

【表紙】

| | |
|--|----------------------|
| 【提出書類】 | 訂正有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成30年10月16日提出 |
| 【発行者名】 | 三菱UFJ国際投信株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 松田 通 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 伊藤 晃 |
| 【電話番号】 | 03-6250-4740 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | 1兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成30年4月13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。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

当ファンドは、信託財産の成長をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、1兆円です。

* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉) | 独立区分 | 補足分類 |
|---------|--------|-------------------|------|------------|
| 単位型 | 国内 | 株式 | MMF | インデックス型 |
| | | 債券 | | |
| 追加型 | 海外 | 不動産投信 | MRF | 特殊型 () |
| | 内外 | その他資産 () | ETF | |
| | | 資産複合 | | |

属性区分表

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替 ヘッジ | 対象 インデックス | 特殊型 |
|---|--|--|----------------------|-----------|---------------------|---|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 年2回 年4回 年6回 | グローバル (日本を除く) | ファミリー ファンド | あり () | 日経225 | ブル・ベア型 |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 () | (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 () | 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング | ファンド・ オブ・ ファンズ | なし | TOPIX その他 () | 条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 () |
| 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券一 般)) | | | | | | |
| 資産複合 () | | | | | | |

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけ

ます。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

商品分類の定義

| | | |
|---------|-----------------------|--|
| 単位型・追加型 | 単位型 | 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われずファンドをいいます。 |
| | 追加型 | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。 |
| 投資対象地域 | 国内 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 海外 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 内外 | 信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資対象資産 | 株式 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 債券 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 不動産投信（リート） | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | その他資産 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 資産複合 | 信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 独立区分 | MMF（マネー・マネージメント・ファンド） | 一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。 |
| | MRF（マネー・リザーブ・ファンド） | 一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。 |
| | ETF | 投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。 |
| 補足分類 | インデックス型 | 信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。 |
| | 特殊型 | 信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。 |

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

| | | | |
|--------|----|------|---------------------------------------|
| 投資対象資産 | 株式 | 一般 | 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。 |
| | | 大型株 | 信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | | 中小型株 | 信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 債券 | 一般 | 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。 |

| | | |
|--------|--|---|
| | 公債 | 信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 社債 | 信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | その他債券 | 信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | クレジット属性 | 目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。 |
| | 不動産投信 | 信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | その他資産 | 信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 資産複合 | 信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 決算頻度 | 年1回 | 信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 年2回 | 信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 年4回 | 信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 年6回（隔月） | 信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 年12回（毎月） | 信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 日々 | 信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| | その他 | 上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。 |
| 投資対象地域 | グローバル | 信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 日本 | 信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 北米 | 信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 欧州 | 信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | アジア | 信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | オセアニア | 信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 中南米 | 信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | アフリカ | 信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 中近東（中東） | 信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| エマージング | 信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 | |
| 投資形態 | ファミリーファンド | 信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。 |

| | | |
|----------|---------------------|--|
| | ファンド・オブ・ファンズ | 一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。 |
| 為替ヘッジ | あり | 信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。 |
| | なし | 信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。 |
| 対象インデックス | 日経225 | 信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。 |
| | TOPIX | 信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。 |
| | その他 | 信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。 |
| 特殊型 | ブル・ベア型 | 信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。 |
| | 条件付運用型 | 信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。 |
| | ロング・ショート型 / 絶対収益追求型 | 信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。 |
| | その他 | 信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。 |

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を除く世界のハイ・イールド債券および投資適格債券を実質的な主要投資対象とし、高い利子収入の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色 1

高い利子収入の獲得をめざして高利回り債券および投資適格債券に投資します。

- 日本を除く世界の高利回り債券(ハイ・イールド債券)を50%程度、投資適格債券を50%程度、実質的に組み入れます。
- 高利回り債券および投資適格債券への実質的な投資は、2本の円建外国投資信託への投資を通じてそれぞれ行います。
- 実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

1 日本が発行体が発行する円建て以外の債券に投資することがあります。



高利回り債券とは

格付会社(S&Pグローバル・レーティング(S&P)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)など)によりBB格相当以下の低い格付けを付与された債券をいいます。

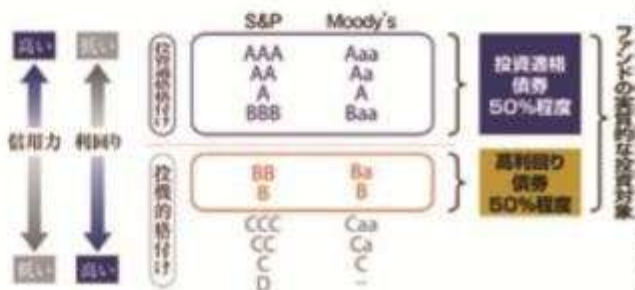
一般的に高利回り債券は、投資適格債券(BBB格相当以上)と比較して、債券の元本や利子の支払いが滞ることや、支払われなくなるリスクが高いため、通常、その見返りとして投資適格債券よりも高い利回りを投資家に提供しています。

つまり、高利回り債券は、主として社債を中心とした低格付けの発行体が発行する債券で、信用力が低い反面、高い利回りが期待できる債券です。

債券の格付けについて

格付けとは、債券の中長期的な元本・利子の支払いの確実性の度合いについてランク付けしたものです。これは、アルファベットを使った簡単な記号で表現されており、世界各国、産業別の債券について比較しやすいため、広く利用されています。

S&PのAAからCCCまでの格付けには「+」、「-」、Moody'sのAaからCaaまでの格付けには「1」、「2」、「3」という付加記号を省略して表示しています。



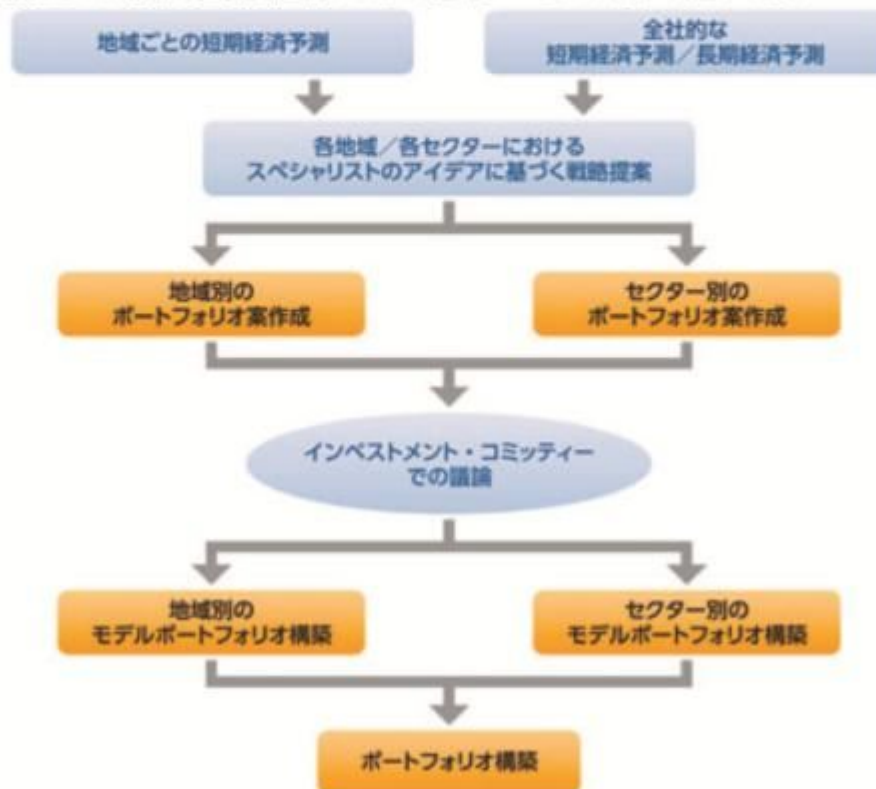
上記は格付けと利回りの間の一般的な関係を示したイメージ図であり、利回りは格付け以外の要因によっても変動するため、この関係通りの利回りが成立しない場合があります。

<ファンドの実質的な主要投資対象等>

- ◆ 高利回り債券は、日本を除く世界各国の社債等を実質的な主要投資対象とします。
 - ◆ 投資適格債券は、日本を除く世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)等を実質的な主要投資対象とします。
 - ◆ 実質的に投資する債券は、原則として購入時において、高利回り債券はB-格相当以上の、投資適格債券はBBB-格相当以上の格付けを取得しているものに限定します。組入債券の平均格付けは、ファンド全体で原則としてBBB-格相当以上を維持します。
 - ◆ 同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、原則として、ファンド全体の純資産総額の1.5%程度を上限とします(国債や政府機関債等を除きます)。
 - ◆ 実質的な組入債券の平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年以内とします。
- デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。
- ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

<運用プロセスのイメージ>

- ◆ 投資対象とする円建外国投資信託における運用プロセスは以下の通りです。



1 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

<ファンドのベンチマークについて>

ファンドが投資する2本の外国投資信託のベンチマークおよびそれらを合成したファンド全体のベンチマークは下表の通りです。

| | 投資適格債券運用を行う 外国投資信託 | 高利回り債券運用を行う 外国投資信託 |
|--------------------------|---|---|
| ピムコ ハイ・インカム 毎月分配型ファンド | ブルームバーグ・ パークレイズ・ グローバル総合 (日本円除く)インデックス (円ベース) | ICE BofAML 先進国 ハイ・イールド・ コンストレインド指数 (BB-B、円ベース) |

- 1 ファンド全体では、高利回り債券運用を行う外国投資信託と投資適格債券運用を行う外国投資信託にそれぞれ50%程度ずつ投資します。
- 2 ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスとは、ブルームバーグが算出する世界の投資適格債券(円建てのものを除く)の値動きを表す指数です。
- 3 ICE BofAML 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数(BB-B)とは、ICE Data Indices, LLCが算出する主な先進国のハイ・イールド債券の値動きを表す指数です。同指数は、ICE Data Indices, LLC, ICE Dataまたはその第三者の財産であり、三菱UFJ国際投信は許諾に基づき使用しています。ICE Dataおよびその第三者は、使用に関して一切の責任を負いません。

特色2

グローバル債券運用で実績のあるピムコ社が運用を担当します。

- 三菱UFJ国際投信は、運用の指図に関する権限をピムコジャパンリミテッドに委託します。
- ピムコジャパンリミテッドは、ピムコ社が運用する2本の円建外国投資信託を通じて日本を除く世界の高利回り債券および投資適格債券に投資します。

ピムコ社とは

ピムコ社(PIMCO=Pacific Investment Management Company LLC)は1971年に米国で設立された債券運用に強みを持つ会社です。ピムコジャパンリミテッドは、PIMCOグループの日本における拠点です。

- 1 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

特色3

毎月の安定分配をめざします。

- 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として、利子収入等を中心に、経費等を勘案して安定分配を行うことをめざします。
- ベンチマークの最終利回りを基準とした分配をめざします。
ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わないことがあります。また、分配金額は運用実績に応じて変動します。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。

収益分配金に関する留意事項

- ◆分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



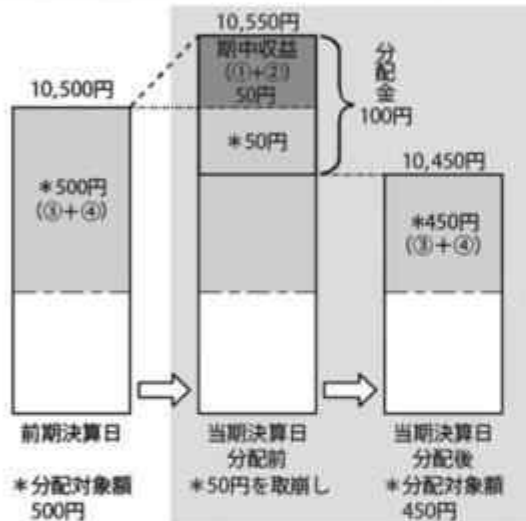
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。

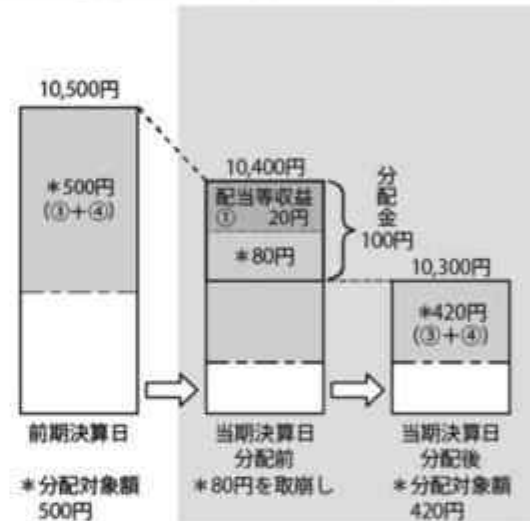
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



前期決算日から基準価額が下落した場合



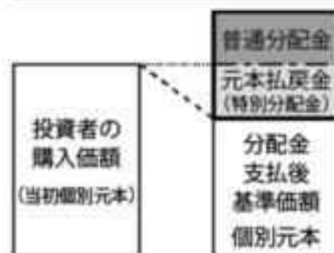
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

