

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成31年4月26日
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	植松 克彦
【電話番号】	03-5405-0784
【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】	N B マルチ戦略ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	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、半期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あります。

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D S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D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

(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。

(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D S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	https://www.smd-am.co.jp

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。

(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>

(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)

<訂正後>

(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4月1日現在）
- ・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4月1日現在）
(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8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) 分配方針

(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2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) 分配方針

(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））

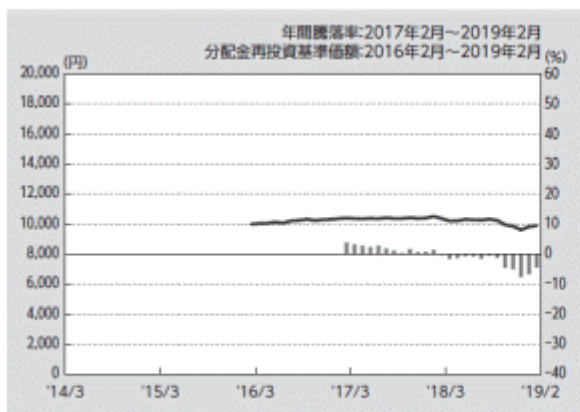
<訂正後>

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

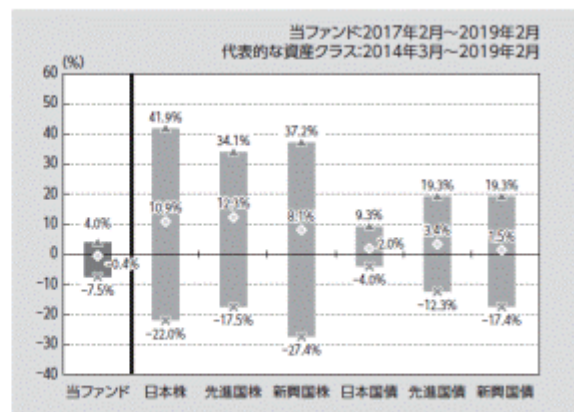


■ 年間騰落率(右目盛) — 分配金再投資基準価額(左目盛)

※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



◇ 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。

(注) 上記グラフにおいて、当ファンドと代表的な資産クラスのデータの期間が異なりますので、ご注意ください。

<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	野村証券株式会社
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>

(3) 信託報酬等

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0.756% (税抜0.70%) 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外国投資証券では、運用報酬が年率0.75%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1.506% (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。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および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年率0.01026% (税抜0.0095%) 以内の率を乗じて得た額とし、毎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。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8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>

(3) 信託報酬等

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0.756%^{*1} (税抜0.70%) 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外国投資証券では、運用報酬が年率0.75%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1.506%^{*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0.77%となります。

*2 消費税率が10%になった場合は、年率1.52%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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および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年率0.01026%^{*}(税抜0.0095%)以内の率を乗じて得た額とし、毎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。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。

*消費税率が10%になった場合は、年率0.01045%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2月末現在のもので、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。

NB マルチ戦略ファンド

(1) 投資状況

(2019年2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 (マネー・マネジメント・マザーファンド)	日本	9,980	0.01%
投資証券	アイルランド	153,648,860	97.57%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,821,487	2.43%
純資産総額		157,480,327	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2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	Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund JPY D Distributing Class アイルランド	投資証券	167,386.250	944.950	917.930	-	97.57%
		-		158,172,972	153,648,860	-	
2	マネー・マネジメント・マザー ファンド 日本	親投資信託受益 証券	9,989	0.9993	0.9991	-	0.01%
		-		9,983	9,980	-	

(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
投資証券	97.57%
親投資信託受益証券	0.01%
合計	97.57%

(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2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2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 (2016年2月17日)	10	-	1.0000	-
第1計算期間末 (2016年8月1日)	180	-	1.0223	-
第2計算期間末 (2017年8月1日)	289	-	1.0416	-
2018年2月末日	189	-	1.0378	-
2018年3月末日	186	-	1.0223	-
2018年4月末日	179	-	1.0231	-
2018年5月末日	175	-	1.0322	-
2018年6月末日	175	-	1.0292	-
2018年7月末日	194	-	1.0280	-
第3計算期間末 (2018年8月1日)	194	-	1.0278	-
2018年8月末日	195	-	1.0337	-
2018年9月末日	189	-	1.0256	-
2018年10月末日	173	-	0.9965	-
2018年11月末日	153	-	0.9866	-
2018年12月末日	149	-	0.9634	-
2019年1月末日	155	-	0.9832	-

