.75% due 06/15/20	253,375
-----	---------	--------------------	---------

salesforce.com, Inc.

USD	250,000	0.25% due 04/01/18	391,563
-----	---------	--------------------	---------

ServiceNow, Inc.

USD	200,000	0.00% due 11/01/18	334,500
-----	---------	--------------------	---------

Starwood Property Trust, Inc.

USD	800,000	4.38% due 04/01/23 <sup>(c)</sup>	818,000
-----	---------	-----------------------------------	---------

Tesla, Inc.

USD	1,900,000	2.38% due 03/15/22	2,208,750
-----	-----------	--------------------	-----------

Viavi Solutions, Inc.

USD	650,000	0.63% due 08/15/33 <sup>(c)</sup>	684,125
-----	---------	-----------------------------------	---------

Wright Medical Group, Inc.

USD	400,000	2.00% due 02/15/20	422,500
-----	---------	--------------------	---------

**転換社債券 計**

**15,766,812**

**アメリカ 計 (取得原価USD 15,561,759)**

**15,766,812**

**固定利付証券 計 (取得原価USD 92,870,914)**

**77,470,544**

**株数 優先株式 (0.4%)**

**アメリカ (0.4%)**

Crown Castle International Corp.

USD	340	6.88% due 08/01/20	393,309
-----	-----	--------------------	---------

**アメリカ 計 (取得原価USD 367,540)**

**393,309**

**優先株式 計 (取得原価USD 367,540)**

**393,309**

**契約数 ドイツ (0.1%)**

**買建オプション (0.1%)**

75 Call - Euro Stoxx 50 Index

Exercise price \$3,550, Expiration date 12/15/2017

43,193

**買建オプション 計 (取得原価USD 82,100)**

**43,193**

ドイツ 計 (取得原価USD 82,100)

43,193

**額面 短期投資 (6.4%)****フランス (1.3%)****定期預金 (1.3%)**

BNP Paribas

EUR 570,822

570,822 (0.57)% due 12/01/17

680,620

SGD 522,719 0.35% due 12/01/17

388,061

**定期預金 計****1,068,681****フランス 計 (取得原価USD 1,055,714)****1,068,681****ケイマン諸島 (0.0%)****定期預金 (0.0%)**

Brown Brothers Harriman &amp; Co.

HKD 303,000

303,000 0.07% due 12/01/17

38,796

**額面 銘柄名 純資産比率(%) 公正価値**

(USD)

**ケイマン諸島 (0.0%) (続き)****定期預金 (0.0%) (続き)**

ZAR 4 5.30% due 12/01/17

0\*

**定期預金 計****38,796****ケイマン諸島 計 (取得原価USD 38,793)****38,796****日本 (0.0%)****定期預金 (0.0%)**

Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.

JPY

3,076,224 3,076, (0.23)% due 12/01/17

27,490

**定期預金 計****27,490**

日本 計 (取得原価USD 27,490)			27,490
スウェーデン (0.3%)			
定期預金 (0.3%)			
Skandinaviska Enskilda Banken AB			
SEK	321,696	(0.92)% due 12/01/17	38,601
GBP	152,841	0.16% due 12/01/17	206,893
スウェーデン 計 (取得原価USD 240,804)			245,494
イギリス (4.8%)			
定期預金 (4.8%)			
Barclays Bank PLC			
USD	4,016,848	0.60% due 12/01/17	4,016,848
定期預金 計			4,016,848
イギリス 計 (取得原価USD 4,016,848)			4,016,848
短期投資 計 (取得原価USD 5,379,649)			5,397,309
投資 計 (取得原価USD 98,700,203)		99.7	83,304,355
現金及びその他資産（負債控除後）		0.3	217,341
純資産		100.0%	83,521,696

- (a) この証券はデフォルトしている。  
(b) 変動利付き証券：2017年11月30日現在  
(c) コーラブル証券  
(d) 可変利付き証券：2017年11月30日現在  
(e) 永久債  
\*\* 残高1ドル未満

## ファンドレベル:外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
EUR	Citibank N.A.	380,000	12/14/2017	USD	450,686	2,679	-	2,679
JPY	Citibank N.A.	5,000,000	12/14/2017	USD	44,176	527	-	527
SGD	Citibank N.A.	5,000,000	12/14/2017	USD	3,687,441	24,729	-	24,729
SGD	Citibank N.A.	3,000,000	12/14/2017	USD	2,211,644	15,658	-	15,658

USD	Barclays Bank Plc	131,415	12/14/2017	JPY	14,200,000	4,460	-	4,460
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	407,919	12/14/2017	EUR	350,000	-	(9,655)	(9,655)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	942,771	12/14/2017	EUR	800,000	-	(11,681)	(11,681)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	180,675	12/14/2017	GBP	136,000	-	(3,480)	(3,480)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	237,133	12/14/2017	EUR	200,000	-	(1,480)	(1,480)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	2,948,173	12/14/2017	EUR	2,500,000	-	(34,491)	(34,491)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	329,817	12/14/2017	GBP	250,000	-	(8,704)	(8,704)
	Brown Brothers Harriman &							
USD	Co.	400,688	12/14/2017	JPY	45,000,000	-	(1,633)	(1,633)
USD	Citibank N.A.	5,805,035	12/14/2017	JPY	650,000,000	-	(6,262)	(6,262)
USD	JPMorgan Chase Bank N.A.	9,304,397	12/14/2017	SGD	12,481,000	38,078	-	38,078
USD	Morgan Stanley	7,821,803	12/14/2017	GBP	5,913,000	-	(184,892)	(184,892)
USD	Morgan Stanley	978,017	12/14/2017	JPY	110,000,000	-	(5,433)	(5,433)
USD	State Street Corp.	11,739,158	12/14/2017	EUR	9,727,000	134,211	-	134,211
USD	State Street Corp.	400,115	12/14/2017	SEK	3,250,000	9,875	-	9,875
						230,217	(267,711)	(37,494)

## Class A- AUD Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
AUD	Citibank N.A.	11,587,814	12/15/2017	USD	8,743,725	52,590	-	52,590

## Class B- BRL Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
BRL	Citibank N.A.	31,459,148	12/15/2017	USD	9,575,925	37,732	-	37,732

## Class C- INR Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益 (USD)	評価(損) (USD)	評価(損)益 (USD)
INR	Citibank N.A.	644,441,109	12/15/2017	USD	9,891,640	89,422	-	89,422

## Class D- JPY Class : 外国為替予約取引 2017年11月30日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益
						(USD)	(USD)	(USD)
JPY	Citibank N.A.	6,171,558,232	12/15/2017	USD	54,845,660	334,656	-	334,656

## デリバティブ取引の価値

以下の表は本ファンドのデリバティブ取引の要約である。

取引相手方	デリバティブ	デリバティブ	担保受取*	担保差入	純額**
	資産の価値 (USD)	負債の価値 (USD)			
<b>店頭デリバティブ</b>					
<b>外国為替予約取引</b>					
Barclays Bank Plc	4,460	-	-	-	4,460
Brown Brothers Harriman & Co.	-	(71,124)	-	-	(71,124)
Citibank N.A.	557,993	(6,262)	(170,000)	-	381,731
JPMorgan Chase Bank N.A.	38,078	-	-	-	38,078
Morgan Stanley	-	(190,325)	-	-	(190,325)
<b>マスター・ネットिंग契約に</b>					
<b>基づくデリバティブ取引 計</b>					
	<b>600,531</b>	<b>(267,711)</b>	<b>(170,000)</b>	<b>-</b>	<b>162,820</b>
State Street Corp.	144,086	-			
<b>マスター・ネットिंग契約に</b>					
<b>基づかないデリバティブ取引 計</b>					
	<b>144,086</b>	<b>-</b>			
<b>デリバティブ取引 計</b>					
	<b>744,617</b>	<b>(267,711)</b>			

\*実際の担保は上記の表に開示されたものよりも多い場合がある。

\*\*純額は、デフォルトが発生した場合に取引先から(または取引先に)生じる受取り(または支払い)の額をあらわしている。純額は、同一の法人格に対する同一の契約に基づく取引に関して損益を通算することが認められている。

**通貨:**

AUD - オーストラリアドル

BRL - ブラジルリアル

EUR - ユーロ

GBP - イギリスポンド

HKD - 香港ドル

INR - インドルピー

JPY - 日本円

SEK - スウェーデンクローネ

SGD - シンガポールドル

USD - 米ドル

ZAR - 南アフリカランド

[前へ](#) [次へ](#)

## 財務諸表に関する注記（抜粋）

2017年11月30日現在

### 重要な会計方針

本ファンドの財務諸表は、2016年12月1日からファンドの計算期間末日である2017年11月30日までの期間を反映したもので、計算期間末日は11月の最終営業日（営業日とは、ニューヨーク証券取引所ならびにニューヨークの銀行が通常の業務を行っている日）である。

以下は、本ファンドが米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（「米国GAAP」）に準拠して、その財務諸表を作成するにあたって継続して適用している重要な会計方針の要約である。米国GAAPに準拠した財務諸表を作成するにあたって、経営陣は、財務諸表の報告額及び開示事項に影響する予想及び仮定を設定する必要がある。このような予想と実績は異なる可能性がある。