分配準備積立金：当期の①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益のうち、当期分配金として支払わなかった残りの金額をいいます。信託財産に留保され、次期以降の分配金の支払いに充当できる分配対象額となります。

収益調整金：追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

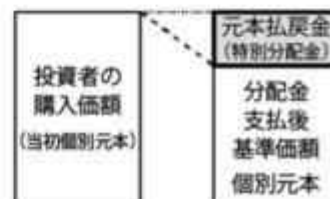
- ◆投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



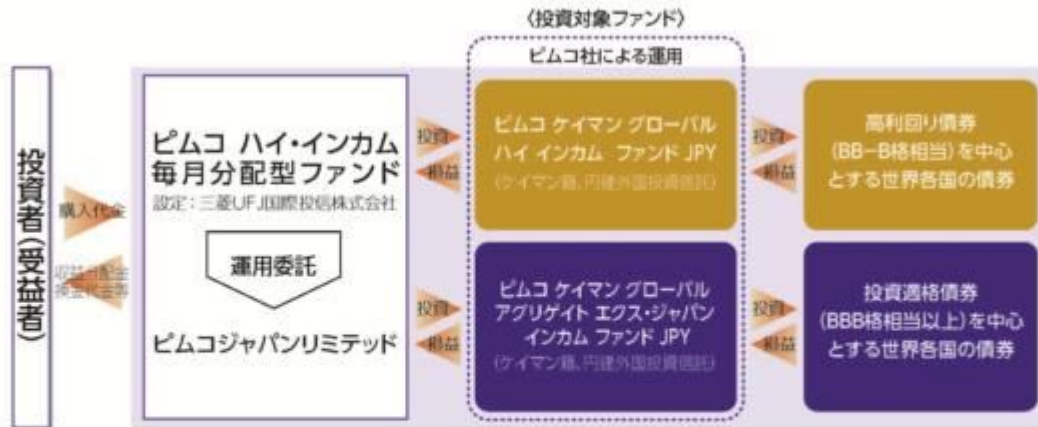
普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照ください。

■ファンドの仕組み

運用はファンド・オブ・ファンズ方式により行います。



■主な投資制限

| | |
|--------|------------------------|
| 投資信託証券 | 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 |
| 外貨建資産 | 外貨建資産への直接投資は行いません。 |

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

委託会社と関係法人との契約の概要

| | 概要 |
|--------------------------------------|---|
| 委託会社と受託会社との契約 「信託契約」 | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。 |
| 委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」 | 運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬等が定められています。 |

委託会社の概況（平成30年1月末現在）

- ・ 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・ 設立年月日
昭和60年8月1日
- ・ 資本金
2,000百万円

- ・沿革
 - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
 - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況（平成30年4月2日現在）

| 株主名 | 住所 | 所有株式数 | 所有比率 |
|---------------|-------------------|----------|--------|
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号 | 211,581株 | 100.0% |

<訂正後>

委託会社と関係法人との契約の概要

| | 概要 |
|--------------------------------------|---|
| 委託会社と受託会社との契約 「信託契約」 | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。 |
| 委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」 | 運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬等が定められています。 |

委託会社の概況（平成30年7月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
昭和60年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
 - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
 - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況

| 株主名 | 住所 | 所有株式数 | 所有比率 |
|---------------|-------------------|----------|--------|
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号 | 211,581株 | 100.0% |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

投資信託証券を主要投資対象とします。

主として円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Yおよびピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド J P Yの投資信託証券への投資を通じて、世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等を実質的な投資を行います。

BofAメリルリンチ デベロップド・マーケッツ・ハイイールド・インデックス（BB-B、円ベース） × 50% + ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円ベース） × 50%の合成指数をベンチマークとします。

各投資信託証券の組入比率は、それぞれ純資産総額の50%程度となるように調整します。

実質的に投資する公社債は、原則として取得時においてB - 格相当以上の格付けを有しているものに限るものとし、ポートフォリオの実質的な平均格付けは原則としてBBB - 格相当以上を維持します。

ポートフォリオの実質的な平均デュレーションは原則としてベンチマーク ± 2年以内で調整します。

実質的な組入外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。

当ファンドの運用目標を達成するため、投資対象ファンドの具体的な投資先を重視して、グローバル債券運用で長期の実績を有し、債券運用に強みを持つ会社であるピムコ社が運用を行う「ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y」および「ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド J P Y」を選定しました。

運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。^(注)

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(注) 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

<訂正後>

投資信託証券を主要投資対象とします。

主として円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Yおよびピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド J P Yの投資信託証券への投資を通じて、世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等を実質的な投資を行います。

ICE BofAML 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（BB-B、円ベース） × 50% + ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円ベース） × 50%の合成指数をベンチマークとします。

各投資信託証券の組入比率は、それぞれ純資産総額の50%程度となるように調整します。

実質的に投資する公社債は、原則として取得時においてB - 格相当以上の格付けを有しているものに限るものとし、ポートフォリオの実質的な平均格付けは原則としてBBB - 格相当以上を維持します。

ポートフォリオの実質的な平均デュレーションは原則としてベンチマーク ± 2年以内で調整します。

実質的な組入外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。

当ファンドの運用目標を達成するため、投資対象ファンドの具体的な投資先を重視して、グローバル債券運用で長期の実績を有し、債券運用に強みを持つ会社であるピムコ社が運用を行う「ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y」および「ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド J P Y」を選定しました。

運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。^(注)

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(注) 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

（２）【投資対象】

<更新後>

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド ＪＰＹおよびピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド ＪＰＹの受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。以下「投資信託証券」といいます。）のほか、次に掲げるものとします。なお、当該有価証券は本邦通貨表示のものに限ります。

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

２．コマーシャル・ペーパー

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

４．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、１．の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

<投資信託証券の概要>

| | | |
|--------------|--|--|
| ファンド名 | ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY | ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY |
| 形態 | ケイマン籍・円建外国投資信託 | |
| 投資態度 | ベンチマークであるICE BofAML 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数(BB-B、円ベース)を上回る投資成果をめざします。 | ベンチマークであるブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円ベース)を上回る投資成果をめざします。 |
| 主な投資対象 | 世界各国の社債等 | |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・通常、ファンドの80%以上をBBB一格相当未満の格付けを取得している公社債に投資します。 ・投資する公社債は原則として取得時においてB一格相当以上の格付けを取得しているものに限りません。 ・投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてB一格相当以上に維持します。 ・ポートフォリオの平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。 ・同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の3%以内とします(国債や政府機関債等を除きます。) ・エマージング債への投資は行いません。 ・原則として、為替ヘッジは行いません。 | <ul style="list-style-type: none"> ・投資する公社債は原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付けを取得しているものに限りません。 ・投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてAA一格相当以上に維持します。 ・ポートフォリオの平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。 ・同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の3%以内とします(国債や政府機関債等を除きます。) ・エマージング債への投資は行いません。 ・原則として、為替ヘッジは行いません。 |
| 運用管理費用(信託報酬) | ありません。 | |
| 購入時手数料 | ありません。 | |
| 信託財産留保額 | ありません。 | |
| 投資運用会社 | Pacific Investment Management Company LLC (PIMCO) | |
| 設定日 | 2003年8月8日 | |
| 決算日 | 原則として毎年2月28日 | |
| 分配方針 | 原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。 | |

3【投資リスク】

<更新後>

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

価格変動リスク

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の公社債は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

当ファンドは、格付けの低いハイイールド債券を実質的な主要投資対象としており、格付けの高い公社債への投資を行う場合に比べ、価格変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・一般的に金利が低下した場合、資産担保証券（MBS、ABS）の担保となるローンの期限前返済が増加し、資産担保証券の期限前償還が増加することがあります。そのため当初期待した利回りでの再投資ができない可能性、もしくは証券を額面価額より高く購入している場合、償還損を被る可能性等があります。

（2）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議

体等に報告されます。

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

〔再委託先の管理体制〕

リスク管理およびコンプライアンスの機能は、運用部門から独立したコンプライアンスおよびオペレーション・リスク管理部門によって実施しております。同部門により、全てのファンドについて投資ガイドライン違反やリスク管理指標からの逸脱がないかどうかのチェックを行なっています。

また、このほかに、投資ガイドラインなどに関するチェックの機能としては、コンプライアンス・スクリーニング・システムにより売買執行前および執行後のモニタリングを行いチェックします。

< 投資対象ファンド（国内投資信託を除く）の信用リスク管理方法 >

投資対象ファンドの管理会社および投資運用会社は、投資対象ファンドにおいて、欧州委員会が制定した指令（UCITS指令）に定めるリスク管理方法に基づき信用リスクを管理します。

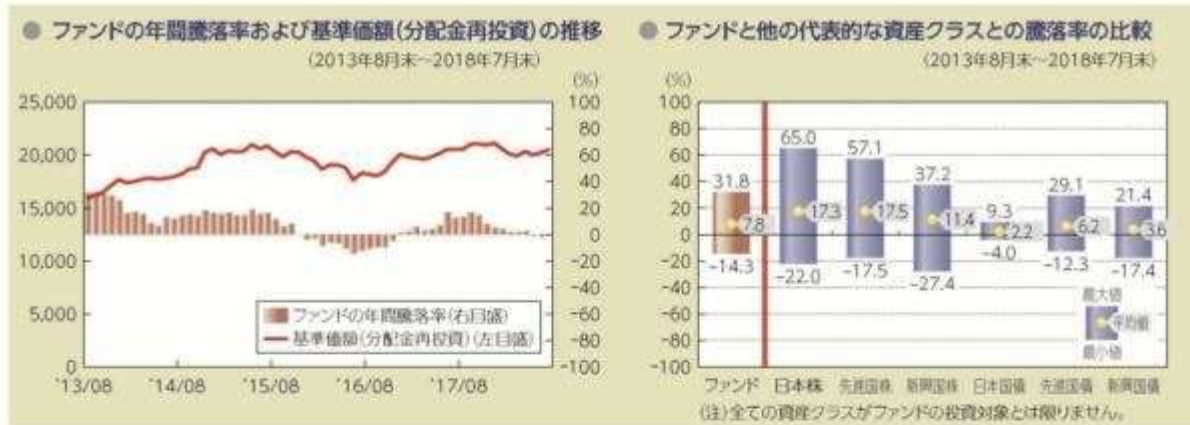
〔委託会社における再委託先に対する確認体制〕

委託会社と再委託先の間で、再委託先がファンド運用コンセプトを維持し、適切に投資リスク管理が図られるよう運用指図権限委託契約として委託内容を定めています。また、委託会社は再委託先に対し定期的に書面による調査等を実施し、投資リスクに対する管理体制の確認を行っています。

また、再委託先からの定期的なデ - タ還元を受け、ファンドのリスクの運営状況の確認を行っているほか、委託会社自身でもモニタリングし、投資リスクを管理しています。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- 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みなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名 | 注記等 |
|-------|-------------------------------|--|
| 日本株 | TOPIX(配当込み) | TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。 |
| 先進国株 | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み) | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。 |
| 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) | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。 |
| 日本国債 | NOMURA-BPI(国債) | NOMURA-BPIとは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。 |
| 先進国債 | FTSE世界国債インデックス(除く日本) | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 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 | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、JPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。 |

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

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

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成30年1月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

<訂正後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金(特別分配金)は課税されません。

原則として、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除は適用されません)・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます)を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失(譲渡損)については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得(申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります)との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA(少額投資非課税制度)およびジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料(税込)は含まれません)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回って

いる場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成30年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド】

（1）【投資状況】

平成30年 7月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 | 投資比率（%） |
|--------------------------|--------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | ケイマン諸島 | 75,981,209,437 | 99.81 |
| コール・ローン、その他資産 （負債控除後） | | 145,586,788 | 0.19 |
| 純資産総額 | | 76,126,796,225 | 100.00 |

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成30年 7月31日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|--------------|--|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| ケイマン 諸島 | 投資信託受益 証券 | ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY | 5,288,870.6314 | 7,420 | 39,243,420,084 | 7,360 | 38,926,087,847 | 51.13 |
| ケイマン 諸島 | 投資信託受益 証券 | ピムコ ケイマン グローバル アグ リゲイト エクス・ジャパン インカ ム ファンド JPY | 3,444,744.9652 | 10,929 | 37,647,617,724 | 10,757 | 37,055,121,590 | 48.68 |

（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評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成30年 7月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 99.81 |
| 合計 | 99.81 |