2019年2月末日	157	-	0.9918	-
-----------	-----	---	--------	---

(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(2016年2月17日~2016年8月1日)	2.2%
第2期(2016年8月2日~2017年8月1日)	1.9%
第3期(2017年8月2日~2018年8月1日)	1.3%
第4期中(2018年8月2日~2019年2月1日)	4.1%

(注) 収益率 = (当計算期末分配付基準価額 - 前計算期末分配付基準価額) ÷ 前計算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期(2016年2月17日~2016年8月1日)	201,453,777	24,744,275
第2期(2016年8月2日~2017年8月1日)	287,295,499	186,390,110
第3期(2017年8月2日~2018年8月1日)	59,277,933	147,813,565
第4期中(2018年8月2日~2019年2月1日)	12,657,593	43,731,792

(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

マネー・マネジメント・マザーファンド

(1) 投資状況

(2019年2月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
特殊債券	日本	28,058,020	73.85%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,935,136	26.15%
純資産総額		37,993,156	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2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	7 政保原賠・廃炉 日本	特殊債券 -	10,000,000	100.05 10,005,400	100.02 10,002,810	0.0010 2019/06/21	26.33%
2	80 政保道路機構 日本	特殊債券 -	6,000,000	101.18 6,070,800	100.40 6,024,246	1.5000 2019/05/31	15.86%
3	77 政保道路機構 日本	特殊債券 -	6,000,000	100.86 6,051,966	100.07 6,004,536	1.3000 2019/03/19	15.80%
4	85 政保道路機構 日本	特殊債券 -	4,000,000	101.44 4,057,840	100.63 4,025,308	1.4000 2019/07/31	10.59%
5	6 政保地方公営機 日本	特殊債券 -	2,000,000	100.34 2,006,800	100.05 2,001,120	1.3000 2019/03/15	5.27%

(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	73.85%
合計	73.85%

(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2月末現在)

該当事項はありません。

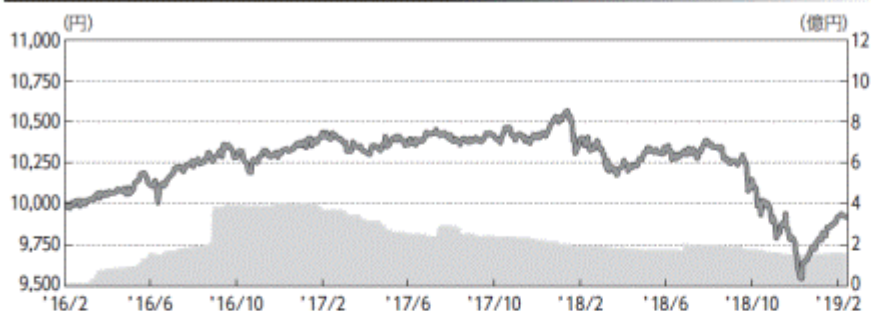
その他投資資産の主要なもの

(2019年2月末現在)

該当事項はありません。

(参考情報)

2019年2月28日現在

基準価額・純資産の推移 (設定日～2019年2月28日)

■ 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ものとして計算しております。

分配の推移

2018年 8月	0円
2017年 8月	0円
2016年 8月	0円
設定来累計	0円

*分配金は1万円当たり、税引前

主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund JPY D Distributing Class	97.6%
マネー・マネジメント・マザーファンド	0.0%