#### (A) 受益証券の純資産額の決定

本ファンドの純資産額（以下、純資産額）は、毎営業日及び受託会社が決定するその他の時点（以下、それぞれの計算日）において計算される。本ファンドの純資産額は、管理会社報酬、弁護士報酬、監査報酬並びにその他の専門家報酬及び費用等を含み、本ファンドの資産及び負債の全額を考慮して計算される。

本ファンドの各クラスに関する純資産額は、日本円で計算され、本ファンドの機能通貨である米ドルに換算される。日本円で表示される一口当たりの純資産額は、通常毎営業日に計算され、一口当たりの純資産の数値は小数点以下第4位までとなるよう調整される。

#### (B) 有価証券の評価

純資産額を計算する目的上、市場の公表価格が容易に入手できる有価証券及びその他の資産は、公正価値で計上される。公正価値は通常、直前に報告された売却価格、または売却価格が報告されない場合には、相場報告システムもしくは主要なマーケット・メーカーまたは価格提供サービスから取得する価格を基に決定される。

国内外の固定利付証券及び非上場デリバティブ取引は、通常、主要なマーケット・メーカーまたは価格提供サービスから得られる価格に基づいて評価される。独立した価格提供サービスから得られる価格は、マーケット・メーカーが提供する情報、または類似した性質を持つ投資もしくは有価証券に関する利回りのデータから取得した市場価値の推計値を利用している。特定の遅延引渡基準で購入した固定利付証券は、決済日に決済されるまで毎日値洗いされる。満期までの残存期間が60日以内の短期投資は、公正価値に近似する償却原価で評価される。上場オプション、先物取引及び先物オプションは、関連する取引所が決定する清算価格で評価される。

スワップは、可能な限り第三者機関から提供される価格またはマーケット・メーカーによる価格に基づき日々時価評価され、価格に変動があった場合には損益計算書上に未実現損益として計上される。市場価格が容易に入手できないまたは信頼性がないと見なされる場合には、スワップ契約は運用会社の定める指針に従い、別の有価証券あるいは指数を参照して評価することがある。市場価格が容易に入手できず、上記の評価方法を用いて評価できない場合、当該スワップの価値は、運用会社の提供する助言を基に、受託会社が誠実に決定する。計算期間の期首における受取額または支払額は、貸借対照表の該当項目に計上される。これらの前払金は、スワップの解約時または満期日に損益計算書に実現損益として計上される。スワップ解約時の受取清算金または支払清算金は、損益計算書に実現損益として計上される。本ファンドで発生する定期的な受取りまたは支払いは、損益計算書の実現損益に含まれる。スワップ契約には、貸借対照表上で認識できる以上の信用リスク、市場リスクまたドキュメンテーション・リスクといったリスクが場合に依りて存在する。これらには、スワップ市場に



流動性がないリスク、契約の取引相手方が債務を履行しないあるいは契約条件の解釈が相違するリスク、金利が不利に変動するリスクが含まれる。

市場の公表価格が容易に入手できない有価証券及びその他の資産は、運用会社の提供する助言を基に受託会社が誠実に決定した公正価値で評価する。

最新の市場データまたは信頼性の高い市場データ（売買情報、ビットアスク情報、ブローカー価格など）がない状況では、市場の公表価格は容易に入手できないとみなされる。こうした状況には、関連市場の終了後に本ファンドの有価証券やその他の資産の価値に重大な影響を及ぼすような事象が発生する場合も含まれる。さらに、非常の事態により証券取引所もしくは有価証券取引市場が終日開かれず、他の市場価格も入手できないような場合も、市場の公表価格は容易に入手できないとみなされる。

ブラウン・ブラザーズ・ハリマン社（アドミニストレーター）は、本ファンドの有価証券やその他の資産の価値に重大な影響を及ぼす可能性がある重要事象の監視、及びそうした重要事象が有価証券やその他の資産の価値に影響し、資産の再評価が必要かどうかの判断の責任を負う。

本ファンドが公正価値を用いて純資産額を決定する際、有価証券がその主要な取引市場の公表価格で評価されるのではなく、運用会社の提供する助言、あるいはその指示により行動する者が公正価値を正確に反映していると考えられる方法により算出される価額に基づき受託会社により評価される場合がある。公正価値の評価には、有価証券の価値に関する主観的な判断を要することがある。

本ファンドの方針は、算出した本ファンドの純資産額が価格決定時点の有価証券の価値を適正に反映することを目指している。しかし、受託会社と運用会社またはその指示により行動する者が決定した公正価値が、価格決定時点で当該有価証券を売却した場合に本ファンドが得る価格を正確に反映することは保証できない（例えば、強制処分または清算処分の場合など）。本ファンドが用いる価格は有価証券を売却した場合に実現されるであろう価値とは異なる場合があり、そうした相違は財務諸表に重大な影響を及ぼし得る。

#### < 公正価値測定 >

米国GAAPに基づく公正価値測定及び開示事項に関する当局の指針に従い、本ファンドは、公正価値の測定に用いられる評価技法に関するインプットに優先順位を付けており、それに基づき、その投資の公正価値を開示している。分類において、優先順位が最も高いのは、活発な市場で同一資産または負債に対する未調整の公表価格に基づく評価（レベル1）で、優先順位が最も低いのは、その評価にとって重大な、観察不可能なインプットに基づく評価（レベル3）である。当該指針は、公正価値の分類に次の3レベルを設定している。

- ・ レベル1： 活発な市場における同一の資産または負債に係る（未調整の）公表価格に基づき測定した公正価値。
- ・ レベル2： 資産または負債に係る直接的に（例えば、価格）または間接的に（例えば、価格から派生）観察可能なインプットのうち、レベル1に含まれる公表価格以外のインプットに基づき測定した公正価値。
- ・ レベル3： 観察可能な市場データに基づかない資産または負債に係るインプット（観察不可能なインプット）に基づき測定した公正価値。

インプットは、様々な評価技法を適用する際に用いられ、また、リスクに対する仮定を含む、市場参加者が評価を決定するにあたって用いる様々な仮定を幅広く参照している。インプットには、価格情報、特定および広範な信用データ、流動性に関する統計値、及びその他の要素などが含まれる場合がある。

公正価値の分類内での金融商品のレベルは、公正価値測定にとって極めて重要なインプットの最も低いレベルに基づいている。しかし、何をもち「観察可能」と判定するのには、運用会社による重要な判断が必要となる。運用会社は、容易に入手でき、定期的に配布または更新され、信頼性が高く検証可能で、独占的なものではなく、関連する市場に積極的に関与している独立した情報源によって提供されている市場データを観察可能なデータとみなしている。ある金融商品に関する分類は、その価格決定の透明性に基づくもので、当該商品に対する運用会社の認識したリスクとは必ずしも一致しない。

### <投資>

公正価値が活発な市場の公表価格に基づいているためレベル1に分類される有価証券には、上場株式及び金融市場証券が含まれている。本ファンドがそのような商品を大量に保有し、売却すると取引価格に影響を与え得ると合理的に判断できる状況においても、当該商品の公表価格は調整しない。

活発でない市場で取引されているものの、市場の公表価格、ディーラーの呼び値、または観察可能なインプットに基づくその他の価格情報源に基づいて評価されている投資はレベル2に分類される。これらには、政府債、地方債、社債、転換社債型新株予約権付社債及び優先証券が含まれる。レベル2の有価証券は、活発な市場で取引されていない、または譲渡制限の対象となっているポジションを含むため、その評価は一般的に入手可能な市場情報に基づいた非流動性または非譲渡性を反映するように調整される。

レベル3に分類される金融資産は、取引頻度が低いため、観察不可能なインプットしか有しないことが顕著である。レベル3の金融資産には、プライベートエクイティーや一部の社債が含まれる。

内在的な評価価格の不確実性から、財務諸表に記載されている価値と、当該資産を売却することで得られる金額は大きく乖離する可能性がある。

### <デリバティブ取引>

本ファンドは、ヘッジ目的で、デリバティブ取引を利用する場合がある。ヘッジ取引は、本ファンドが、デリバティブ取引を用いて、他の保有有価証券に関連するリスクを相殺する一つの戦略である。ヘッジ取引は損失を減少させることができるが、一方で市場が本ファンドによって予想された方向と異なる方向に動く、あるいはデリバティブ取引のコストがヘッジ取引による利益を上回ると収益を減少させ、または損失を生じさせる場合がある。

また、ヘッジ取引は、デリバティブ取引の価値の変動が、予想したほどにヘッジ対象有価証券の価値の変動に連動しないリスクがある。その場合、ヘッジされている保有有価証券の損失は減少せず、増加するかもしれない。

本ファンドのヘッジ戦略がリスクを減らす、もしくはヘッジ取引が利用可能である、あるいは、コストに見合う効果が得られるという保証はない。本ファンドにはヘッジ取引を用いる義務はなく、ヘッジ取引を用いない選択もできる。本ファンドがデリバティブ取引に投資すると、投資元本金額を超える損失を被る場合がある。また、適切なデリバティブ取引があらゆる環境で利用できるとは限らず、本ファンドが他のリスクへのエクスポージャーを減らすために効果があると思われる場合でも、その取引を利用できるという保証はない。