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成30年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

| | 純資産総額 | | 基準価額 (1万口当たりの純資産価額) | |
|-------------------------|-----------------|-----------------|------------------------|-------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第60計算期間末日 (平成20年 8月15日) | 460,005,085,507 | 462,627,633,683 | 9,296 | 9,349 |
| 第61計算期間末日 (平成20年 9月16日) | 432,185,478,353 | 434,805,130,634 | 8,744 | 8,797 |
| 第62計算期間末日 (平成20年10月15日) | 352,937,328,020 | 355,509,114,858 | 7,273 | 7,326 |
| 第63計算期間末日 (平成20年11月17日) | 318,605,761,115 | 321,158,635,917 | 6,615 | 6,668 |
| 第64計算期間末日 (平成20年12月15日) | 283,249,514,306 | 285,792,137,906 | 5,904 | 5,957 |
| 第65計算期間末日 (平成21年 1月15日) | 295,260,993,895 | 297,791,748,923 | 6,183 | 6,236 |
| 第66計算期間末日 (平成21年 2月16日) | 302,002,101,410 | 304,522,415,081 | 6,351 | 6,404 |
| 第67計算期間末日 (平成21年 3月16日) | 300,791,016,232 | 303,302,630,172 | 6,347 | 6,400 |
| 第68計算期間末日 (平成21年 4月15日) | 320,396,706,108 | 322,908,568,376 | 6,760 | 6,813 |
| 第69計算期間末日 (平成21年 5月15日) | 326,387,231,966 | 328,901,236,853 | 6,881 | 6,934 |
| 第70計算期間末日 (平成21年 6月15日) | 349,031,274,446 | 351,548,247,615 | 7,350 | 7,403 |
| 第71計算期間末日 (平成21年 7月15日) | 329,974,807,540 | 332,491,842,609 | 6,948 | 7,001 |
| 第72計算期間末日 (平成21年 8月17日) | 353,604,766,570 | 356,927,648,878 | 7,449 | 7,519 |
| 第73計算期間末日 (平成21年 9月15日) | 351,274,193,960 | 354,638,627,554 | 7,309 | 7,379 |
| 第74計算期間末日 (平成21年10月15日) | 358,228,942,115 | 361,644,730,383 | 7,341 | 7,411 |
| 第75計算期間末日 (平成21年11月16日) | 364,805,095,457 | 368,258,294,181 | 7,395 | 7,465 |
| 第76計算期間末日 (平成21年12月15日) | 361,675,427,159 | 365,165,463,773 | 7,254 | 7,324 |
| 第77計算期間末日 (平成22年 1月15日) | 380,705,661,232 | 384,227,726,511 | 7,566 | 7,636 |
| 第78計算期間末日 (平成22年 2月15日) | 366,196,397,094 | 369,754,251,740 | 7,205 | 7,275 |
| 第79計算期間末日 (平成22年 3月15日) | 377,386,901,546 | 380,976,765,796 | 7,359 | 7,429 |
| 第80計算期間末日 (平成22年 4月15日) | 395,163,479,838 | 398,802,859,404 | 7,601 | 7,671 |
| 第81計算期間末日 (平成22年 5月17日) | 381,343,048,960 | 385,025,141,240 | 7,250 | 7,320 |
| 第82計算期間末日 (平成22年 6月15日) | 374,206,295,246 | 377,913,770,123 | 7,065 | 7,135 |
| 第83計算期間末日 (平成22年 7月15日) | 371,806,974,886 | 375,545,003,940 | 6,963 | 7,033 |
| 第84計算期間末日 (平成22年 8月16日) | 368,268,068,975 | 372,022,832,125 | 6,866 | 6,936 |

| | | | | | |
|------------|---------------|-----------------|-----------------|-------|-------|
| 第85計算期間末日 | (平成22年 9月15日) | 358,176,721,477 | 361,948,423,275 | 6,647 | 6,717 |
| 第86計算期間末日 | (平成22年10月15日) | 363,100,397,326 | 366,881,260,606 | 6,723 | 6,793 |
| 第87計算期間末日 | (平成22年11月15日) | 361,029,736,519 | 364,813,471,087 | 6,679 | 6,749 |
| 第88計算期間末日 | (平成22年12月15日) | 352,842,293,832 | 356,625,329,211 | 6,529 | 6,599 |
| 第89計算期間末日 | (平成23年 1月17日) | 351,363,917,180 | 355,141,432,011 | 6,511 | 6,581 |
| 第90計算期間末日 | (平成23年 2月15日) | 350,337,717,076 | 354,091,494,434 | 6,533 | 6,603 |
| 第91計算期間末日 | (平成23年 3月15日) | 341,318,782,146 | 345,040,396,160 | 6,420 | 6,490 |
| 第92計算期間末日 | (平成23年 4月15日) | 347,056,695,055 | 350,758,656,369 | 6,562 | 6,632 |
| 第93計算期間末日 | (平成23年 5月16日) | 335,542,601,728 | 339,244,450,956 | 6,345 | 6,415 |
| 第94計算期間末日 | (平成23年 6月15日) | 329,959,908,560 | 332,847,819,931 | 6,284 | 6,339 |
| 第95計算期間末日 | (平成23年 7月15日) | 308,912,043,362 | 311,678,400,956 | 6,142 | 6,197 |
| 第96計算期間末日 | (平成23年 8月15日) | 283,702,599,752 | 286,390,763,644 | 5,805 | 5,860 |
| 第97計算期間末日 | (平成23年 9月15日) | 271,677,074,997 | 274,299,243,564 | 5,698 | 5,753 |
| 第98計算期間末日 | (平成23年10月17日) | 262,159,705,692 | 264,708,842,989 | 5,656 | 5,711 |
| 第99計算期間末日 | (平成23年11月15日) | 256,548,247,883 | 259,023,265,044 | 5,701 | 5,756 |
| 第100計算期間末日 | (平成23年12月15日) | 247,435,363,218 | 249,842,444,650 | 5,654 | 5,709 |
| 第101計算期間末日 | (平成24年 1月16日) | 239,793,959,984 | 242,140,396,403 | 5,621 | 5,676 |
| 第102計算期間末日 | (平成24年 2月15日) | 240,915,291,966 | 243,182,754,846 | 5,844 | 5,899 |
| 第103計算期間末日 | (平成24年 3月15日) | 248,803,836,408 | 251,007,451,406 | 6,210 | 6,265 |
| 第104計算期間末日 | (平成24年 4月16日) | 235,898,856,319 | 238,064,744,763 | 5,990 | 6,045 |
| 第105計算期間末日 | (平成24年 5月15日) | 229,963,542,623 | 232,111,658,257 | 5,888 | 5,943 |
| 第106計算期間末日 | (平成24年 6月15日) | 219,811,230,290 | 221,926,805,810 | 5,715 | 5,770 |
| 第107計算期間末日 | (平成24年 7月17日) | 217,851,106,106 | 219,942,408,419 | 5,729 | 5,784 |
| 第108計算期間末日 | (平成24年 8月15日) | 215,845,291,551 | 217,904,096,759 | 5,766 | 5,821 |
| 第109計算期間末日 | (平成24年 9月18日) | 218,328,575,707 | 220,353,773,972 | 5,929 | 5,984 |
| 第110計算期間末日 | (平成24年10月15日) | 212,616,733,515 | 214,612,938,584 | 5,858 | 5,913 |
| 第111計算期間末日 | (平成24年11月15日) | 209,773,250,335 | 211,716,893,750 | 5,936 | 5,991 |
| 第112計算期間末日 | (平成24年12月17日) | 214,619,094,481 | 216,506,931,989 | 6,253 | 6,308 |
| 第113計算期間末日 | (平成25年 1月15日) | 226,578,553,535 | 228,435,123,169 | 6,712 | 6,767 |
| 第114計算期間末日 | (平成25年 2月15日) | 228,012,816,180 | 229,166,923,599 | 6,915 | 6,950 |
| 第115計算期間末日 | (平成25年 3月15日) | 219,483,498,234 | 220,566,808,438 | 7,091 | 7,126 |
| 第116計算期間末日 | (平成25年 4月15日) | 219,513,092,915 | 220,553,078,910 | 7,388 | 7,423 |
| 第117計算期間末日 | (平成25年 5月15日) | 218,770,994,913 | 219,777,593,920 | 7,607 | 7,642 |
| 第118計算期間末日 | (平成25年 6月17日) | 193,361,603,598 | 194,336,572,870 | 6,941 | 6,976 |
| 第119計算期間末日 | (平成25年 7月16日) | 195,771,287,378 | 196,726,261,594 | 7,175 | 7,210 |
| 第120計算期間末日 | (平成25年 8月15日) | 188,481,069,381 | 189,416,525,281 | 7,052 | 7,087 |
| 第121計算期間末日 | (平成25年 9月17日) | 184,798,890,250 | 185,712,601,543 | 7,079 | 7,114 |
| 第122計算期間末日 | (平成25年10月15日) | 182,141,234,200 | 183,038,808,301 | 7,102 | 7,137 |
| 第123計算期間末日 | (平成25年11月15日) | 180,727,360,221 | 181,600,169,039 | 7,247 | 7,282 |
| 第124計算期間末日 | (平成25年12月16日) | 177,504,319,198 | 178,330,778,938 | 7,517 | 7,552 |
| 第125計算期間末日 | (平成26年 1月15日) | 168,077,461,853 | 168,854,487,286 | 7,571 | 7,606 |
| 第126計算期間末日 | (平成26年 2月17日) | 162,983,079,089 | 163,748,110,206 | 7,456 | 7,491 |
| 第127計算期間末日 | (平成26年 3月17日) | 160,186,148,566 | 160,936,594,670 | 7,471 | 7,506 |

| | | | | | |
|------------|---------------|-----------------|-----------------|-------|-------|
| 第128計算期間末日 | (平成26年 4月15日) | 158,661,150,758 | 159,400,527,505 | 7,511 | 7,546 |
| 第129計算期間末日 | (平成26年 5月15日) | 156,689,865,919 | 157,419,381,794 | 7,518 | 7,553 |
| 第130計算期間末日 | (平成26年 6月16日) | 154,303,909,654 | 155,020,931,314 | 7,532 | 7,567 |
| 第131計算期間末日 | (平成26年 7月15日) | 150,465,715,196 | 151,169,946,311 | 7,478 | 7,513 |
| 第132計算期間末日 | (平成26年 8月15日) | 147,862,120,297 | 148,554,393,169 | 7,476 | 7,511 |
| 第133計算期間末日 | (平成26年 9月16日) | 148,837,452,786 | 149,514,995,265 | 7,689 | 7,724 |
| 第134計算期間末日 | (平成26年10月15日) | 144,109,935,215 | 144,773,981,023 | 7,596 | 7,631 |
| 第135計算期間末日 | (平成26年11月17日) | 152,137,005,034 | 152,783,998,642 | 8,230 | 8,265 |
| 第136計算期間末日 | (平成26年12月15日) | 149,643,218,922 | 150,274,941,645 | 8,291 | 8,326 |
| 第137計算期間末日 | (平成27年 1月15日) | 144,578,522,987 | 145,201,560,882 | 8,122 | 8,157 |
| 第138計算期間末日 | (平成27年 2月16日) | 144,003,481,633 | 144,616,352,990 | 8,224 | 8,259 |
| 第139計算期間末日 | (平成27年 3月16日) | 141,222,523,614 | 141,824,201,761 | 8,215 | 8,250 |
| 第140計算期間末日 | (平成27年 4月15日) | 137,960,628,785 | 138,552,772,166 | 8,154 | 8,189 |
| 第141計算期間末日 | (平成27年 5月15日) | 136,423,676,081 | 137,008,415,551 | 8,166 | 8,201 |
| 第142計算期間末日 | (平成27年 6月15日) | 136,224,703,959 | 136,798,375,848 | 8,311 | 8,346 |
| 第143計算期間末日 | (平成27年 7月15日) | 132,333,863,493 | 132,896,707,817 | 8,229 | 8,264 |
| 第144計算期間末日 | (平成27年 8月17日) | 130,587,385,357 | 131,139,706,890 | 8,275 | 8,310 |
| 第145計算期間末日 | (平成27年 9月15日) | 124,309,587,650 | 124,854,797,671 | 7,980 | 8,015 |
| 第146計算期間末日 | (平成27年10月15日) | 122,160,606,053 | 122,701,017,491 | 7,912 | 7,947 |
| 第147計算期間末日 | (平成27年11月16日) | 122,400,400,910 | 122,940,332,553 | 7,934 | 7,969 |
| 第148計算期間末日 | (平成27年12月15日) | 117,207,575,022 | 117,739,942,941 | 7,706 | 7,741 |
| 第149計算期間末日 | (平成28年 1月15日) | 111,874,085,290 | 112,399,409,901 | 7,454 | 7,489 |
| 第150計算期間末日 | (平成28年 2月15日) | 104,941,207,685 | 105,460,738,756 | 7,070 | 7,105 |
| 第151計算期間末日 | (平成28年 3月15日) | 108,042,147,044 | 108,557,201,555 | 7,342 | 7,377 |
| 第152計算期間末日 | (平成28年 4月15日) | 103,788,285,121 | 104,299,437,958 | 7,107 | 7,142 |
| 第153計算期間末日 | (平成28年 5月16日) | 102,971,727,488 | 103,479,785,408 | 7,094 | 7,129 |
| 第154計算期間末日 | (平成28年 6月15日) | 98,793,620,006 | 99,296,636,337 | 6,874 | 6,909 |
| 第155計算期間末日 | (平成28年 7月15日) | 98,554,035,186 | 99,052,364,784 | 6,922 | 6,957 |
| 第156計算期間末日 | (平成28年 8月15日) | 94,404,166,093 | 94,686,664,768 | 6,684 | 6,704 |
| 第157計算期間末日 | (平成28年 9月15日) | 92,684,164,933 | 92,958,664,143 | 6,753 | 6,773 |
| 第158計算期間末日 | (平成28年10月17日) | 92,227,750,571 | 92,498,094,108 | 6,823 | 6,843 |
| 第159計算期間末日 | (平成28年11月15日) | 91,596,809,250 | 91,862,821,969 | 6,887 | 6,907 |
| 第160計算期間末日 | (平成28年12月15日) | 95,872,977,999 | 96,133,196,402 | 7,369 | 7,389 |
| 第161計算期間末日 | (平成29年 1月16日) | 94,355,422,455 | 94,610,312,619 | 7,404 | 7,424 |
| 第162計算期間末日 | (平成29年 2月15日) | 92,178,649,951 | 92,429,121,443 | 7,360 | 7,380 |
| 第163計算期間末日 | (平成29年 3月15日) | 90,362,730,959 | 90,610,051,210 | 7,307 | 7,327 |
| 第164計算期間末日 | (平成29年 4月17日) | 86,644,856,295 | 86,889,556,514 | 7,082 | 7,102 |
| 第165計算期間末日 | (平成29年 5月15日) | 89,808,389,969 | 90,050,631,294 | 7,415 | 7,435 |
| 第166計算期間末日 | (平成29年 6月15日) | 86,981,619,327 | 87,221,246,739 | 7,260 | 7,280 |
| 第167計算期間末日 | (平成29年 7月18日) | 88,138,170,902 | 88,372,549,542 | 7,521 | 7,541 |
| 第168計算期間末日 | (平成29年 8月15日) | 85,563,658,890 | 85,796,149,696 | 7,361 | 7,381 |
| 第169計算期間末日 | (平成29年 9月15日) | 86,314,658,656 | 86,545,256,538 | 7,486 | 7,506 |
| 第170計算期間末日 | (平成29年10月16日) | 86,300,009,425 | 86,528,246,250 | 7,562 | 7,582 |