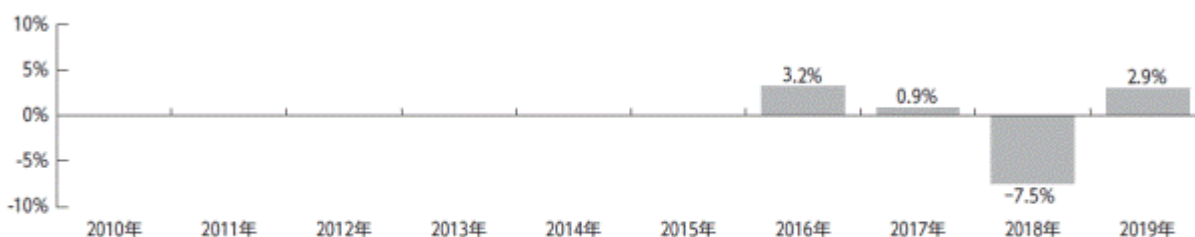
*投資比率は全て純資産総額対比

■ 参考情報

ニューバーガー・パーマン・アブソリュート・リターン・マルチ・ストラテジー・ファンド
 運用戦略別配分

運用戦略	配分比率
イベント・ドリブン戦略	10.7%
合併アービトラージ戦略	13.6%
株式リストラクチャリング戦略	0.0%
株式ロング・ショート戦略	21.5%
クレジット戦略	0.0%
資産担保付証券戦略	17.7%
グローバル・マクロ戦略	12.2%
CTA戦略	14.3%

*比率はニューバーガー・パーマン・アブソリュート・リターン・マルチ・ストラテジー・ファンドにおける純資産総額対比

年間収益率の推移

*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、2016年は当初設定日(2016年2月17日)から年末までの収益率、2019年は2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ものとして計算しております。

*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】

1 財務諸表

原届出書の「1 財務諸表」の末尾に、下記事項が追加されます。

中間財務諸表

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成30年8月2日から平成31年2月1日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による中間監査を受けております。

[次へ](#)

NBマルチ戦略ファンド

(1)中間貸借対照表

区分	当中間計算期間末 平成31年2月1日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,146,962
投資証券	151,250,233
親投資信託受益証券	9,981
流動資産合計	156,407,176
資産合計	156,407,176
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	23,299
未払委託者報酬	630,526
その他未払費用	8,888
流動負債合計	662,713
負債合計	662,713
純資産の部	
元本等	
元本	158,005,060
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	2,260,597
(分配準備積立金)	1,859,801
元本等合計	155,744,463
純資産合計	155,744,463
負債純資産合計	156,407,176

(2)中間損益及び剰余金計算書

区分	当中間計算期間 自 平成30年8月2日 至 平成31年2月1日 金額(円)
営業収益	
受取利息	36
有価証券売買等損益	6,470,107
営業収益合計	6,470,071
営業費用	
支払利息	2,214
受託者報酬	23,299
委託者報酬	630,526
その他費用	9,373
営業費用合計	665,412

営業利益又は営業損失()	7,135,483
経常利益又は経常損失()	7,135,483
中間純利益又は中間純損失()	7,135,483
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	649,412
期首剰余金又は期首欠損金()	5,259,350
剰余金増加額又は欠損金減少額	178,912
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	178,912
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,212,788
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,212,788
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	2,260,597

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当中間計算期間
	自 平成30年 8月 2日 至 平成31年 2月 1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資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。
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	当中間計算期間末 平成31年 2月 1日現在
1. 元本状況	
期首元本額	189,079,259円
期中追加設定元本額	12,657,593円
期中一部解約元本額	43,731,792円
2. 受益権の総数	158,005,060口
3. 元本の欠損	
	2,260,597円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間（自 平成30年 8月 2日 至 平成31年 2月 1日）

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	当中間計算期間末 平成31年 2月 1日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末（平成31年 2月 1日現在）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成31年 2月 1日現在
1口当たり純資産額	0.9857円 「1口 = 1円 (10,000口 = 9,857円)」

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「マネー・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、中間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。

マネー・マネジメント・マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成31年2月1日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,589,930
特殊債券	28,079,896
未収利息	11,107
前払費用	5,057
流動資産合計	37,685,990
資産合計	37,685,990
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,999
その他未払費用	183
流動負債合計	5,182
負債合計	5,182
純資産の部	
元本等	
元本	37,709,164
剰余金	
剰余金又は欠損金()	28,356
元本等合計	37,680,808
純資産合計	37,680,808
負債純資産合計	37,685,990