デリバティブ取引は、証券取引所、または店頭取引で当事者間の交渉により取引されることがある。先物取引や上場オプション取引などの取引所上場デリバティブ取引は、活発に取引されているとみなされるか否かに応じて、通常では公正価値のレベル1またはレベル2に分類される。

外国為替予約取引及びスワップを含む店頭デリバティブ取引については、取引相手先、ディーラーまたはブローカーから受領する価格等、観察可能なインプットを入手でき、それらが信頼できるとみなされた場合には、それらを用いて評価する。モデルが使われている場合は、店頭デリバティブ取引の価値は、商品の契約条件や特定の固有リスク、さらには観察可能なインプットの入手可能性や信頼性に依存する。そのようなインプットとしては、参照する有価証券の市場価格、イールドカーブ、クレジットカーブ、ボラティリティ指標、期限前償還率及びそれぞれのインプットの相関関係などが挙げられる。

一般的な外国為替予約取引及びスワップのような一部の店頭デリバティブ取引は、インプットが通常は市場データで確認できるため、レベル2に分類される。

インプットが観察不可能な店頭デリバティブ取引は、レベル3に分類される。こうした店頭デリバティブ取引の評価は、レベル1またはレベル2のインプットを一部で利用していても、公正価値の決定に重要とみなされる観察不可能なその他のインプットも含んでいるからである。

次の表は、2017年11月30日現在の貸借対照表に計上された金融商品を、項目別及び公正価値をレベル別に表示したものである。\*

(未調整)				
資産	活発な市場における同一の 投資に係る公表価格を 反映したインプット (Level 1) (USD)	重要なその他 の観察可能な インプット (Level 2) (USD)	重要な観察 不可能な インプット (Level 3) (USD)	2017年11月30日 時点での公正価値 (USD)
<b>転換社債</b>				
Australia	-	2,487,518	-	2,487,518
Austria	-	2,654,469	-	2,654,469
Belgium	-	185,410	-	185,410
China	-	7,022,870	-	7,022,870
France	-	2,351,877	-	2,351,877
Germany	-	2,746,161	-	2,746,161
Hong Kong	-	2,711,413	-	2,711,413
India	-	1,273,050	-	1,273,050
Italy	-	375,769	-	375,769
Japan	-	8,067,882	-	8,067,882
Malaysia	-	1,761,263	-	1,761,263
Netherlands	-	2,130,223	-	2,130,223
Norway	-	4,005,344	-	4,005,344
Philippines	-	822,187	-	822,187
Singapore	-	2,405,644	-	2,405,644
South Africa	-	263,244	-	263,244
Spain	-	475,185	-	475,185
Sweden	-	344,315	-	344,315
Taiwan	-	2,558,312	-	2,558,312
United Arab Emirates	-	5,206,044	-	5,206,044

United Kingdom	-	10,428,967	-	10,428,967
United States	-	15,766,812	-	15,766,812
<b>社債券</b>				
Japan	-	925,785	-	925,785
Luxembourg	-	500,800	-	500,800
<b>優先株式</b>				
United States	-	393,309	-	393,309
<b>買建オプション</b>				
Germany	43,193	-	-	43,193
<b>短期投資</b>				
Time Deposits	5,397,309	-	-	5,397,309
<b>投資 計</b>	<b>5,440,502</b>	<b>77,863,853</b>	<b>-</b>	<b>83,304,355</b>

**金融デリバティブ取引\*\*****資産**

外国為替予約取引	-	744,617	-	744,617
----------	---	---------	---	---------

**負債**

外国為替予約取引	-	(267,711)	-	(267,711)
----------	---	-----------	---	-----------

\*分類についての詳細情報は、有価証券明細表を参照。

\*\*外国為替予約取引のような金融デリバティブ商品は、未実現損益で評価している。

2017年11月30日に終了した期間において、1,273,050米ドルで評価された証券がレベル3からレベル2に異動した。

以下の表は、2017年11月30日に終了した年度におけるレベル3に分類された投資の異動を表している。

有価証券	2016年11月30		未実現（損）益 の変動(USD)	2017年11 月30日現		レベル3から レベル2への異動 (USD)	在の 残高 (USD)
	日現在の 残高(USD)	実現（損）益 (USD)		購入(USD)	売却(USD)		
転換社債	4,048,750 <sup>1</sup>	-	(2,775,700)	-	- <sup>2</sup>	(1,273,050)	-
<b>有価証券</b>							
<b>券 計</b>	<b>4,048,750</b>	<b>-</b>	<b>(2,775,700)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1,273,050)</b>	<b>-</b>

レベル3証券は、ブローカーの引き合いに基づいて評価された社債券である。

<sup>1</sup> レベル3に分類されたゼロ評価証券を含む。

<sup>2</sup> 公正価値ゼロの有価証券を含む。

**(C) 有価証券の取引及び収益**

有価証券取引は、財務報告の目的上、約定日基準で計上される。有価証券の売却に係る実現損益は、個別原価法で計上されている。分配金は配当落ち日に計上される。受取利息は、割引による増価及びプレミアムの償却を調整し、発生主義で計上される。収益は外国税控除後の純額で計上される。回収が見込めない証券のクーポン収入は計上されない。有価証券のプレミアム及びディスカウントは、実効利回りベースで償却/増価される。

#### (D) 分配方針

本ファンドは、受益者決議または受託会社の裁量によって、分配金(現金または現物による)の支払いを公表し実行する。本ファンドは、受益者に対して毎月分配することを目指す。

本ファンドは、当該月の分配日直前の営業日、または受託会社が単独の裁量で決定するその他の日(「基準日」)に当該分配を公表し、通常毎月14日(休業日の場合には翌営業日)または受託会社が単独の裁量で決定するその他の日(「分配日」)に分配を行うことを目指す。

各クラスの受益証券保有者は月ごとの分配金を再投資し、各分配日に発行された受益証券を受け取るものとする。

2017年11月30日に終了した期間に係る分配及び再投資額は以下の通りであった。

受益者への分配金	金額	
Class A-AUD Class	USD	1,741,097
Class B-BRL Class		5,466,572
Class C-INR Class		2,523,050
Class D-JPY Class		8,047,050
分配金合計	USD	17,777,769

#### (E) 現金及び外国通貨

本ファンドの機能通貨及び報告通貨は米ドルである。外国の有価証券、通貨並びにその他の資産及び負債の公正価値は、毎営業日の為替レートに基づいて本ファンドの機能通貨に換算される。

為替レートの変動の結果としての保有通貨並びにその他の資産及び負債の公正価値の変動は、外国通貨の未実現損益として計上される。有価証券の実現損益、未実現損益、並びに収益及び費用は、各取引日及び報告日のレートでそれぞれ換算される。

有価証券及びデリバティブ取引への投資に関する外国通貨の為替レートの変動による影響は、損益計算書上で当該有価証券の市場価格及び評価の変動の影響と区分せず、実現及び未実現損益に含めて計上している。

#### (F) 定期預金

本ファンドは余剰資金を、受託会社の判断により、ブラウン・ブラザーズ・ハリマン社(以下、カストディアン)を通じ、一つ以上の適格預金取扱機関の翌日物定期預金として運用する。これは本ファンドの有価証券明細表上では短期投資として分類されている。運用する通貨の需要が低い場合には、本ファンドは資金預入のために手数料を支払う可能性があり、それによって本ファンドに支払利息が生じることがある。

#### (G) 外国為替予約取引

本ファンドは、予定される有価証券の購入または売却の決済に伴い、本ファンドが保有する有価証券の一部または全部に係る通貨エクスポージャーをヘッジするため、もしくは投資戦略の一環として、外国為替予約取引を締結することができる。外国為替予約取引は、二当事者間で将来の特定日に、設定された価格で通貨の売買を行う契約である。外国為替予約取引の公正価値は、外国為替相場の変動により上下する。外国為替予約取引は毎日値洗いされ、価格の変動は未実現損益として計上される。

実現損益は取引開始時における価値と取引終了時における価値との差額に相当し、通貨の引き渡しまたは受領により計上される。これらの契約には、貸借対照表に計上された未実現損益を超える市場リスクが含まれることがある。また、本ファンドは、取引相手先が契約の条件を履行できなくなる場合や、為替の変動がベース通貨に不利となる場合にリスクにさらされる可能性がある。

本ファンドはまた、投資家向けに為替リスクをヘッジする目的で、外国為替予約取引を締結できる権限を付与されている。特定クラスの外国為替予約取引から生じた損益は、その特定クラスに配賦される。2017年11月30日現在締結されている外国為替予約取引は、有価証券明細表に記載されている。

#### (H) 先物取引

本ファンドは、先物取引を締結することができる。本ファンドは、先物取引を、証券市場または金利及び通貨価値の変動に対するエクスポージャーを管理するために利用する。また、本ファンドはヘッジ目的ではなく、外貨への直接投資として、先物またはそのオプションを売買する場合がある。