| | | | | |
|--------------------------|----------------|----------------|-------|-------|
| 第171計算期間末日 (平成29年11月15日) | 85,638,355,634 | 85,864,321,188 | 7,580 | 7,600 |
| 第172計算期間末日 (平成29年12月15日) | 84,574,276,206 | 84,798,140,633 | 7,556 | 7,576 |
| 第173計算期間末日 (平成30年 1月15日) | 83,660,400,112 | 83,882,868,972 | 7,521 | 7,541 |
| 第174計算期間末日 (平成30年 2月15日) | 78,433,795,066 | 78,653,985,288 | 7,124 | 7,144 |
| 第175計算期間末日 (平成30年 3月15日) | 77,528,923,558 | 77,747,704,929 | 7,087 | 7,107 |
| 第176計算期間末日 (平成30年 4月16日) | 78,135,512,983 | 78,352,663,915 | 7,196 | 7,216 |
| 第177計算期間末日 (平成30年 5月15日) | 77,504,823,137 | 77,720,273,813 | 7,195 | 7,215 |
| 第178計算期間末日 (平成30年 6月15日) | 76,651,484,866 | 76,865,042,974 | 7,179 | 7,199 |
| 第179計算期間末日 (平成30年 7月17日) | 77,359,976,398 | 77,571,456,737 | 7,316 | 7,336 |
| 平成29年 7月末日 | 87,335,323,143 | | 7,480 | |
| 8月末日 | 86,273,538,955 | | 7,459 | |
| 9月末日 | 87,258,875,429 | | 7,607 | |
| 10月末日 | 86,342,607,098 | | 7,609 | |
| 11月末日 | 84,754,277,060 | | 7,533 | |
| 12月末日 | 84,640,681,956 | | 7,591 | |
| 平成30年 1月末日 | 81,626,690,023 | | 7,380 | |
| 2月末日 | 78,790,556,854 | | 7,172 | |
| 3月末日 | 77,276,951,655 | | 7,093 | |
| 4月末日 | 78,290,204,937 | | 7,227 | |
| 5月末日 | 75,849,927,893 | | 7,076 | |
| 6月末日 | 75,923,894,811 | | 7,141 | |
| 7月末日 | 76,126,796,225 | | 7,226 | |

【分配の推移】

| | 1万口当たりの分配金 |
|---------|------------|
| 第60計算期間 | 53円 |
| 第61計算期間 | 53円 |
| 第62計算期間 | 53円 |
| 第63計算期間 | 53円 |
| 第64計算期間 | 53円 |
| 第65計算期間 | 53円 |
| 第66計算期間 | 53円 |
| 第67計算期間 | 53円 |
| 第68計算期間 | 53円 |
| 第69計算期間 | 53円 |
| 第70計算期間 | 53円 |
| 第71計算期間 | 53円 |
| 第72計算期間 | 70円 |
| 第73計算期間 | 70円 |
| 第74計算期間 | 70円 |
| 第75計算期間 | 70円 |

| | |
|----------|-----|
| 第76計算期間 | 70円 |
| 第77計算期間 | 70円 |
| 第78計算期間 | 70円 |
| 第79計算期間 | 70円 |
| 第80計算期間 | 70円 |
| 第81計算期間 | 70円 |
| 第82計算期間 | 70円 |
| 第83計算期間 | 70円 |
| 第84計算期間 | 70円 |
| 第85計算期間 | 70円 |
| 第86計算期間 | 70円 |
| 第87計算期間 | 70円 |
| 第88計算期間 | 70円 |
| 第89計算期間 | 70円 |
| 第90計算期間 | 70円 |
| 第91計算期間 | 70円 |
| 第92計算期間 | 70円 |
| 第93計算期間 | 70円 |
| 第94計算期間 | 55円 |
| 第95計算期間 | 55円 |
| 第96計算期間 | 55円 |
| 第97計算期間 | 55円 |
| 第98計算期間 | 55円 |
| 第99計算期間 | 55円 |
| 第100計算期間 | 55円 |
| 第101計算期間 | 55円 |
| 第102計算期間 | 55円 |
| 第103計算期間 | 55円 |
| 第104計算期間 | 55円 |
| 第105計算期間 | 55円 |
| 第106計算期間 | 55円 |
| 第107計算期間 | 55円 |
| 第108計算期間 | 55円 |
| 第109計算期間 | 55円 |
| 第110計算期間 | 55円 |
| 第111計算期間 | 55円 |
| 第112計算期間 | 55円 |
| 第113計算期間 | 55円 |
| 第114計算期間 | 35円 |
| 第115計算期間 | 35円 |
| 第116計算期間 | 35円 |
| 第117計算期間 | 35円 |
| 第118計算期間 | 35円 |

| | |
|----------|-----|
| 第119計算期間 | 35円 |
| 第120計算期間 | 35円 |
| 第121計算期間 | 35円 |
| 第122計算期間 | 35円 |
| 第123計算期間 | 35円 |
| 第124計算期間 | 35円 |
| 第125計算期間 | 35円 |
| 第126計算期間 | 35円 |
| 第127計算期間 | 35円 |
| 第128計算期間 | 35円 |
| 第129計算期間 | 35円 |
| 第130計算期間 | 35円 |
| 第131計算期間 | 35円 |
| 第132計算期間 | 35円 |
| 第133計算期間 | 35円 |
| 第134計算期間 | 35円 |
| 第135計算期間 | 35円 |
| 第136計算期間 | 35円 |
| 第137計算期間 | 35円 |
| 第138計算期間 | 35円 |
| 第139計算期間 | 35円 |
| 第140計算期間 | 35円 |
| 第141計算期間 | 35円 |
| 第142計算期間 | 35円 |
| 第143計算期間 | 35円 |
| 第144計算期間 | 35円 |
| 第145計算期間 | 35円 |
| 第146計算期間 | 35円 |
| 第147計算期間 | 35円 |
| 第148計算期間 | 35円 |
| 第149計算期間 | 35円 |
| 第150計算期間 | 35円 |
| 第151計算期間 | 35円 |
| 第152計算期間 | 35円 |
| 第153計算期間 | 35円 |
| 第154計算期間 | 35円 |
| 第155計算期間 | 35円 |
| 第156計算期間 | 20円 |
| 第157計算期間 | 20円 |
| 第158計算期間 | 20円 |
| 第159計算期間 | 20円 |
| 第160計算期間 | 20円 |
| 第161計算期間 | 20円 |

| | |
|----------|-----|
| 第162計算期間 | 20円 |
| 第163計算期間 | 20円 |
| 第164計算期間 | 20円 |
| 第165計算期間 | 20円 |
| 第166計算期間 | 20円 |
| 第167計算期間 | 20円 |
| 第168計算期間 | 20円 |
| 第169計算期間 | 20円 |
| 第170計算期間 | 20円 |
| 第171計算期間 | 20円 |
| 第172計算期間 | 20円 |
| 第173計算期間 | 20円 |
| 第174計算期間 | 20円 |
| 第175計算期間 | 20円 |
| 第176計算期間 | 20円 |
| 第177計算期間 | 20円 |
| 第178計算期間 | 20円 |
| 第179計算期間 | 20円 |

【収益率の推移】

| | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 第60計算期間 | 0.90 |
| 第61計算期間 | 5.36 |
| 第62計算期間 | 16.21 |
| 第63計算期間 | 8.31 |
| 第64計算期間 | 9.94 |
| 第65計算期間 | 5.62 |
| 第66計算期間 | 3.57 |
| 第67計算期間 | 0.77 |
| 第68計算期間 | 7.34 |
| 第69計算期間 | 2.57 |
| 第70計算期間 | 7.58 |
| 第71計算期間 | 4.74 |
| 第72計算期間 | 8.21 |
| 第73計算期間 | 0.93 |
| 第74計算期間 | 1.39 |
| 第75計算期間 | 1.68 |
| 第76計算期間 | 0.96 |
| 第77計算期間 | 5.26 |
| 第78計算期間 | 3.84 |
| 第79計算期間 | 3.10 |

| | |
|----------|------|
| 第80計算期間 | 4.23 |
| 第81計算期間 | 3.69 |
| 第82計算期間 | 1.58 |
| 第83計算期間 | 0.45 |
| 第84計算期間 | 0.38 |
| 第85計算期間 | 2.17 |
| 第86計算期間 | 2.19 |
| 第87計算期間 | 0.38 |
| 第88計算期間 | 1.19 |
| 第89計算期間 | 0.79 |
| 第90計算期間 | 1.41 |
| 第91計算期間 | 0.65 |
| 第92計算期間 | 3.30 |
| 第93計算期間 | 2.24 |
| 第94計算期間 | 0.09 |
| 第95計算期間 | 1.38 |
| 第96計算期間 | 4.59 |
| 第97計算期間 | 0.89 |
| 第98計算期間 | 0.22 |
| 第99計算期間 | 1.76 |
| 第100計算期間 | 0.14 |
| 第101計算期間 | 0.38 |
| 第102計算期間 | 4.94 |
| 第103計算期間 | 7.20 |
| 第104計算期間 | 2.65 |
| 第105計算期間 | 0.78 |
| 第106計算期間 | 2.00 |
| 第107計算期間 | 1.20 |
| 第108計算期間 | 1.60 |
| 第109計算期間 | 3.78 |
| 第110計算期間 | 0.26 |
| 第111計算期間 | 2.27 |
| 第112計算期間 | 6.26 |
| 第113計算期間 | 8.22 |
| 第114計算期間 | 3.54 |
| 第115計算期間 | 3.05 |
| 第116計算期間 | 4.68 |
| 第117計算期間 | 3.43 |
| 第118計算期間 | 8.29 |
| 第119計算期間 | 3.87 |
| 第120計算期間 | 1.22 |
| 第121計算期間 | 0.87 |
| 第122計算期間 | 0.81 |

| | |
|----------|------|
| 第123計算期間 | 2.53 |
| 第124計算期間 | 4.20 |
| 第125計算期間 | 1.18 |
| 第126計算期間 | 1.05 |
| 第127計算期間 | 0.67 |
| 第128計算期間 | 1.00 |
| 第129計算期間 | 0.55 |
| 第130計算期間 | 0.65 |
| 第131計算期間 | 0.25 |
| 第132計算期間 | 0.44 |
| 第133計算期間 | 3.31 |
| 第134計算期間 | 0.75 |
| 第135計算期間 | 8.80 |
| 第136計算期間 | 1.16 |
| 第137計算期間 | 1.61 |
| 第138計算期間 | 1.68 |
| 第139計算期間 | 0.31 |
| 第140計算期間 | 0.31 |
| 第141計算期間 | 0.57 |
| 第142計算期間 | 2.20 |
| 第143計算期間 | 0.56 |
| 第144計算期間 | 0.98 |
| 第145計算期間 | 3.14 |
| 第146計算期間 | 0.41 |
| 第147計算期間 | 0.72 |
| 第148計算期間 | 2.43 |
| 第149計算期間 | 2.81 |
| 第150計算期間 | 4.68 |
| 第151計算期間 | 4.34 |
| 第152計算期間 | 2.72 |
| 第153計算期間 | 0.30 |
| 第154計算期間 | 2.60 |
| 第155計算期間 | 1.20 |
| 第156計算期間 | 3.14 |
| 第157計算期間 | 1.33 |
| 第158計算期間 | 1.33 |
| 第159計算期間 | 1.23 |
| 第160計算期間 | 7.28 |
| 第161計算期間 | 0.74 |
| 第162計算期間 | 0.32 |
| 第163計算期間 | 0.44 |
| 第164計算期間 | 2.80 |
| 第165計算期間 | 4.98 |

| | |
|----------|------|
| 第166計算期間 | 1.82 |
| 第167計算期間 | 3.87 |
| 第168計算期間 | 1.86 |
| 第169計算期間 | 1.96 |
| 第170計算期間 | 1.28 |
| 第171計算期間 | 0.50 |
| 第172計算期間 | 0.05 |
| 第173計算期間 | 0.19 |
| 第174計算期間 | 5.01 |
| 第175計算期間 | 0.23 |
| 第176計算期間 | 1.82 |
| 第177計算期間 | 0.26 |
| 第178計算期間 | 0.05 |
| 第179計算期間 | 2.18 |