[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 8月 2日 至 平成31年 2月 1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債券 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	<p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成31年 2月 1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	49,264,829円
期中追加設定元本額	280,211円
期中一部解約元本額	11,835,876円
元本の内訳	
タフ・アメリカ（マネーブルファンド）	5,899,395円
米国小型株ツイン（毎月分配型）	552,681円
米国小型株ツイン（資産成長型）	71,698円
日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）	1,998,801円
欧州株ツイン（毎月分配型）	13,111円
欧州株ツイン（資産成長型）	96円
NBマルチ・ストラテジー・ファンド（ダイワSMA専用）	698,444円
NBハイクオリティ・マネジャーズ・ファンド（部分為替ヘッジあり）- 予想分配金提示型 -	900円
NBハイクオリティ・マネジャーズ・ファンド（為替ヘッジなし）- 予想分配金提示型 -	9,993円
米国リバーサル戦略ツイン ネオ（毎月分配型）	26,385,980円
米国リート厳選ファンド（毎月決算型）	249,776円
米国リート厳選ファンド（資産成長型）	249,776円
米国株アルファ・カルテット（毎月分配型）	799,281円
米国株厳選ファンド・米ドルコース	9,992円
米国株厳選ファンド・ブラジルリアルコース	9,992円
米国株厳選ファンド・豪ドルコース	9,992円
米国株厳選ファンド・高金利通貨コース	9,992円
米国リート・アルファ・カルテット（毎月分配型）	699,301円
NBマルチ戦略ファンド	9,989円
日本株アルファ・カルテット（年2回決算型）	9,990円
大和住銀/コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース（ダイワ投資一任専用）	9,992円
大和住銀/コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース（ダイワ投資一任専用）	9,992円
合計	37,709,164円
2. 受益権の総数	37,709,164口
3. 元本の欠損	28,356円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年 2月 1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。
------------	--

(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31年2月1日現在)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成31年2月1日現在	
1口当たり純資産額	0.9992円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,992円)」

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

純資産額計算書
(2019年2月末現在)

NBマルチ戦略ファンド

資産総額	157,578,640	円
負債総額	98,313	円
純資産総額(-)	157,480,327	円
発行済数量	158,786,000	口
1単位当り純資産額(/)	0.9918	円

(参考) マネー・マネジメント・マザーファンド

資産総額	38,008,153	円
負債総額	14,997	円
純資産総額(-)	37,993,156	円
発行済数量	38,025,945	口
1単位当り純資産額(/)	0.9991	円

[前へ](#)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(2019年4月1日現在(予定))

(以下略)

<訂正後>

(2019年4月1日現在)

(以下略)

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

「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。

委託会社は、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。

2019年2月28日現在における三井住友アセットマネジメント株式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(円)
追加型株式投資信託	464	5,803,219,248,546
単位型株式投資信託	92	473,733,279,263
追加型公社債投資信託	1	28,478,014,085
単位型公社債投資信託	114	305,096,584,535
合計	671	6,610,527,126,429

(ご参考)

2019年2月28日現在における大和住銀投信投資顧問株式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(円)
追加型株式投資信託	309	2,967,399,498,285
単位型株式投資信託	21	60,248,385,425
追加型公社債投資信託	-	-
単位型公社債投資信託	74	254,925,714,516

合 計	404	3,282,573,598,226
-----	-----	-------------------

3 委託会社等の経理状況

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

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する予定です。

(以下略)

< 訂正後 >

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。

(以下略)

5 その他

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

(以下略)

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う予定です。

(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する予定です。

(以下略)

< 訂正後 >

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

(以下略)

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。

(以下略)

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。

<訂正前>

(1)受託会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年3月末現在	事業の内容
(以下略)		

<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>

・資本金:51,000百万円(2018年3月末現在)

(以下略)

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年3月末現在	事業の内容
(以下略)		

西日本シティTT証券株式会社 ^(注)	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ほくほくTT証券株式会社	1,250	

(注)西日本シティTT証券株式会社の資本金の額は、2018年6月29日現在です。

<訂正後>

(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)		

<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>

・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)		

西日本シティTT証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ほくほくTT証券株式会社	1,250	

3 資本関係

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(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))

<訂正後>

(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

独立監査人の中間監査報告書

平成31年3月8日

大和住銀投信投資顧問株式会社
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているNBマルチ戦略ファンドの平成30年8月2日から平成31年2月1日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、NBマルチ戦略ファンドの平成31年2月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年8月2日から平成31年2月1日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

(注2) XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。