先物取引の利用に伴う主たるリスクには、本ファンドが保有する有価証券の市場価値の変動と先物取引の価格の変動との間の不完全な相関性、市場が非流動的である可能性及び取引相手先が契約条件を履行できない可能性が挙げられる。先物取引は、市場で示された日々の清算価格で評価される。

本ファンドは、先物取引の締結に際して、先物ブローカーまたは取引所の定める当初証拠金額要件に従い、現金または米国債 / 米国政府機関債を先物ブローカーに預け入れることが義務づけられている。先物取引は毎日値洗いされ、価格の変動により適宜未払金あるいは未収金（「変動証拠金」）が本ファンドに計上される。損益は認識されるが、当該契約が期限を迎えるか決済されるまで実現損益とはみなされない。先物取引には、貸借対照表に開示された変動証拠金を超える損失リスクが様々な度合いで含まれている。2017年11月30日時点で本ファンドは、いかなる先物取引も行っていない。

#### (I) レポ取引契約

本ファンドはレポ取引契約を締結することができる。一般的なレポ取引契約の条件の下では、売り主が定められた価格で定められた時期に買戻し、本ファンドが売渡すという義務を負うことを条件に、本ファンドは対象となる債務証券(担保)を保有する。レポ取引契約に係る原証券はすべて、本ファンドのカストディアンまたは三者間レポ取引契約で指定されたサブ・カストディアンにより保管される。担保の市場価格は、利息を含むレポ債務の総額と同等以上でなければならない。レポ取引契約に基づいて購入された有価証券は、貸借対照表の資産額に反映される。得られた利息は、損益計算書上の受取利息の一部として計上される。担保の需要が高まった場合には、本ファンドは担保を保有するために手数料を支払う可能性があり、それによって本ファンドに支払利息が生じることがある。2017年11月30日現在、本ファンドはレポ取引契約を一切締結していない。

#### (J) リバース・レポ取引契約

本ファンドはリバース・レポ取引契約を締結することができる。リバース・レポ取引契約では、本ファンドは契約の取引相手方である金融機関に現金と引換に有価証券を引き渡し、同時に定められた価格で定められた時期に同一または実質的に同一の有価証券を買戻す契約を締結する。本ファンドは、取引相手方に引き渡した有価証券について、元本と契約期間中に発生した利息（もしあれば）を受領する権利を有する。引き渡される有価証券と引換に受取る現金および本ファンドから取引相手方に支払われる予定の経過利息は、貸借対照表の負債に計上される。本ファンドから取引相手方に支払われる利息は損益計算書に支払利息の一部として計上される。当該有価証券への需要が高まった場合には、本ファンドは取引相手方より当該有価証券を使用するための手数料を受取る可能性があり、それによって本ファンドに受取利息が生じることがある。2017年11月30日現在、本ファンドはリバース・レポ取引契約を一切締結していない。

#### (K) オプション契約

本ファンドは、本ファンドが保有する、あるいは投資する可能性のある有価証券および金融派生商品に係るコール・オプションおよびプット・オプションを売建てることことができる。プット・オプションの売建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを増加させる傾向がある。コール・オプションの売建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを減少させる傾向がある。本ファンドがコール・オプションまたはプット・オプションを売建てる際、受取りプレミアムに相当する金額が負債として計上され、売建オプションの現在価値を反映するよう時価評価される。これらの負債は、貸借対照表に売建オプションとして計上される。オプションの売建により受取ったプレミアムは、満期日に実現益として扱われる。オプションの売建により受取ったプレミアムは、行使または清算時に受取金に追加されるか、原資産である先物、スワップ、有価証券または通貨取引に係る支払額と相殺され、実現損益が決定される。売建オプションの中にはプレミアムが将来の一定期日に決まるものもある。オプションの売手としての本ファンドは、原資産の売却(コール)あるいは購入(プット)についていかなる支配力も有していないため、売建オプションの原資産の価格が不利に変動することによる市場リスクを負う。場合によっては、市場の流動性が低いため、権利行使がなされず、ファンドが反対売買を行うことができないというリスクも存在する。

本ファンドは、プット・オプションまたはコール・オプションを買建てることことができる。コール・オプションの買建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを増加させる傾向がある。プット・オプションの買建は原資産に対する本ファンドのエクスポージャーを減少させる傾向がある。本ファンドが支払うプレミアムは、貸借対照表に投資として計上され、オプションの現在価値を反映するよう時価評価される。オプションの買建により支払うプレミアムは、満期日に実現損として扱われる。買建オプションの中にはプレミアムが将来の一定期日に決まるものもある。オプション・プレミアムは定められた期間のインプライド・ボラティリティによって計算される。プット・オプションおよびコール・オプションの買建に伴うリスクは、プレミアムの支払額に限定される。オプションの買建により支払うプレミアムは、行使または清算時に支払金に追加されるか、原資産の取引から得た収入と相殺され、原資産の売却時に実現損益が決定される。2017年11月30日現在の買建オプションは有価証券明細表に記載している。

## (L) デリバティブ取引

ASC 815-10-50は、デリバティブ取引及びヘッジ取引の開示を義務づけている。具体的には、a)デリバティブ取引をどのように、また何故利用しているか、b)デリバティブ取引と関連するヘッジ取引をどのように計上しているか、c)デリバティブ取引と関連するヘッジ取引が財政状態、業績及びキャッシュフローにどのような影響を及ぼすか、を開示することが要求されている。

本ファンドは、いかなるデリバティブ取引もASC 第 815号に基づくヘッジ取引として指定していない。

本ファンドは、外国為替予約取引及びオプション取引を主にトレーディング目的で行っており、主として外国為替リスクを負っている。これらデリバティブ取引の公正価値は、貸借対照表に記載されるとともに、公正価値の変動は損益計算書の外国為替予約取引及びオプション取引に関する実現損益または未実現損益の変動額として計上される。

以下は、リスク・エクスポージャーで分類したファンドのデリバティブ取引の公正価値の要約である。

2017年11月30日時点の貸借対照表におけるデリバティブ取引の影響

ASC第815号に基づくヘッジ取引として指定されていないデリバティブ取引

該当項目	株式*	外国為替リスク**	合計
	(USD)	(USD)	(USD)
デリバティブ資産			
買建オプション、時価	43,193	-	43,193

外国為替予約取引に係る評価益	-	744,617	744,617
	43,193	744,617	787,810

**デリバティブ負債**

外国為替予約取引に係る評価損	-	(267,711)	(267,711)
----------------	---	-----------	-----------

\*グロス評価額は投資（公正価値）として貸借対照表に記載されている。

\*\*グロス評価額は外国為替予約取引に係る評価（損）益として貸借対照表に記載されている。

2017年11月30日に終了した期間の損益計算書におけるデリバティブ取引の影響

ASC第815号に基づくヘッジ取引として指定されていないデリバティブ取引

該当項目	株式 (USD)	外国為替リスク (USD)	合計 (USD)
<b>運用の結果として認識された デリバティブに係る実現（損）益</b>			
外国為替予約取引に係る実現損*	-	(534,578)	(534,578)
<b>運用の結果として認識されたデリバティブに 係る未実現（損）益の変動</b>			
買建オプションに係る未実現損の変動**	(38,907)	-	(38,907)
外国為替予約取引に係る未実現益の変動***	-	1,651,309	1,651,309
	(38,907)	1,651,309	1,612,402

\*外国為替取引及び外国為替先物取引に係る実現損として損益計算書の科目に記載されている。

\*\*有価証券の未実現益の変動として損益計算書の科目に記載されている。

\*\*\*外国為替取引及び外国為替先物取引に係る未実現益の変動として損益計算書の科目に記載されている。

2017年11月30日に終了した年度における、外国為替予約取引の未決済の月次平均想定元本はおよそ次の通り：

ファンドレベル*	USD	43,222,238
Class A-AUD Class	USD	11,160,234
Class B-BRL Class	USD	11,658,029
Class C-INR Class	USD	11,744,496
Class D-JPY Class	USD	75,688,254

\*全クラスに対して所有している外国為替予約取引

2017年11月30日に終了した期間において、買建オプションを保有した2か月間における月次平均元本残高は82,100米ドルで、対応する月次平均枚数は75であった。

本ファンドは、特定の取引相手方と、随時締結される店頭デリバティブ取引および外国為替取引を規定する国際スワップ・デリバティブ協会（ISDA）マスター・ネットリング契約（以下「マスター・ネットリング契約」という。）の当事者である。当該マスター・ネットリング契約には、当事者の一般的義務、表明、合意、担保要求、債務不履行事由および期限前終了に関する条項等が含まれる場合がある。

担保要求はファンドの各取引先とのネット・ポジションに基づいて決定される。担保は、現金またはファンドと当該取引相手方が同意するその他の有価証券である。特定の取引相手方に関して、マスター・ネットリング契約の条項に従ってファンドに提供された担保がある場合は、ファンドの保管会社によって分別保有され、売却または再担保が可能な額に関してはファンドの有価証券明細表に表示される。ファンドが提供した担保がある場合は、ファンドの保管会社により分別保管され、ファンドの有価証券明細表において識別される。現金の担保がある場合は、当該金額は貸借対照表で開示される。