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

（４）【設定及び解約の実績】

| | 設定口数 | 解約口数 | 発行済口数 |
|---------|---------------|----------------|-----------------|
| 第60計算期間 | 2,914,315,017 | 3,023,812,724 | 494,820,410,708 |
| 第61計算期間 | 2,644,333,573 | 3,190,728,840 | 494,274,015,441 |
| 第62計算期間 | 1,309,946,941 | 10,341,162,707 | 485,242,799,675 |
| 第63計算期間 | 1,829,474,795 | 5,397,783,501 | 481,674,490,969 |
| 第64計算期間 | 1,342,733,391 | 3,276,922,408 | 479,740,301,952 |
| 第65計算期間 | 1,222,566,774 | 3,461,919,869 | 477,500,948,857 |
| 第66計算期間 | 1,156,659,121 | 3,126,726,489 | 475,530,881,489 |
| 第67計算期間 | 1,045,266,258 | 2,686,725,059 | 473,889,422,688 |
| 第68計算期間 | 1,646,260,534 | 1,599,406,210 | 473,936,277,012 |
| 第69計算期間 | 1,958,759,003 | 1,554,491,126 | 474,340,544,889 |
| 第70計算期間 | 2,496,058,747 | 1,936,005,590 | 474,900,598,046 |
| 第71計算期間 | 2,301,421,929 | 2,289,742,653 | 474,912,277,322 |
| 第72計算期間 | 1,777,362,212 | 1,992,166,902 | 474,697,472,632 |
| 第73計算期間 | 7,627,271,915 | 1,691,373,867 | 480,633,370,680 |
| 第74計算期間 | 8,769,890,266 | 1,433,508,282 | 487,969,752,664 |
| 第75計算期間 | 6,894,092,958 | 1,549,742,157 | 493,314,103,465 |
| 第76計算期間 | 7,886,932,133 | 2,624,376,423 | 498,576,659,175 |
| 第77計算期間 | 6,480,296,734 | 1,904,773,140 | 503,152,182,769 |
| 第78計算期間 | 7,251,979,030 | 2,139,212,293 | 508,264,949,506 |
| 第79計算期間 | 6,755,315,728 | 2,182,515,118 | 512,837,750,116 |
| 第80計算期間 | 9,821,869,921 | 2,748,253,390 | 519,911,366,647 |
| 第81計算期間 | 8,381,193,070 | 2,279,376,844 | 526,013,182,873 |
| 第82計算期間 | 6,583,139,668 | 2,957,054,314 | 529,639,268,227 |

| | | | |
|----------|---------------|----------------|-----------------|
| 第83計算期間 | 6,583,711,172 | 2,218,828,767 | 534,004,150,632 |
| 第84計算期間 | 5,134,427,120 | 2,743,841,921 | 536,394,735,831 |
| 第85計算期間 | 5,828,232,445 | 3,408,425,688 | 538,814,542,588 |
| 第86計算期間 | 5,083,359,837 | 3,774,576,704 | 540,123,325,721 |
| 第87計算期間 | 4,429,951,010 | 4,019,766,878 | 540,533,509,853 |
| 第88計算期間 | 4,353,257,551 | 4,453,141,764 | 540,433,625,640 |
| 第89計算期間 | 3,149,359,773 | 3,938,009,416 | 539,644,975,997 |
| 第90計算期間 | 2,963,905,316 | 6,354,972,911 | 536,253,908,402 |
| 第91計算期間 | 3,285,166,595 | 7,879,930,123 | 531,659,144,874 |
| 第92計算期間 | 3,860,632,043 | 6,668,160,526 | 528,851,616,391 |
| 第93計算期間 | 4,250,154,149 | 4,266,166,404 | 528,835,604,136 |
| 第94計算期間 | 3,332,310,651 | 7,093,119,892 | 525,074,794,895 |
| 第95計算期間 | 1,352,890,391 | 23,453,577,275 | 502,974,108,011 |
| 第96計算期間 | 1,008,041,063 | 15,225,077,670 | 488,757,071,404 |
| 第97計算期間 | 927,855,084 | 12,927,005,063 | 476,757,921,425 |
| 第98計算期間 | 729,604,340 | 14,008,017,094 | 463,479,508,671 |
| 第99計算期間 | 633,196,651 | 14,109,585,026 | 450,003,120,296 |
| 第100計算期間 | 599,215,482 | 12,951,166,239 | 437,651,169,539 |
| 第101計算期間 | 639,254,711 | 11,665,620,688 | 426,624,803,562 |
| 第102計算期間 | 618,155,987 | 14,976,981,197 | 412,265,978,352 |
| 第103計算期間 | 685,908,388 | 12,294,614,284 | 400,657,272,456 |
| 第104計算期間 | 701,632,230 | 7,561,005,768 | 393,797,898,918 |
| 第105計算期間 | 783,412,805 | 4,014,832,635 | 390,566,479,088 |
| 第106計算期間 | 599,785,353 | 6,516,169,872 | 384,650,094,569 |
| 第107計算期間 | 546,801,426 | 4,960,111,754 | 380,236,784,241 |
| 第108計算期間 | 601,412,968 | 6,509,977,555 | 374,328,219,654 |
| 第109計算期間 | 620,646,382 | 6,730,999,567 | 368,217,866,469 |
| 第110計算期間 | 517,868,307 | 5,789,358,491 | 362,946,376,285 |
| 第111計算期間 | 689,551,378 | 10,246,215,759 | 353,389,711,904 |
| 第112計算期間 | 704,713,163 | 10,851,241,733 | 343,243,183,334 |
| 第113計算期間 | 823,706,831 | 6,508,774,860 | 337,558,115,305 |
| 第114計算期間 | 1,044,537,349 | 8,857,675,514 | 329,744,977,140 |
| 第115計算期間 | 460,843,144 | 20,688,619,093 | 309,517,201,191 |
| 第116計算期間 | 448,715,070 | 12,827,060,277 | 297,138,855,984 |
| 第117計算期間 | 431,103,204 | 9,970,242,901 | 287,599,716,287 |
| 第118計算期間 | 1,158,591,776 | 10,195,658,690 | 278,562,649,373 |
| 第119計算期間 | 639,302,616 | 6,352,175,736 | 272,849,776,253 |
| 第120計算期間 | 416,261,109 | 5,992,923,064 | 267,273,114,298 |
| 第121計算期間 | 314,547,147 | 6,527,291,764 | 261,060,369,681 |
| 第122計算期間 | 284,867,587 | 4,895,493,901 | 256,449,743,367 |
| 第123計算期間 | 238,030,709 | 7,313,825,870 | 249,373,948,206 |
| 第124計算期間 | 242,147,825 | 13,484,741,506 | 236,131,354,525 |
| 第125計算期間 | 208,354,555 | 14,332,442,408 | 222,007,266,672 |

| | | | |
|----------|---------------|---------------|-----------------|
| 第126計算期間 | 260,938,860 | 3,687,886,184 | 218,580,319,348 |
| 第127計算期間 | 173,440,964 | 4,340,587,614 | 214,413,172,698 |
| 第128計算期間 | 394,920,344 | 3,557,593,618 | 211,250,499,424 |
| 第129計算期間 | 268,577,852 | 3,085,970,047 | 208,433,107,229 |
| 第130計算期間 | 218,110,119 | 3,787,885,773 | 204,863,331,575 |
| 第131計算期間 | 173,367,800 | 3,827,809,196 | 201,208,890,179 |
| 第132計算期間 | 216,973,616 | 3,633,614,578 | 197,792,249,217 |
| 第133計算期間 | 239,966,836 | 4,448,650,553 | 193,583,565,500 |
| 第134計算期間 | 174,929,211 | 4,031,120,926 | 189,727,373,785 |
| 第135計算期間 | 206,998,814 | 5,079,055,900 | 184,855,316,699 |
| 第136計算期間 | 150,361,067 | 4,513,470,913 | 180,492,206,853 |
| 第137計算期間 | 209,335,931 | 2,690,715,586 | 178,010,827,198 |
| 第138計算期間 | 148,805,119 | 3,053,530,302 | 175,106,102,015 |
| 第139計算期間 | 124,212,820 | 3,322,272,649 | 171,908,042,186 |
| 第140計算期間 | 124,240,898 | 2,848,459,808 | 169,183,823,276 |
| 第141計算期間 | 127,634,794 | 2,243,037,828 | 167,068,420,242 |
| 第142計算期間 | 128,196,579 | 3,290,362,678 | 163,906,254,143 |
| 第143計算期間 | 176,854,347 | 3,270,444,464 | 160,812,664,026 |
| 第144計算期間 | 114,526,965 | 3,121,038,484 | 157,806,152,507 |
| 第145計算期間 | 277,307,235 | 2,309,167,936 | 155,774,291,806 |
| 第146計算期間 | 113,658,339 | 1,484,681,874 | 154,403,268,271 |
| 第147計算期間 | 1,379,210,859 | 1,516,295,198 | 154,266,183,932 |
| 第148計算期間 | 98,745,184 | 2,259,809,351 | 152,105,119,765 |
| 第149計算期間 | 120,999,792 | 2,133,373,290 | 150,092,746,267 |
| 第150計算期間 | 128,156,039 | 1,783,453,190 | 148,437,449,116 |
| 第151計算期間 | 132,196,052 | 1,411,213,335 | 147,158,431,833 |
| 第152計算期間 | 123,205,565 | 1,237,969,586 | 146,043,667,812 |
| 第153計算期間 | 112,473,519 | 996,735,597 | 145,159,405,734 |
| 第154計算期間 | 108,850,402 | 1,549,304,350 | 143,718,951,786 |
| 第155計算期間 | 122,680,854 | 1,461,747,224 | 142,379,885,416 |
| 第156計算期間 | 113,410,906 | 1,243,958,751 | 141,249,337,571 |
| 第157計算期間 | 76,202,334 | 4,075,934,889 | 137,249,605,016 |
| 第158計算期間 | 69,299,404 | 2,147,135,551 | 135,171,768,869 |
| 第159計算期間 | 51,893,316 | 2,217,302,469 | 133,006,359,716 |
| 第160計算期間 | 58,629,317 | 2,955,787,280 | 130,109,201,753 |
| 第161計算期間 | 61,901,397 | 2,726,020,841 | 127,445,082,309 |
| 第162計算期間 | 60,859,237 | 2,270,195,445 | 125,235,746,101 |
| 第163計算期間 | 49,264,877 | 1,624,885,364 | 123,660,125,614 |
| 第164計算期間 | 85,493,553 | 1,395,509,225 | 122,350,109,942 |
| 第165計算期間 | 51,037,092 | 1,280,484,529 | 121,120,662,505 |
| 第166計算期間 | 65,914,179 | 1,372,870,264 | 119,813,706,420 |
| 第167計算期間 | 87,532,229 | 2,711,918,532 | 117,189,320,117 |
| 第168計算期間 | 80,350,586 | 1,024,267,373 | 116,245,403,330 |

| | | | |
|----------|------------|---------------|-----------------|
| 第169計算期間 | 66,074,461 | 1,012,536,452 | 115,298,941,339 |
| 第170計算期間 | 74,554,486 | 1,255,082,945 | 114,118,412,880 |
| 第171計算期間 | 75,483,772 | 1,211,119,453 | 112,982,777,199 |
| 第172計算期間 | 66,676,792 | 1,117,240,195 | 111,932,213,796 |
| 第173計算期間 | 93,699,337 | 791,482,754 | 111,234,430,379 |
| 第174計算期間 | 53,911,336 | 1,193,230,266 | 110,095,111,449 |
| 第175計算期間 | 79,823,783 | 784,249,367 | 109,390,685,865 |
| 第176計算期間 | 68,673,005 | 883,892,527 | 108,575,466,343 |
| 第177計算期間 | 45,064,583 | 895,192,748 | 107,725,338,178 |
| 第178計算期間 | 47,195,915 | 993,479,757 | 106,779,054,336 |
| 第179計算期間 | 43,156,903 | 1,082,041,659 | 105,740,169,580 |

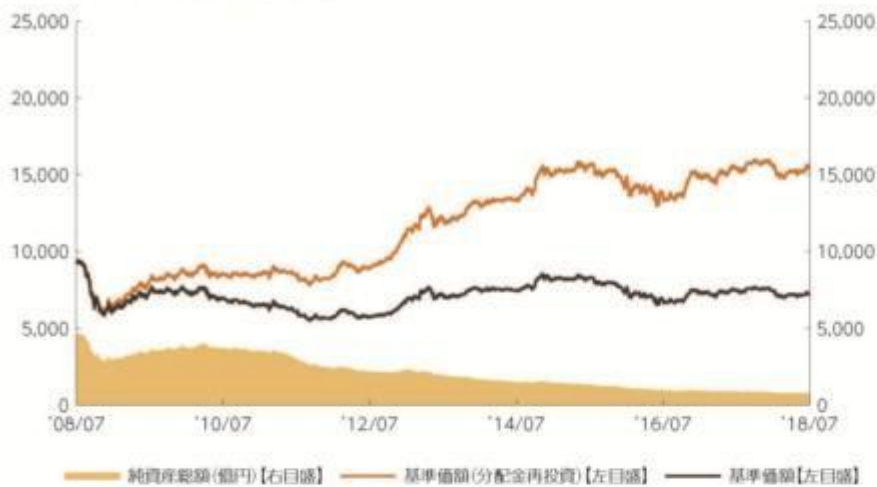
参考情報



運用実績

2018年7月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2008年7月31日～2018年7月31日



- 基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 7,226円 |
| 純資産総額 | 761.2億円 |

■分配の推移

| | |
|---------|--------|
| 2018年7月 | 20円 |
| 2018年6月 | 20円 |
| 2018年5月 | 20円 |
| 2018年4月 | 20円 |
| 2018年3月 | 20円 |
| 2018年2月 | 20円 |
| 直近1年間累計 | 240円 |
| 設定来累計 | 8,073円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

| 資産構成 | 比率 |
|--|--------|
| ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY | 51.1% |
| ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY | 48.7% |
| コールローン他 (負債控除後) | 0.2% |
| 合計 | 100.0% |

- 比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。

ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY

| 組入上位銘柄 | クーポン | 償還日 | 組入比率 |
|--|--------|------------|------|
| 1 UNIVISION COMMUNICATIONS SR SEC 144A | 5.125% | 2025/02/15 | 0.3% |
| 2 CHARTER COMM / CCO SR UNSEC 144A | 5.750% | 2026/02/15 | 0.3% |
| 3 DIVERSEY (DIAMOND BC BV) | 5.625% | 2025/08/15 | 0.2% |
| 4 CIT GROUP INC GLBL SR UNSEC | 5.000% | 2022/08/15 | 0.2% |
| 5 SPRINT CORP SR UNSEC | 7.875% | 2023/09/15 | 0.2% |

ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY

| 組入上位銘柄 | クーポン | 償還日 | 組入比率 |
|--------------------------------|--------|------------|------|
| 1 FNMA TBA 3.5% OCT 30YR | 3.500% | 2048/10/11 | 4.3% |
| 2 FNMA TBA 3.5% AUG 30YR | 3.500% | 2048/08/13 | 2.1% |
| 3 FNMA TBA 4.0% SEP 30YR | 4.000% | 2048/09/13 | 1.8% |
| 4 NORDEA KREDIT REALKREDIT SEC | 1.000% | 2018/10/01 | 1.6% |
| 5 FNMA TBA 3.0% SEP 30YR | 3.000% | 2048/09/13 | 1.6% |

●各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2018年は年初から7月31日までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

- 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）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 毎月決算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。
- 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、当期（平成30年1月16日から平成30年7月17日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド】

(1)【貸借対照表】

| | 前期 [平成30年1月15日現在] | 当期 [平成30年7月17日現在] |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| (単位：円) | | |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 244,181,255 | 232,671,521 |
| 投資信託受益証券 | 83,436,413,695 | 77,223,175,499 |
| 未収入金 | 380,000,000 | 260,000,000 |
| 流動資産合計 | 84,060,594,950 | 77,715,847,020 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 222,468,860 | 211,480,339 |
| 未払解約金 | 76,493,349 | 49,986,637 |
| 未払受託者報酬 | 3,881,017 | 3,619,200 |
| 未払委託者報酬 | 97,025,358 | 90,479,987 |
| 未払利息 | 257 | 454 |
| その他未払費用 | 325,997 | 304,005 |
| 流動負債合計 | 400,194,838 | 355,870,622 |
| 負債合計 | | |
| | 400,194,838 | 355,870,622 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 111,234,430,379 | 105,740,169,580 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 27,574,030,267 | 28,380,193,182 |
| (分配準備積立金) | 1,103,483,889 | 1,429,959,107 |
| 元本等合計 | 83,660,400,112 | 77,359,976,398 |
| 純資産合計 | | |
| | 83,660,400,112 | 77,359,976,398 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 84,060,594,950 | 77,715,847,020 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

| | 前期 | | 当期 | |
|---|--------------------------------|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 1月15日 | | 自 平成30年 1月16日 至 平成30年 7月17日 | |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 2,117,348,864 | | 2,079,773,782 |
| 受取利息 | | 1,094 | | 348 |
| 有価証券売買等損益 | | 154,425,840 | | 2,583,011,978 |
| 営業収益合計 | | 1,962,924,118 | | 503,237,848 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 68,974 | | 69,750 |
| 受託者報酬 | | 23,030,134 | | 21,150,439 |
| 委託者報酬 | | 575,753,178 | | 528,760,828 |
| その他費用 | | 1,934,470 | | 1,776,578 |
| 営業費用合計 | | 600,786,756 | | 551,757,595 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 1,362,137,362 | | 1,054,995,443 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 1,362,137,362 | | 1,054,995,443 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 1,362,137,362 | | 1,054,995,443 |
| 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（ ） | | 14,412,493 | | 14,944,219 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 29,051,149,215 | | 27,574,030,267 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,605,915,305 | | 1,625,145,628 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,605,915,305 | | 1,625,145,628 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 112,896,872 | | 94,645,671 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 112,896,872 | | 94,645,671 |
| 分配金 | | 1,363,624,354 | | 1,296,611,648 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 27,574,030,267 | | 28,380,193,182 |

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | ファンドの特定期間 当ファンドは、原則として毎年1月15日および7月15日を特定期間の末日としておりますが、当特定期間においては当該日が休業日のため、当特定期間は平成30年 1月16日から平成30年 7月17日までとなっております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | 前期 | 当期 |
|-----------------------------|------------------|------------------|
| | [平成30年 1月15日現在] | [平成30年 7月17日現在] |
| 1. 期首元本額 | 117,189,320,117円 | 111,234,430,379円 |
| 期中追加設定元本額 | 456,839,434円 | 337,825,525円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,411,729,172円 | 5,832,086,324円 |
| 2. 元本の欠損 | | |
| 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。 | 27,574,030,267円 | 28,380,193,182円 |
| 3. 受益権の総数 | 111,234,430,379口 | 105,740,169,580口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 前期 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 1月15日 | 当期 自 平成30年 1月16日 至 平成30年 7月17日 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--------------------------------------|------------------|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|---|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|------------------|---------------|--------------|------|------------|---|-----|---------|--------------|--------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|---|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|------------------|---------------|--------------|------|------------|---|-----|---------|--------------|--------------|---|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|---|--------|---|----------------|----------|---|----------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|------------------|---------------|--------------|------|------------|---|-----|---------|--------------|--------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|---|--------|---|----------------|----------|---|----------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|------------------|---------------|--------------|------|------------|---|-----|---------|--------------|--------------|
| <p>1.運用に係る権限を委託するための費用</p> <p>信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の50以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <p>第168期 平成29年 7月19日 平成29年 8月15日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>262,910,162円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,763,470,231円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>800,936,153円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,827,316,546円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>116,245,403,330口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>329円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>20円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>232,490,806円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第169期 平成29年 8月16日 平成29年 9月15日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>330,327,741円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,741,441,564円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>825,721,717円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,897,491,022円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>115,298,941,339口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>338円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>20円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>230,597,882円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第170期 平成29年 9月16日 平成29年10月16日</p> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 262,910,162円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 収益調整金額 | C | 2,763,470,231円 | 分配準備積立金額 | D | 800,936,153円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,827,316,546円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 116,245,403,330口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 329円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 232,490,806円 | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 330,327,741円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 収益調整金額 | C | 2,741,441,564円 | 分配準備積立金額 | D | 825,721,717円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,897,491,022円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 115,298,941,339口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 338円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 230,597,882円 | <p>1.運用に係る権限を委託するための費用</p> <p>信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の50以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <p>第174期 平成30年 1月16日 平成30年 2月15日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>245,183,030円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,620,986,027円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,094,231,559円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,960,400,616円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>110,095,111,449口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>359円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>20円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>220,190,222円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第175期 平成30年 2月16日 平成30年 3月15日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>256,870,697円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,605,025,631円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,112,725,269円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,974,621,597円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>109,390,685,865口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>363円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>20円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>218,781,371円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第176期 平成30年 3月16日 平成30年 4月16日</p> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 245,183,030円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 収益調整金額 | C | 2,620,986,027円 | 分配準備積立金額 | D | 1,094,231,559円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,960,400,616円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 110,095,111,449口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 359円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 220,190,222円 | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 256,870,697円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 収益調整金額 | C | 2,605,025,631円 | 分配準備積立金額 | D | 1,112,725,269円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,974,621,597円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 109,390,685,865口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 363円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 218,781,371円 |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 262,910,162円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 2,763,470,231円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 800,936,153円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,827,316,546円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 116,245,403,330口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 329円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 232,490,806円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 330,327,741円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 2,741,441,564円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 825,721,717円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,897,491,022円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 115,298,941,339口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 338円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 230,597,882円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 245,183,030円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 2,620,986,027円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 1,094,231,559円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,960,400,616円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 110,095,111,449口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 359円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 220,190,222円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 256,870,697円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 2,605,025,631円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 1,112,725,269円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,974,621,597円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 109,390,685,865口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 363円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 218,781,371円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| 前期 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 1月15日 | | | 当期 自 平成30年 1月16日 至 平成30年 7月17日 | | |
|--------------------------------------|--------------|------------------|--------------------------------------|--------------|------------------|
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 320,557,264円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 325,809,520円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 |
| 収益調整金額 | C | 2,713,978,533円 | 収益調整金額 | C | 2,586,330,533円 |
| 分配準備積立金額 | D | 916,681,847円 | 分配準備積立金額 | D | 1,143,120,582円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,951,217,644円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 4,055,260,635円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 114,118,412,880口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 108,575,466,343口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 346円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 373円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 228,236,825円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 217,150,932円 |
| 第171期 平成29年10月17日 平成29年11月15日 | | | 第177期 平成30年 4月17日 平成30年 5月15日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 283,936,850円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 258,504,173円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 |
| 収益調整金額 | C | 2,687,635,357円 | 収益調整金額 | C | 2,566,600,609円 |
| 分配準備積立金額 | D | 999,897,278円 | 分配準備積立金額 | D | 1,243,223,177円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,971,469,485円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 4,068,327,959円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 112,982,777,199口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 107,725,338,178口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 351円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 377円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 225,965,554円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 215,450,676円 |
| 第172期 平成29年11月16日 平成29年12月15日 | | | 第178期 平成30年 5月16日 平成30年 6月15日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 255,638,811円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 259,983,369円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 |
| 収益調整金額 | C | 2,663,271,629円 | 収益調整金額 | C | 2,544,615,664円 |
| 分配準備積立金額 | D | 1,049,575,100円 | 分配準備積立金額 | D | 1,276,373,362円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,968,485,540円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 4,080,972,395円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 111,932,213,796口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 106,779,054,336口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 354円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 382円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 223,864,427円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 213,558,108円 |
| 第173期 平成29年12月16日 | | | 第179期 平成30年 6月16日 | | |

| 前期 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 1月15日 | | | 当期 自 平成30年 1月16日 至 平成30年 7月17日 | | |
|--------------------------------------|--------------|------------------|--------------------------------------|--------------|------------------|
| 平成30年 1月15日 | | | 平成30年 7月17日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 250,941,276円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 330,024,382円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 |
| 収益調整金額 | C | 2,647,570,974円 | 収益調整金額 | C | 2,520,388,495円 |
| 分配準備積立金額 | D | 1,075,011,473円 | 分配準備積立金額 | D | 1,311,415,064円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,973,523,723円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 4,161,827,941円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 111,234,430,379口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 105,740,169,580口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 357円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 393円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 20円 | 1万口当たり分配金額 | H | 20円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 222,468,860円 | 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 211,480,339円 |

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 前期 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 1月15日 | 当期 自 平成30年 1月16日 至 平成30年 7月17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」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 | 同左 |

| 区分 | 前期 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 1月15日 | 当期 自 平成30年 1月16日 至 平成30年 7月17日 |
|------------------|--|--------------------------------------|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> <p>当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。</p> | 同左 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 前期 [平成30年 1月15日現在] | 当期 [平成30年 7月17日現在] |
|--|--|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 2. 時価の算定方法 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>時価で計上しているためその差額はありません。</p> <p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> | <p>同左</p> <p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 同左</p> <p>同左</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 前期 [平成30年 1月15日現在] | 当期 [平成30年 7月17日現在] |
|----------|---------------------------|---------------------------|
| | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) |
| 投資信託受益証券 | 415,001,058 | 1,404,825,211 |
| 合計 | 415,001,058 | 1,404,825,211 |