ファンド側の取引終了事由は、一定期間に亘りファンドの純資産が規定の基準以下に減少する場合に発生しうる。取引相手方側の取引終了事由は、取引相手方の信用格付が規定のレベルを下回る場合に発生しうる。いずれの場合も、発生時に、他方当事者は期限前終了を選択し、同当事者による合理的な決定に基づいて、全ての未決済デリバティブ契約および外国為替取引のすべての決済（期限前終了によって生じた損失および費用の支払いを含む）をすることができる。単一または複数のファンドの取引相手方による期限前終了の決定が、ファンドの将来のデリバティブ取引に影響を与える可能性がある。

#### (M) カストディアン宛未払い金

貸借対照表に計上されているカストディアン宛未払い金は、外国通貨あるいは現金に係る債務を含んでいる。

[前へ](#) [次へ](#)

## グローバルC B オープン・円コース

## (1) 貸借対照表

区分	前期 平成30年11月19日現在 金額（円）	当期 令和1年5月20日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	29,975,071	-
コール・ローン	74,457,641	95,927,843
投資信託受益証券	3,683,404,008	3,307,338,167
親投資信託受益証券	841,911	841,580
未収入金	14,161,673	4,187,878
流動資産合計	3,802,840,304	3,408,295,468
資産合計	3,802,840,304	3,408,295,468
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,371,035	4,870,826
未払解約金	14,547,896	5,673,476
未払受託者報酬	87,895	78,237
未払委託者報酬	3,340,391	2,973,315
その他未払費用	215,887	180,606
流動負債合計	23,563,104	13,776,460
負債合計	23,563,104	13,776,460
純資産の部		
元本等		
元本	5,371,035,478	4,870,826,559
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,591,758,278	1,476,307,551
（分配準備積立金）	805,603,025	736,499,410
元本等合計	3,779,277,200	3,394,519,008
純資産合計	3,779,277,200	3,394,519,008
負債純資産合計	3,802,840,304	3,408,295,468

## (2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日 金額（円）	当期 自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	271,328,376	42,406,649
受取利息	420	158
有価証券売買等損益	339,735,465	28,916,476
営業収益合計	68,406,669	13,490,331
営業費用		

支払利息	51,248	38,035
受託者報酬	567,235	475,463
委託者報酬	21,556,741	18,069,718
その他費用	218,429	185,657
営業費用合計	22,393,653	18,768,873
営業利益又は営業損失( )	90,800,322	5,278,542
経常利益又は経常損失( )	90,800,322	5,278,542
当期純利益又は当期純損失( )	90,800,322	5,278,542
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( )	918,317	713,988
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,755,330,342	1,591,758,278
剰余金増加額又は欠損金減少額	352,662,661	152,635,655
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	352,662,661	152,635,655
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,870,934	2,590,438
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,870,934	2,590,438
分配金	92,337,658	30,029,936
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,591,758,278	1,476,307,551

[前へ](#)   [次へ](#)

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。  また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において、確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、当計算期末が休日のため、平成30年11月20日から令和1年5月20日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成30年11月19日現在	令和1年5月20日現在
1. 元本状況		
期首元本額	6,671,158,814円	5,371,035,478円
期中追加設定元本額	25,172,129円	8,666,965円
期中一部解約元本額	1,325,295,465円	508,875,884円
2. 受益権の総数	5,371,035,478口	4,870,826,559口
3. 元本の欠損	1,591,758,278円	1,476,307,551円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																
自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日	自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日																																																
<p>分配金の計算過程</p> <p>第78期計算期間末（平成30年6月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,443,485,196円（1万口当たり2,256.67円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い19,189,564円（1万口当たり30円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>46,412,317円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>610,312,312円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>786,760,567円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>1,443,485,196円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(2,256.67円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>19,189,564円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(30円)</td> </tr> </table> <p>第79期計算期間末（平成30年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,337,207,961円（1万口当たり2,297.80円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,458,549円（1万口当たり30円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>41,388,151円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>555,783,595円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>740,036,215円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	46,412,317円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	610,312,312円	分配準備積立金	786,760,567円	分配可能額	1,443,485,196円	（1万口当たり分配可能額）	(2,256.67円)	収益分配金	19,189,564円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)	配当等収益 （費用控除後）	41,388,151円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	555,783,595円	分配準備積立金	740,036,215円	<p>分配金の計算過程</p> <p>第84期計算期間末（平成30年12月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,324,041,189円（1万口当たり2,533.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い5,225,639円（1万口当たり10円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>39,078,735円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>501,387,671円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>783,574,783円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>1,324,041,189円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>(2,533.74円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>5,225,639円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>(10円)</td> </tr> </table> <p>第85期計算期間末（平成31年1月21日）に、投資信託約款に基づき計算した1,281,340,632円（1万口当たり2,523.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い5,077,151円（1万口当たり10円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>487,373,827円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>793,966,805円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	39,078,735円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	501,387,671円	分配準備積立金	783,574,783円	分配可能額	1,324,041,189円	（1万口当たり分配可能額）	(2,533.74円)	収益分配金	5,225,639円	（1万口当たり収益分配金）	(10円)	配当等収益	0円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	487,373,827円	分配準備積立金	793,966,805円
配当等収益 （費用控除後）	46,412,317円																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																
収益調整金	610,312,312円																																																
分配準備積立金	786,760,567円																																																
分配可能額	1,443,485,196円																																																
（1万口当たり分配可能額）	(2,256.67円)																																																
収益分配金	19,189,564円																																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																																
配当等収益 （費用控除後）	41,388,151円																																																
有価証券売買等損益	0円																																																
収益調整金	555,783,595円																																																
分配準備積立金	740,036,215円																																																
配当等収益 （費用控除後）	39,078,735円																																																
有価証券売買等損益	0円																																																
収益調整金	501,387,671円																																																
分配準備積立金	783,574,783円																																																
分配可能額	1,324,041,189円																																																
（1万口当たり分配可能額）	(2,533.74円)																																																
収益分配金	5,225,639円																																																
（1万口当たり収益分配金）	(10円)																																																
配当等収益	0円																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																
収益調整金	487,373,827円																																																
分配準備積立金	793,966,805円																																																

分配可能額	1,337,207,961円
（1万口当たり分配可能額）	(2,297.80円)
収益分配金	17,458,549円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第80期計算期間末（平成30年8月20日）に、投資信託約款に基づき計算した1,332,340,077円（1万口当たり2,339.60円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,084,180円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	40,890,167円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	544,399,876円
分配準備積立金	747,050,034円
分配可能額	1,332,340,077円
（1万口当たり分配可能額）	(2,339.60円)
収益分配金	17,084,180円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第81期計算期間末（平成30年9月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,337,141,531円（1万口当たり2,382.30円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,838,487円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	40,800,470円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	537,116,994円
分配準備積立金	759,224,067円
分配可能額	1,337,141,531円
（1万口当たり分配可能額）	(2,382.30円)
収益分配金	16,838,487円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第82期計算期間末（平成30年10月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,325,574,186円（1万口当たり2,425.45円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い16,395,843円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	39,978,871円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	523,562,138円
分配準備積立金	762,033,177円
分配可能額	1,325,574,186円
（1万口当たり分配可能額）	(2,425.45円)
収益分配金	16,395,843円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第83期計算期間末（平成30年11月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,326,085,299円（1万口当たり2,468.96円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い15,371,035円（1万口当たり10円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	39,482,490円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	515,111,239円
分配準備積立金	771,491,570円
分配可能額	1,326,085,299円
（1万口当たり分配可能額）	(2,468.96円)
収益分配金	5,371,035円
（1万口当たり収益分配金）	(10円)

分配可能額	1,281,340,632円
（1万口当たり分配可能額）	(2,523.74円)
収益分配金	5,077,151円
（1万口当たり収益分配金）	(10円)

第86期計算期間末（平成31年2月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,262,914,320円（1万口当たり2,513.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い15,024,046円（1万口当たり10円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	482,495,203円
分配準備積立金	780,419,117円
分配可能額	1,262,914,320円
（1万口当たり分配可能額）	(2,513.74円)
収益分配金	5,024,046円
（1万口当たり収益分配金）	(10円)

第87期計算期間末（平成31年3月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,236,087,136円（1万口当たり2,503.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,936,963円（1万口当たり10円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	474,345,406円
分配準備積立金	761,741,730円
分配可能額	1,236,087,136円
（1万口当たり分配可能額）	(2,503.74円)
収益分配金	4,936,963円
（1万口当たり収益分配金）	(10円)

第88期計算期間末（平成31年4月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,220,763,261円（1万口当たり2,493.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,895,311円（1万口当たり10円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後）	0円
収益調整金	470,554,887円
分配準備積立金	750,208,374円
分配可能額	1,220,763,261円
（1万口当たり分配可能額）	(2,493.74円)
収益分配金	4,895,311円
（1万口当たり収益分配金）	(10円)

第89期計算期間末（令和1年5月20日）に、投資信託約款に基づき計算した1,209,786,596円（1万口当たり2,483.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い14,870,826円（1万口当たり10円）を分配しております。