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

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）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| | 前期 [平成30年 1月15日現在] | 当期 [平成30年 7月17日現在] |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 1口当たり純資産額 | 0.7521円 | 0.7316円 |
| (1万口当たり純資産額) | (7,521円) | (7,316円) |

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|----------|--|--------------|----------------|----|
| 投資信託受益証券 | ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド J P Y | 3,459,967.52 | 37,813,985,061 | |

| | | | |
|---------------------------------------|--------------|----------------|--|
| ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファン ド J P Y | 5,311,211.64 | 39,409,190,438 | |
| 合計 | 8,771,179.17 | 77,223,175,499 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド】

【純資産額計算書】

平成30年 7月31日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------|------------------|
| 資産総額 | 76,237,297,509 |
| 負債総額 | 110,501,284 |
| 純資産総額(-) | 76,126,796,225 |
| 発行済口数 | 105,354,074,501口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 0.7226 |
| (10,000口当たり) | (7,226) |

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】

<更新後>

(1) 資本金の額等

平成30年7月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にて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。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

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

平成30年7月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類 | 本数 (本) | 純資産総額 (百万円) |
|------------|-----------|----------------|
| 追加型株式投資信託 | 867 | 12,284,001 |
| 追加型公社債投資信託 | 16 | 1,280,160 |
| 単位型株式投資信託 | 58 | 289,864 |
| 単位型公社債投資信託 | 1 | 6,039 |
| 合計 | 942 | 13,860,063 |

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | | 第33期 (平成30年3月31日現在) | |
|--------|------------------------|------------|------------------------|------------|
| (資産の部) | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金及び預金 | 2 | 69,212,680 | 2 | 54,140,307 |
| 有価証券 | | 36,210 | | 19,967 |
| 前払費用 | | 337,699 | | 362,886 |

| | | | | |
|------------|---|-------------|---|-------------|
| 未収入金 | | 35,896 | | 2,109 |
| 未収委託者報酬 | | 10,076,022 | | 9,770,529 |
| 未収収益 | 2 | 659,405 | 2 | 674,156 |
| 繰延税金資産 | | 446,374 | | 490,903 |
| 金銭の信託 | 2 | 30,000 | 2 | 30,000 |
| その他 | | 113,754 | | 224,645 |
| 流動資産合計 | | 80,948,042 | | 65,715,506 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | | | | |
| 建物 | 1 | 806,798 | 1 | 760,010 |
| 器具備品 | 1 | 759,446 | 1 | 724,852 |
| 土地 | | 1,356,000 | | 1,356,000 |
| 有形固定資産合計 | | 2,922,245 | | 2,840,863 |
| 無形固定資産 | | | | |
| 電話加入権 | | 15,822 | | 15,822 |
| ソフトウェア | | 1,844,549 | | 2,654,296 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 608,066 | | 1,097,970 |
| その他 | | 10 | | |
| 無形固定資産合計 | | 2,468,448 | | 3,768,090 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 投資有価証券 | | 24,327,081 | | 26,361,327 |
| 関係会社株式 | | 320,136 | | 320,136 |
| 長期差入保証金 | | 654,402 | | 627,141 |
| 前払年金費用 | | 463,105 | | 434,700 |
| 繰延税金資産 | | 711,230 | | 747,085 |
| その他 | | 50,235 | | 45,230 |
| 貸倒引当金 | | 23,600 | | 23,600 |
| 投資その他の資産合計 | | 26,502,592 | | 28,512,021 |
| 固定資産合計 | | 31,893,286 | | 35,120,975 |
| 資産合計 | | 112,841,328 | | 100,836,481 |

(単位：千円)

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 166,493 | 359,176 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 108,024 | 174,333 |
| 未払償還金 | 547,707 | 456,159 |
| 未払手数料 | 2 4,225,009 | 2 3,905,670 |
| その他未払金 | 2 2,355,815 | 2 4,330,584 |
| 未払費用 | 2 3,061,479 | 2 4,388,803 |
| 未払消費税等 | 351,670 | 99,010 |

| | | |
|-----------|------------|------------|
| 未払法人税等 | 756,668 | 736,829 |
| 賞与引当金 | 843,729 | 906,167 |
| 役員賞与引当金 | 100,680 | 125,343 |
| その他 | 711,633 | 842,194 |
| 流動負債合計 | 13,228,909 | 16,324,272 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 590,154 | 720,536 |
| 役員退職慰労引当金 | 166,458 | 187,562 |
| 時効後支払損引当金 | 253,070 | 254,851 |
| 固定負債合計 | 1,009,684 | 1,162,951 |
| 負債合計 | 14,238,594 | 17,487,223 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,131 | 2,000,131 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 3,572,096 | 3,572,096 |
| その他資本剰余金 | 41,160,616 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計 | 44,732,712 | 44,732,712 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 342,589 | 342,589 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 6,998,000 | 6,998,000 |
| 繰越利益剰余金 | 43,034,713 | 27,790,911 |
| 利益剰余金合計 | 50,375,303 | 35,131,500 |
| 株主資本合計 | 97,108,147 | 81,864,344 |

(単位：千円)

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|------------------|------------------------|------------------------|
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券 評価差額金 | 1,494,586 | 1,484,913 |
| 評価・換算差額等合計 | 1,494,586 | 1,484,913 |
| 純資産合計 | 98,602,734 | 83,349,257 |
| 負債純資産合計 | 112,841,328 | 100,836,481 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | 第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) |
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|

| | | | | |
|-------------|---|------------|---|------------|
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 81,709,776 | | 75,423,596 |
| 投資顧問料 | | 2,396,020 | | 2,723,458 |
| その他営業収益 | | 25,763 | | 48,215 |
| 営業収益合計 | | 84,131,560 | | 78,195,269 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 2 | 33,975,255 | 2 | 30,906,879 |
| 広告宣伝費 | | 731,771 | | 730,784 |
| 公告費 | | 482 | | 1,000 |
| 調査費 | | | | |
| 調査費 | | 1,713,892 | | 1,723,057 |
| 委託調査費 | | 13,961,993 | | 13,467,029 |
| 事務委託費 | | 984,749 | | 864,916 |
| 営業雑経費 | | | | |
| 通信費 | | 158,915 | | 178,652 |
| 印刷費 | | 699,940 | | 467,973 |
| 協会費 | | 51,995 | | 50,251 |
| 諸会費 | | 9,887 | | 15,328 |
| 事務機器関連費 | | 1,611,608 | | 1,635,079 |
| その他営業雑経費 | | 11,925 | | 23,250 |
| 営業費用合計 | | 53,912,419 | | 50,064,204 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | | | |
| 役員報酬 | | 331,997 | | 349,359 |
| 給料・手当 | | 6,496,165 | | 6,421,837 |
| 賞与引当金繰入 | | 843,729 | | 906,167 |
| 役員賞与引当金繰入 | | 100,680 | | 125,343 |
| 福利厚生費 | | 1,196,210 | | 1,231,033 |
| 交際費 | | 14,843 | | 13,012 |
| 旅費交通費 | | 233,159 | | 192,192 |
| 租税公課 | | 422,030 | | 410,229 |
| 不動産賃借料 | | 706,571 | | 678,182 |
| 退職給付費用 | | 441,736 | | 423,171 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 48,393 | | 47,889 |
| 固定資産減価償却費 | | 1,030,040 | | 1,115,719 |
| 諸経費 | | 474,521 | | 450,299 |
| 一般管理費合計 | | 12,340,079 | | 12,364,437 |
| 営業利益 | | 17,879,061 | | 15,766,627 |

(単位：千円)

| | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) | 第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日) |
|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 243,048 | 349,402 |
| 有価証券利息 | 0 | |

| | | | | |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 受取利息 | 2 | 4,601 | 2 | 483 |
| 投資有価証券償還益 | | 260,190 | | 81,580 |
| 収益分配金等時効完成分 | | 278,148 | | 91,672 |
| その他 | | 4,383 | | 9,989 |
| 営業外収益合計 | | 790,372 | | 533,128 |
| 営業外費用 | | | | |
| 投資有価証券償還損 | | 11,552 | | 30,114 |
| 時効後支払損引当金繰入 | | | | 43,182 |
| 事務過誤費 | | 218 | | 10,402 |
| その他 | | 4,357 | | 3,829 |
| 営業外費用合計 | | 16,128 | | 87,529 |
| 経常利益 | | 18,653,304 | | 16,212,226 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 259,137 | | 516,394 |
| ゴルフ会員権売却益 | | | | 7,495 |
| 特別利益合計 | | 259,137 | | 523,889 |
| 特別損失 | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 42,248 | | 105,903 |
| デリバティブ解約損 | | 126,228 | | |
| 投資有価証券評価損 | | 157,482 | | 102,096 |
| 固定資産除却損 | 1 | 13,540 | 1 | 54 |
| 減損損失 | 3 | 48,575 | | |
| 特別損失合計 | | 388,075 | | 208,054 |
| 税引前当期純利益 | | 18,524,367 | | 16,528,061 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2 | 5,658,953 | 2 | 5,252,224 |
| 法人税等調整額 | | 103,169 | | 76,092 |
| 法人税等合計 | | 5,762,122 | | 5,176,132 |
| 当期純利益 | | 12,762,244 | | 11,351,928 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(単位：千円)

| | 株主資本 | | | | | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|-------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金合計 | 株主資本合計 |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 57,079,782 | 64,420,372 | 111,153,216 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 26,807,312 | 26,807,312 | 26,807,312 |
| 当期純利益 | | | | | | | 12,762,244 | 12,762,244 | 12,762,244 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | | | | 14,045,068 | 14,045,068 | 14,045,068 |

| | | | | | | | | | |
|-------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
| 当期末残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 43,034,713 | 50,375,303 | 97,108,147 |
|-------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|-----------------------------|----------------------|-------------|----------------|-------------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | 繰延ヘッジ 損益 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 1,446,576 | 6,546 | 1,453,123 | 112,606,339 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 26,807,312 |
| 当期純利益 | | | | 12,762,244 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額) | 48,009 | 6,546 | 41,462 | 41,462 |
| 当期変動額合計 | 48,009 | 6,546 | 41,462 | 14,003,605 |
| 当期末残高 | 1,494,586 | | 1,494,586 | 98,602,734 |

第33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 | | | | | | | | 株主資本合計 |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 資本 準備金 | その他 資本剰余金 | 資本 剰余金合計 | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | | | |
| | | | | | | 別途 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 43,034,713 | 50,375,303 | 97,108,147 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 26,595,731 | 26,595,731 | 26,595,731 |
| 当期純利益 | | | | | | | 11,351,928 | 11,351,928 | 11,351,928 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | | | | 15,243,802 | 15,243,802 | 15,243,802 |
| 当期末残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 27,790,911 | 35,131,500 | 81,864,344 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 1,494,586 | 1,494,586 | 98,602,734 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 26,595,731 |
| 当期純利益 | | | 11,351,928 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額) | 9,673 | 9,673 | 9,673 |
| 当期変動額合計 | 9,673 | 9,673 | 15,253,476 |
| 当期末残高 | 1,484,913 | 1,484,913 | 83,349,257 |

[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(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに平成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 | 5年～50年 |
| 器具備品 | 2年～20年 |

(2) 無形固定資産

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)に基づく定額法を採用しております。

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れ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、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

平成34年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|------|------------------------|------------------------|
| 建物 | 539,649千円 | 604,123千円 |
| 器具備品 | 1,029,950千円 | 1,215,234千円 |

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 預金 | 47,798,472千円 | 41,809,118千円 |
| 未収収益 | 46,963千円 | 40,621千円 |
| 金銭の信託 | 30,000千円 | 30,000千円 |
| 未払手数料 | 1,993,055千円 | 1,577,059千円 |
| その他未払金 | 2,071,256千円 | 3,850,734千円 |
| 未払費用 | 456,748千円 | 430,491千円 |

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

| | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) | 第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日) |
|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 建物 | 2,392千円 | |
| 器具備品 | 7,791千円 | 54千円 |
| ソフトウェア | 3,356千円 | |
| 計 | 13,540千円 | 54千円 |

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

| | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) | 第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 支払手数料 | 13,862,465千円 | 11,380,244千円 |
| 受取利息 | 4,375千円 | 380千円 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 4,204,969千円 | 3,851,536千円 |

3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第32期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

| 場所 | 用途 | 種類 | 減損損失 |
|-------------|----------------------|---------------|----------|
| 東京都千代田区(本社) | 自社利用ソフトウェア (遊休資産) | ソフトウェア 仮勘定 | 48,575千円 |

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

第33期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数 (株) | 当事業年度増加 株式数 (株) | 当事業年度減少 株式数 (株) | 当事業年度末 株式数 (株) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 211,581 | - | - | 211,581 |
| 合計 | 211,581 | - | - | 211,581 |

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|--------------|
| 配当金の総額 | 26,807,312千円 |
| 1株当たり配当額 | 126,700円 |
| 基準日 | 平成28年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成28年6月29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
平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|--------------|
| 配当金の総額 | 26,595,731千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 125,700円 |
| 基準日 | 平成29年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成29年6月29日 |