配当等収益	0円
有価証券売買等損益 （費用控除後）	0円
収益調整金	468,416,360円
分配準備積立金	741,370,236円
分配可能額	1,209,786,596円
（1万口当たり分配可能額）	(2,483.74円)
収益分配金	4,870,826円
（1万口当たり収益分配金）	(10円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期
	自 平成30年11月20日 至 令和1年5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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング及びファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理及びコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベル及び頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署には正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員及びリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
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、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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	令和1年5月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

前期（平成30年11月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	-
投資信託受益証券	56,285,656
合計	56,285,656

当期（令和1年5月20日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	83
投資信託受益証券	22,955,965
合計	22,956,048

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成30年11月19日現在）

該当事項はありません。

当期（令和1年5月20日現在）

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

当期（自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日）

市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（1口当たり情報）

前期 平成30年11月19日現在	当期 令和1年5月20日現在
1口当たり純資産額 0.7036円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,036円）」	1口当たり純資産額 0.6969円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,969円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	Global Convertible Bond Fund JPY Class	5,599,015,012	3,307,338,167	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	827,757	841,580	
合計 2銘柄			5,599,842,769	3,308,179,747	

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「Global Convertible Bond Fund JPY Class」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「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「グローバルC B オープン・高金利通貨コース」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

## グローバルC Bオープン（マネープールファンド）

## (1) 貸借対照表

区分	第14期 平成30年11月19日現在 金額（円）	第15期 令和1年5月20日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	5,146,007	2,028,683
未収入金	2,000	9,999
流動資産合計	5,148,007	2,038,682
資産合計	5,148,007	2,038,682
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,000	9,999
その他未払費用	150	-
流動負債合計	2,150	9,999
負債合計	2,150	9,999
純資産の部		
元本等		
元本	5,148,116	2,030,472
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,259	1,789
（分配準備積立金）	56,854	29,882
元本等合計	5,145,857	2,028,683
純資産合計	5,145,857	2,028,683
負債純資産合計	5,148,007	2,038,682

## (2) 損益及び剰余金計算書

区分	第14期 自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日 金額（円）	第15期 自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日 金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	1,753	1,727
営業収益合計	1,753	1,727
営業費用		
その他費用	150	-
営業費用合計	150	-
営業利益又は営業損失（ ）	1,903	1,727
経常利益又は経常損失（ ）	1,903	1,727
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,903	1,727
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（ ）	977	835



期首剰余金又は期首欠損金( )	2,233	2,259
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,041	1,404
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,041	1,404
剰余金減少額又は欠損金増加額	141	42
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	141	42
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,259	1,789

[前へ](#)   [次へ](#)

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第15期	
	自 平成30年11月20日 至 令和1年5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、基準価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、当計算期末が休日のため、平成30年11月20日から令和1年5月20日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第14期	第15期
	平成30年11月19日現在	令和1年5月20日現在
1. 元本状況		
期首元本額	8,875,880円	5,148,116円
期中追加設定元本額	305,144円	73,702円
期中一部解約元本額	4,032,908円	3,191,346円
2. 受益権の総数	5,148,116口	2,030,472口
3. 元本の欠損		
	2,259円	1,789円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期	第15期
自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日	自 平成30年11月20日 至 令和1年5月20日
分配金の計算過程 該当事項はありません。	分配金の計算過程 該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第15期	
	自 平成30年11月20日 至 令和1年5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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング及びファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理及びコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベル及び頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員及びリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期 令和1年5月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、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	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

第14期（平成30年11月19日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,031
合計	1,031

第15期（令和1年5月20日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	827
合計	827

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第14期（平成30年11月19日現在）

該当事項はありません。

第15期（令和1年5月20日現在）

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第15期（自平成30年11月20日 至 令和1年5月20日）

市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (1口当たり情報)

第14期 平成30年11月19日現在	第15期 令和1年5月20日現在
1口当たり純資産額 0.9996円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,996円)」	1口当たり純資産額 0.9991円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,991円)」

## (4) 附属明細表

## 有価証券明細表

## &lt;株式以外の有価証券&gt;

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド	1,995,361	2,028,683	
	合計	1銘柄	1,995,361	2,028,683	

## &lt;参考&gt;

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・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」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの状況は、前記「グローバルCBオープン・高金利通貨コース」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

## 2 ファンドの現況

## 純資産額計算書

(2019年6月末現在)

## グローバルC B オープン・高金利通貨コース

資産総額	1,624,720,280 円
負債総額	3,657,313 円
純資産総額( - )	1,621,062,967 円
発行済数量	2,629,223,647 口
1 単位当り純資産額( / )	0.6166 円

## グローバルC B オープン・円コース

資産総額	3,389,211,886 円
負債総額	57,716,928 円
純資産総額( - )	3,331,494,958 円
発行済数量	4,703,103,178 口
1 単位当り純資産額( / )	0.7084 円

## グローバルC B オープン(マネーボールファンド)

資産総額	2,029,185 円
負債総額	3,999 円
純資産総額( - )	2,025,186 円
発行済数量	2,026,970 口
1 単位当り純資産額( / )	0.9991 円

## (参考) キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

資産総額	3,789,731,592 円
負債総額	9,816,788 円
純資産総額( - )	3,779,914,804 円
発行済数量	3,717,662,888 口
1 単位当り純資産額( / )	1.0167 円

[前へ](#)

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

##### 1 委託会社等の概況

###### イ 資本金の額および株式数

	2019年6月28日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

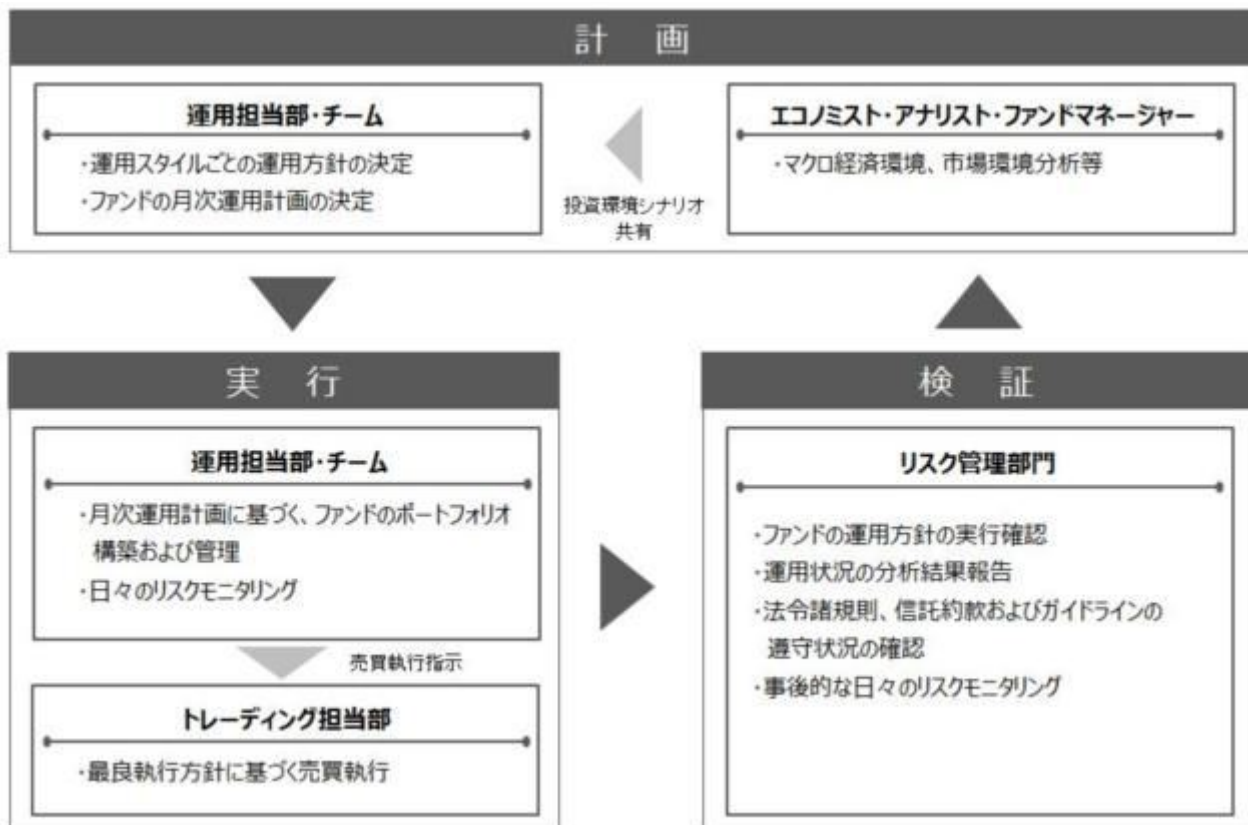
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 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、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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2019年6月28日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	773	8,410,967
単位型株式投資信託	116	590,384
追加型公社債投資信託	1	28,707
単位型公社債投資信託	189	534,141
合計	1,079	9,564,201

[次へ](#)

### 3 委託会社等の経理状況

- 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。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、当事業年度（平成30年4月1日から平成31年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

[次へ](#)

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金及び預金	20,873,870	13,755,961
顧客分別金信託	20,010	20,011
前払費用	402,249	476,456
未収入金	39,030	64,856
未収委託者報酬	6,332,203	6,963,077
未収運用受託報酬	1,725,215	1,129,548
未収投資助言報酬	316,407	285,668
未収収益	50,321	44,150
その他の流動資産	10,891	31,771
流動資産合計	29,770,200	22,771,504
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	185,371	173,517
器具備品	300,694	751,471
有形固定資産合計	486,065	924,988
無形固定資産		
ソフトウェア	409,765	479,867
ソフトウェア仮勘定	5,755	183,528
電話加入権	56	44
商標権	-	60
無形固定資産合計	415,576	663,501
投資その他の資産		
投資有価証券	10,616,594	10,829,628
関係会社株式	10,412,523	10,252,067
長期差入保証金	658,505	2,004,451
長期前払費用	69,423	97,107
会員権	7,819	7,819
繰延税金資産	1,394,447	1,426,381
投資その他の資産合計	23,159,314	24,617,457
固定資産合計	24,060,956	26,205,946
資産合計	53,831,157	48,977,450

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
<b>負債の部</b>		
流動負債		
顧客からの預り金	84	4,534



その他の預り金	92,326	1,480,229
未払金		
未払収益分配金	649	1,122
未払償還金	137,522	137,522
未払手数料	2,783,763	3,246,133
その他未払金	236,739	768,373
未払費用	3,433,641	3,535,589
未払消費税等	547,706	84,966
未払法人税等	1,785,341	670,761
賞与引当金	1,507,256	1,302,052
その他の流動負債	1,408	18,110
流動負債合計	10,526,438	11,249,395
固定負債		
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601
賞与引当金	99,721	5,074
その他の固定負債	3,363	5,074
固定負債合計	3,422,915	3,428,751
負債合計	13,949,354	14,678,146
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	26,561,078	21,255,054
利益剰余金合計	28,382,283	23,076,258
株主資本計	39,011,267	33,705,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	870,535	594,061
評価・換算差額等合計	870,535	594,061
純資産合計	39,881,802	34,299,304
負債・純資産合計	53,831,157	48,977,450

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成29年4月1日	(自 平成30年4月1日
	至 平成30年3月31日)	至 平成31年3月31日)
営業収益		

委託者報酬	36,538,981	39,156,499
運用受託報酬	8,362,118	6,277,217
投資助言報酬	1,440,233	1,332,888
その他営業収益		
情報提供コンサルタント		
業務報酬	5,000	-
サービス支援手数料	128,324	182,502
その他	55,820	49,507
営業収益計	46,530,479	46,998,614
営業費用		
支払手数料	16,961,384	18,499,433
広告宣伝費	353,971	361,696
公告費	1,140	125
調査費		
調査費	1,654,233	1,752,905
委託調査費	5,972,473	6,050,441
営業雑経費		
通信費	40,066	46,551
印刷費	339,048	338,465
協会費	-	24,700
諸会費	45,465	23,756
情報機器関連費	2,582,734	2,872,416
販売促進費	34,333	49,118
その他	136,669	148,307
営業費用合計	28,121,520	30,167,918
一般管理費		
給料		
役員報酬	196,529	190,951
給料・手当	6,190,716	6,308,066
賞与	601,375	514,259
賞与引当金繰入額	1,566,810	1,235,936
交際費	25,709	27,802
寄付金	-	82
事務委託費	256,413	286,905
旅費交通費	220,569	228,538
租税公課	282,036	285,369
不動産賃借料	654,286	612,410
退職給付費用	419,884	463,553
固定資産減価償却費	329,756	378,530
諸経費	285,490	290,243
一般管理費合計	11,029,580	10,822,651
営業利益	7,379,378	6,008,044

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	51,335	-

受取利息		520	623
時効成立分配金・償還金		2,622	72
原稿・講演料		894	1,951
雑収入		10,669	36,408
営業外収益合計		66,042	39,055
営業外費用			
為替差損		5,125	15,760
雑損失		913	7,027
営業外費用合計		6,038	22,787
経常利益		7,439,383	6,024,312
特別利益			
投資有価証券償還益		61,842	289,451
投資有価証券売却益		30,980	7,247
過去勤務費用償却益	1	-	79,850
特別利益合計		92,822	376,549
特別損失			
固定資産除却損	2	354,695	1,462
投資有価証券償還損		141,666	13,668
投資有価証券売却損		9,634	14,605
関係会社株式評価損	3	-	160,455
合併関連費用	4	-	187,140
特別損失合計		505,996	377,331
税引前当期純利益		7,026,209	6,023,530
法人税、住民税及び事業税		2,350,891	1,750,031
法人税等調整額		280,166	90,084
法人税等合計		2,070,725	1,840,116
当期純利益		4,955,483	4,183,413

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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		
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金	
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074
当期変動額							
剰余金の配当							1,887,480
当期純利益							4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,314,279	35,943,263	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額					
剰余金の配当	1,887,480	1,887,480			1,887,480
当期純利益	4,955,483	4,955,483			4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	3,068,003	3,068,003	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802
当期変動額					
剰余金の配当	9,489,438	9,489,438			9,489,438
当期純利益	4,183,413	4,183,413			4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			276,474	276,474	276,474
当期変動額合計	5,306,024	5,306,024	276,474	276,474	5,582,498
当期末残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304

## 注記事項

(重要な会計方針)

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. 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。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

### (2)無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)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。

## 3. 引当金の計上基準

### (1)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

### (2)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、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

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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ます。

### (表示方法の変更)

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正(企業会計基準第28号平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」715,988千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,394,447千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第4項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
建物	312,784千円	350,176千円
器具備品	768,929千円	922,553千円

#### 2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

## 3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	204,923千円	174,854千円

## (損益計算書関係)

## 1 過去勤務費用償却益

過去勤務費用償却益は、退職金規程を変更したことに伴い発生した過去勤務費用の一時処理額であります。

## 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
器具備品	0 千円	695 千円
ソフトウェア	9,000 千円	766 千円
ソフトウェア仮勘定	345,695 千円	- 千円

## 3 関係会社株式評価損

関係会社株式評価損は、関連会社の株式について減損処理を適用したことによるものであります。

## 4 合併関連費用

合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用であります。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000.00	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

平成30年6月26日開催の第33回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

当事業年度(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数

普通株式	17,640株	17,622,360株	-	17,640,000株
------	---------	-------------	---	-------------

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は平成30年11月1日を効力発生日としておりますので、平成31年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
平成31年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	平成31年 1月31日	平成31年 3月22日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
令和1年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25日

## (リース取引関係)

## オペレーティング・リース取引

## (借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
1年以内	208,187	597,239
1年超	42,916	6,115,662
合計	251,104	6,712,901

## (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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っております。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っております。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っておりません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しております。

投資有価証券、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しております。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しております。

## 市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

#### (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、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額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を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

## 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、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

当事業年度(平成31年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-
(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

#### (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

##### 資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬

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います。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

(7)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

##### 負 債



## (1)顧客からの預り金及び(2)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います。

## (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貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,252,067
合計	10,412,523	10,252,067

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成30年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

当事業年度（平成31年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

## (有価証券関係)

## 1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成30年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円）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。

当事業年度（平成31年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,252,067千円）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30年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437

(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）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、記載しておりません。

当事業年度（平成31年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,283,920	3,360,000	76,080
小計	3,283,920	3,360,000	76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）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、記載しておりません。

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
532,099	30,980	9,634

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
728,127	7,247	14,605

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、有価証券について160,455千円（関係会社株式160,455千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないもの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、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年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	当事業年度
	（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）
退職給付債務の期首残高	3,177,131	3,319,830
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の発生額	51,212	3,658
退職給付の支払額	94,727	85,082
過去勤務費用の発生額	-	79,850
退職給付債務の期末残高	3,319,830	3,418,601

##### (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

（単位：千円）

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,319,830	3,418,601
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601

## (3)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 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の費用処理額	51,212	3,658
過去勤務費用償却益	-	79,850
その他	182,458	199,849
確定給付制度に係る退職給付費用	419,884	383,703

(注) 1.退職金規程を変更したことに伴い、過去勤務費用償却益79,850千円を特別利益に計上しております。

2.その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
割引率	0.000%	0.000%

## 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147,195千円、当事業年度156,457千円であります。

## (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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798
繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額(注)	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

(注) 評価性引当額が49,131千円増加しております。この増加の内容は、主として関係会社株式評価損に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	-	0.8
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.9
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.9	1.4
その他	0.1	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4	30.5

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客へ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。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客へ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。

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1.関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	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	科目	期末残高
親会社 の 子会社	(株)三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

(注)1.上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2.親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1.関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、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29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	2,260.87円	1,944.40円
1株当たり当期純利益金額	280.92円	237.15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. 当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、前事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 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29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,955,483	4,183,413
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)	4,955,483	4,183,413
期中平均株式数(株)	17,640,000	17,640,000

## (重要な後発事象)

前事業年度(自平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

当事業年度(自平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

取得による企業結合

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併いたしました。

## 1. 企業結合の概要

### (1)被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

## (2)企業結合を行う主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

## (3)企業結合日

平成31年4月1日

## (4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併方式であります。

## (5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

## (6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)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)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