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数（株） | 当事業年度増加 株式数（株） | 当事業年度減少 株式数（株） | 当事業年度末 株式数（株） |
|-------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 211,581 | - | - | 211,581 |
| 合計 | 211,581 | - | - | 211,581 |

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|--------------|
| 配当金の総額 | 26,595,731千円 |
| 1株当たり配当額 | 125,700円 |
| 基準日 | 平成29年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成29年6月29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
平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|--------------|
| 配当金の総額 | 11,363,380千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 53,707円 |
| 基準日 | 平成30年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成30年6月28日 |

(リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

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

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 1年内 | 678,116千円 | 678,116千円 |
| 1年超 | 2,030,029千円 | 1,351,912千円 |
| 合計 | 2,708,145千円 | 2,030,029千円 |

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第32期(平成29年3月31日現在)

| | 貸借対照表 計上額(千円) | 時価(千円) | 差額(千円) |
|-------------|------------------|-------------|--------|
| (1) 現金及び預金 | 69,212,680 | 69,212,680 | - |
| (2) 有価証券 | 36,210 | 36,210 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 10,076,022 | 10,076,022 | - |
| (4) 投資有価証券 | 24,189,921 | 24,189,921 | - |
| 資産計 | 103,514,834 | 103,514,834 | - |
| (1) 未払手数料 | 4,225,009 | 4,225,009 | - |
| 負債計 | 4,225,009 | 4,225,009 | - |

第33期(平成30年3月31日現在)

| | 貸借対照表 計上額(千円) | 時価(千円) | 差額(千円) |
|-------------|------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金 | 54,140,307 | 54,140,307 | - |
| (2) 有価証券 | 19,967 | 19,967 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 9,770,529 | 9,770,529 | - |
| (4) 投資有価証券 | 26,224,167 | 26,224,167 | - |
| 資産計 | 90,154,972 | 90,154,972 | - |
| (1) 未払手数料 | 3,905,670 | 3,905,670 | - |
| 負債計 | 3,905,670 | 3,905,670 | - |

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

| 区分 | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式 | 137,160 | 137,160 |
| 子会社株式 | 160,600 | 160,600 |
| 関連会社株式 | 159,536 | 159,536 |

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

(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 |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金 | 69,212,680 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 10,076,022 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| その他有価証券のうち満期があるもの | | | | |
| 投資信託 | 36,210 | 10,703,761 | 8,324,138 | 45,606 |
| 合計 | 79,324,912 | 10,703,761 | 8,324,138 | 45,606 |

第33期(平成30年3月31日現在)

(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 |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金 | 54,140,307 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 9,770,529 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| その他有価証券のうち満期があるもの | | | | |
| 投資信託 | 19,967 | 13,110,758 | 8,593,680 | 68,714 |
| 合計 | 63,930,804 | 13,110,758 | 8,593,680 | 68,714 |

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円)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ため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額(千円) |
|------------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 17,778,798 | 15,302,336 | 2,476,461 |
| | 小計 | 17,778,798 | 15,302,336 | 2,476,461 |
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 6,447,333 | 6,769,569 | 322,236 |
| | 小計 | 6,447,333 | 6,769,569 | 322,236 |
| 合計 | | 24,226,131 | 22,071,906 | 2,154,225 |

第33期(平成30年3月31日現在)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額(千円) |
|--|----|------------------|--------------|--------|
|--|----|------------------|--------------|--------|

| | | | | |
|--------------------------|------------|------------|------------|-----------|
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 18,599,111 | 16,040,884 | 2,558,227 |
| | 小計 | 18,599,111 | 16,040,884 | 2,558,227 |
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 7,645,023 | 8,062,990 | 417,966 |
| | 小計 | 7,645,023 | 8,062,990 | 417,966 |
| 合計 | 26,244,135 | 24,103,874 | 2,140,260 | |

3. 売却したその他有価証券

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

| 種類 | 売却額（千円） | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式 | 122,688 | 82,146 | 21,570 |
| 債券 | - | - | - |
| その他 | 3,439,009 | 176,991 | 20,678 |
| 合計 | 3,561,698 | 259,137 | 42,248 |

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

| 種類 | 売却額（千円） | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式 | - | - | - |
| 債券 | - | - | - |
| その他 | 8,169,769 | 516,394 | 105,903 |
| 合計 | 8,169,769 | 516,394 | 105,903 |

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について102,096千円（その他有価証券のその他102,096千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（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、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）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

| | 第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日） | 第33期 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日） |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 2,997,931 千円 | 3,649,089 千円 |
| 勤務費用 | 199,166 | 184,120 |
| 利息費用 | 22,711 | 27,829 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 40,934 | 56,895 |
| 退職給付の支払額 | 183,403 | 188,683 |

| | | |
|-------------|-----------|-----------|
| 過去勤務費用の発生額 | 653,618 | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 3,649,089 | 3,729,252 |

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

| | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) | | 第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日) | |
|--------------|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|-----------|
| | 年金資産の期首残高 | 2,678,827 | 千円 | 2,698,738 |
| 期待運用収益 | 47,553 | | 48,080 | |
| 数理計算上の差異の発生額 | 7,066 | | 47,759 | |
| 事業主からの拠出額 | 107,823 | | 102,564 | |
| 退職給付の支払額 | 142,532 | | 173,748 | |
| 年金資産の期末残高 | 2,698,738 | | 2,723,393 | |

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

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | | 第33期 (平成30年3月31日現在) | |
|---------------------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | 積立型制度の退職給付債務 | 3,471,120 | 千円 | 3,374,562 |
| 年金資産 | 2,698,738 | | 2,723,393 | |
| | 772,381 | | 651,168 | |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 177,969 | | 354,690 | |
| 未積立退職給付債務 | 950,350 | | 1,005,858 | |
| 未認識数理計算上の差異 | 207,810 | | 169,893 | |
| 未認識過去勤務費用 | 615,490 | | 550,128 | |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 127,049 | | 285,836 | |
| 退職給付引当金 | 590,154 | | 720,536 | |
| 前払年金費用 | 463,105 | | 434,700 | |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 127,049 | | 285,836 | |

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) | | 第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日) | |
|-----------------|---------------------------------------|---------|---------------------------------------|---------|
| | 勤務費用 | 199,166 | 千円 | 184,120 |
| 利息費用 | 22,711 | | 27,829 | |
| 期待運用収益 | 47,553 | | 48,080 | |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 54,327 | | 47,053 | |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 38,127 | | 65,361 | |
| その他 | 28,533 | | 4,780 | |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 295,314 | | 281,066 | |

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 債券 | 62.9 % | 62.2 % |
| 株式 | 33.3 | 34.7 |
| その他 | 3.7 | 3.1 |
| 合計 | 100 | 100 |

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 割引率 | 0.061 ~ 0.90% | 0.069 ~ 0.67% |
| 長期期待運用収益率 | 1.5 ~ 1.8% | 1.5 ~ 1.8% |

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146,421千円、当事業年度142,105千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| | 第32期 (平成29年3月31日現在) | 第33期 (平成30年3月31日現在) |
|---------------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 減損損失 | 455,165千円 | 445,379千円 |
| 投資有価証券評価損 | 242,551 | 223,512 |
| ゴルフ会員権評価損 | 295 | - |
| 未払事業税 | 124,367 | 135,805 |
| 賞与引当金 | 260,374 | 277,468 |
| 役員賞与引当金 | 11,509 | 12,235 |
| 役員退職慰労引当金 | 50,969 | 57,431 |
| 退職給付引当金 | 180,726 | 220,628 |
| 減価償却超過額 | 19,277 | 13,690 |
| 委託者報酬 | 217,902 | 257,879 |
| 長期差入保証金 | 14,803 | 23,262 |
| 時効後支払損引当金 | 77,490 | 78,035 |
| 連結納税適用による時価評価 | 236,450 | 200,331 |
| その他 | 68,614 | 82,168 |
| 繰延税金資産 小計 | 1,960,499 | 2,027,829 |
| 評価性引当額 | - | - |
| 繰延税金資産 合計 | 1,960,499 | 2,027,829 |
| 繰延税金負債 | | |
| 前払年金費用 | 141,802 | 133,105 |
| 連結納税適用による時価評価 | 1,447 | 1,382 |
| その他有価証券評価差額金 | 659,638 | 655,348 |
| その他 | 3 | 4 |

| | | |
|-----------|-----------|-----------|
| 繰延税金負債 合計 | 802,893 | 789,840 |
| 繰延税金資産の純額 | 1,157,605 | 1,237,989 |

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32期(平成29年3月31日現在)及び第33期(平成30年3月31日現在)

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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)及び第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)及び第33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

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

2.地域ごとの情報

(1)営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3.主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[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]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1.関連当事者との取引

(1)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|----|--------|-----|-----|-------|----------------|-----------|-------|------|----|------|
| | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | |
|------|----------------------|---------|------------------|-------------|---------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513 百万円 | 銀行持株 会社業 | 被所有 間接 100.0% | 連結納税 役員の兼任 | 連結納税に伴う支払 | 4,204,969 千円 | その他未払金 | 2,071,256 千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 324,279 百万円 | 信託業、 銀行業 | 被所有 直接 51.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び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 | 5,983,874 千円 | 未払手数料 | 716,117 千円 |
| | | | | | | 投資の助言 役員の兼任 | 投資助言料 | 662,992 千円 | 未払費用 | 352,297 千円 |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958 百万円 | 銀行業 | 被所有 直接 15.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び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 | 7,878,591 千円 | 未払手数料 | 1,276,937 千円 |

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-----|----------------------|---------|------------------|-------------|---------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513 百万円 | 銀行持株 会社業 | 被所有 間接 100.0% | 連結納税 | 連結納税に伴う支払 | 3,851,587 千円 | その他未払金 | 3,850,734 千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 324,279 百万円 | 信託業、 銀行業 | 被所有 直接 51.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び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 | 5,528,131 千円 | 未払手数料 | 665,262 千円 |
| | | | | | | 投資の助言 役員の兼任 | 投資助言料 | 664,152 千円 | 未払費用 | 348,142 千円 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------------|---------|------------------|-----|--------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|
| 主要株主 | ㈱三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958 百万円 | 銀行業 | 被所有 直接 15.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び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 | 5,852,112 千円 | 未払手数料 | 921,796 千円 |
| | | | | | | | | | | |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|--------------------|---------|---------------|-------|----------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500 百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び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 | 6,532,238 千円 | 未払手数料 | 933,908 千円 |

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|----|--------|-----|-----|-------|----------------|-----------|-------|------|----|------|
| | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|---|-------------------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券㈱ | 東京都 千代田 区 | 40,500 百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の 募集の取扱及び 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 | 6,263,571 千円 | 未払手数料 | 907,290 千円 |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|---|-------------------------------|-----------------|-------|---------------|

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示してあります。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

(1株当たり情報)

| | 第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | 第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 466,028.30円 | 393,935.45円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 60,318.47円 | 53,652.87円 |

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | 第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益金額 (千円) | 12,762,244 | 11,351,928 |
| 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) | 12,762,244 | 11,351,928 |
| 普通株式の期中平均株式数 (株) | 211,581 | 211,581 |

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】

<更新後>

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成30年3月末現在）
 事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

| 名称 | 資本金の額 （平成30年3月末現在） | 事業の内容 |
|-----------------------|-----------------------|-------------------------------|
| 株式会社三菱UFJ銀行 | 1,711,958 百万円 | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社京都銀行 | 42,103 百万円 | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社鳥取銀行 | 9,061 百万円 | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社鹿児島銀行 | 18,130 百万円 | 銀行業務を営んでいます。 |
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 324,279 百万円 | 銀行業務および信託業務を営んでいます。 |
| 株式会社ゆうちょ銀行 | 3,500,000 百万円 | 銀行業務を営んでいます。 |
| カブドットコム証券株式会社 | 7,196 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 池田泉州TT証券株式会社 | 1,250 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社SBI証券 | 48,323 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 九州FG証券株式会社 | 3,000 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 高木証券株式会社 | 11,069 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社 | 7,495 百万円 | 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。 |
| 東海東京証券株式会社 | 6,000 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 西日本シティTT証券株式会社 | 3,000 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 浜銀TT証券株式会社 | 3,307 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ほくほくTT証券株式会社 | 1,250 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 | 40,500 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ワイエム証券株式会社 | 1,270 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

（3）再委託先

名称：ピムコジャパンリミテッド
 資本金の額：13,411,674.44米ドル（平成30年4月末現在）
 事業の内容：投資運用業務を営んでいます。

3【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成30年4月2日現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成30年7月末現在)

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%(211,581株)を所有しています。

(注)関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

独立監査人の監査報告書

平成30年8月22日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 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」に掲げられているピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンドの平成30年1月16日から平成30年7月17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、ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンドの平成30年7月17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

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年6月27日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

| | | | |
|--------------------|-------|--------|---|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 弥永 めぐみ | 印 |
|--------------------|-------|--------|---|

| | | | |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 青木 裕晃 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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、三菱UFJ国際投信株式会社の平成30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。

利害関係

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

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。