## (1)合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式1株に対し、当社の普通株式4,2156株を割当て交付いたしました。

## (2)合併比率の算定方法

当社はEYトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はPwCアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であると判断し、合意に至ったものであります。

## (3)交付した株式数

普通株式：16,230,060株

## 3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

## 4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

## (参考)大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

1. 委託会社の財務諸表は、「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。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
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 飯田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 栄 裕 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」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47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、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

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) 取組データは監査の対象には含まれていません。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		



現金・預金		21,360,895	20,475,527
前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,143	3,583
未払金	29,207	1,555,486
未払手数料	1,434,393	1,222,461
未払費用	1,287,722	1,203,269
未払法人税等	1,397,293	264,304
未払消費税等	135,042	48,437
賞与引当金	1,263,100	1,007,040
役員賞与引当金	85,600	72,900
その他	23,128	29,455
流動負債計	5,658,632	5,406,939
固定負債		

リース債務	4,698	5,173
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-
長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	5,111,757	4,252,374
委託者報酬	26,383,145	24,415,734
その他営業収益	82,997	66,957
営業収益計	31,577,899	28,735,066
営業費用		
支払手数料	11,900,832	10,708,502
広告宣伝費	93,131	196,206
公告費	-	293
調査費		
調査費	1,637,364	2,076,042
委託調査費	2,959,680	3,032,753
委託計算費	79,120	77,597

営業雑経費		
通信費	42,497	38,715
印刷費	517,371	507,540
協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	-	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	2	179,376
固定資産除却損	-	4,121
特別損失計	-	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

## (3) 株主資本等変動計算書

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30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	
		資本準備金	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	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額 （純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額 （純額）			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31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	
		資本準備金	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	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額 （純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				

当期首残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	3,803,800	3,803,800			3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			94,337	94,337	94,337
当期変動額合計	870,268	870,268	94,337	94,337	964,605
当期末残高	28,960,505	31,116,774	39,124	39,124	31,077,650

## 注記事項

## (重要な会計方針)

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  
総平均法による原価法を採用しております。
- (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(売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。)を採用しております。  
時価のないもの  
総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の方法
- (1) 有形固定資産(リース資産を除く)  
定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。  
建物 2～30年  
器具備品 4～15年  
(会計上の見積りの変更)  
当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。  
これにより、従来の方法に比べて、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15,534千円減少しております。
- (2) 無形固定資産(リース資産を除く)  
定額法を採用しております。  
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)に基づく定額法によっております。
- (3) リース資産  
所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産  
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。
3. 引当金の計上基準
- (1) 貸倒引当金  
債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
- (2) 賞与引当金  
従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。
- (3) 役員賞与引当金  
役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

<p>(4) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金</p> <p>役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>
<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> <p>消費税等の会計処理</p> <p>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。</p>

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

(追加情報)

当社は、平成31年3月22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、当事業年度において役員退職慰労引当金184,610千円を長期未払金に振り替えております。

(貸借対照表関係)

第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31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 465,964千円	建物 556,889千円
器具備品 266,621千円	器具備品 297,262千円
リース資産 8,719千円	リース資産 12,584千円

(損益計算書関係)

第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
-	2. 合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1.発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

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29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

## 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30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25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、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与等であり、1年以内の債権であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料、及び業務委託関連費用であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

## (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

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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、次表に含めておりません(注2)を参照ください)。

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	21,360,895	21,360,895	-
(2) 未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	-
(3) 未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	-
(4) 未収入金	12,823	12,823	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,206,465	10,206,465	-
資産計	36,141,929	36,141,929	-
(1) 未払手数料	1,434,393	1,434,393	-
(2) 未払費用(*)	959,074	959,074	-
負債計	2,393,468	2,393,468	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,475,527	20,475,527	-
(2) 未収委託者報酬	2,923,589	2,923,589	-
(3) 未収運用受託報酬	870,546	870,546	-
(4) 未収入金	4,542	4,542	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,979,968	10,979,968	-
(6) 長期差入保証金	524,592	524,592	-
資産計	35,778,767	35,778,767	-
(1) 未払手数料	1,222,461	1,222,461	-
(2) 未払費用(*)	807,875	807,875	-
負債計	2,030,337	2,030,337	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産



## (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収入金

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。

## (5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている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」をご参照下さい。

## (6) 長期差入保証金

敷金の性質及び賃貸借契約の期間から、時価は当該帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額によっております。

## 負債

## (1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	第46期（平成30年3月31日）	第47期（平成31年3月31日）
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

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ことから時価開示の対象としておりません。このため、(1) その他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

## (有価証券関係)

## 1.子会社株式

第46期(平成30年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)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。

第47期(平成31年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)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

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	7,683,969	7,850,063	166,093
小計	7,683,969	7,850,063	166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 51,135千円)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47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,207,351	1,967,041	240,309
小計	2,207,351	1,967,041	240,309
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	8,772,616	9,069,317	296,700
小計	8,772,616	9,069,317	296,700
合計	10,979,968	11,036,359	56,391

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 45,071千円)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。

## 3.当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額

その他	398,350	6,350	5,000
-----	---------	-------	-------

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,433,609	45,345	4,735

(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、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、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.簡便法を適用した確定給付制度

(1)簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,482,500	1,540,203
退職給付費用	147,235	248,717
退職給付の支払額	105,520	61,499
その他	15,987	20,359
退職給付引当金の期末残高	1,540,203	1,707,062

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

(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の調整表

(単位:千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062

(3)退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第46期 147,235千円 第47期 248,717千円

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第46期は72,489千円、第47期は75,365千円であります。

(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

(単位:千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
--	----------------------	----------------------

繰延税金資産		
未払事業税	71,030	23,058
賞与引当金	386,761	308,355
社会保険料	30,549	27,751
未払事業所税	4,247	4,370
退職給付引当金	471,610	522,702
資産除去債務	-	77,318
投資有価証券	67,546	65,422
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	26,961	-
その他有価証券評価差額金	-	17,266
その他	74,458	83,141
繰延税金資産小計	1,144,165	1,140,388
評価性引当額	78,546	76,422
繰延税金資産合計	1,065,618	1,063,965
繰延税金負債		
建物	-	54,715
その他有価証券評価差額金	24,367	-
繰延税金負債合計	24,367	54,715
繰延税金資産の純額	1,041,251	1,009,250

## 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

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.80%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.09%
特定外国子会社等課税対象金額	-	1.99%
税額控除	-	0.64%
その他	-	0.36%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	32.50%

(注) 前事業年度は、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。

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該契約に基づく退去予定期限までの期間を使用見込期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について合理的な見積りが可能となったことから、「(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法」に記載の算定方法に則り、資産除去債務の金額を計算しております。資産除去債務の残高の推移は次のとおりであります。

(単位：千円)

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
期首残高	-	-
見積りの変更による増加額	-	248,260
期末残高	-	248,260

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」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46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

第47期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	24,415,734	4,252,374	66,957	28,735,066

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 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)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 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)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,328,153	未払手数料	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,465,685	未払手数料	228,197

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

## （1株当たり情報）

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

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

1株当たりの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46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
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(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

## （重要な後発事象）

当社は、平成30年9月28日付で締結した、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

## 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。

- イ 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。)
- ロ 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。)
- ハ 通常の取引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。
- ニ 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。
- ホ 上記ハ、ニ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

### イ 定款の変更、その他の重要事項

#### (イ) 定款の変更

- a . 2018年11月 1 日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。
- b . 2019年 4 月 1 日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。

#### (ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年 4 月 1 日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D S アセットマネジメント株式会社に変更しました。

- 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

[前へ](#)



## 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

下線部は訂正部分を示します。

&lt; 訂正前 &gt;

## (1) 受託会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年9月末現在	事業の内容

(以下略)

&lt; 参考: 再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)の概要 &gt;

・ 資本金: 51,000百万円(2018年9月末現在)

(以下略)

## (2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年9月末現在	事業の内容

(以下略)

&lt; 訂正後 &gt;

## (1) 受託会社

名称	資本金の額(百万円) 2019年3月末現在	事業の内容

(以下略)

&lt; 参考: 再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)の概要 &gt;

・ 資本金: 51,000百万円(2019年3月末現在)

(以下略)

## (2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2019年3月末現在	事業の内容

(以下略)

## 3 資本関係

下線部は訂正部分を示します。

&lt; 訂正前 &gt;

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当事項はありません。(2019年4月1日現在(予定))

&lt; 訂正後 &gt;

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当事項はありません。

以上

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
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  
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルC Bオープン・高金利通貨コースの平成30年11月20日から令和1年5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C Bオープン・高金利通貨コースの令和1年5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

三井住友DSアセットマネジメント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。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
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  
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルC Bオープン・円コースの平成30年11月20日から令和1年5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C Bオープン・円コースの令和1年5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

三井住友DSアセットマネジメント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。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
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  
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルC Bオープン（マネープールファンド）の平成30年11月20日から令和1年5月20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、グローバルC Bオープン（マネープールファンド）の令和1年5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

三井住友DSアセットマネジメント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。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
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 小澤 陽 一 印  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 菅野 雅子 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」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#)