

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和1年6月6日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-5405-0784
【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】	三井住友グローバル債券オープン
【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】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友グローバル債券オープン  
以下「当ファンド」といいます。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「グロ債券」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

### （５）【申込手数料】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、3.24%<sup>\*</sup>（税抜き3.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

\* 消費税率が10%になった場合は3.3%となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

(6)【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2019年6月7日から2019年12月9日まで

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

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細につきましては、前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。(販売会社は前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。)

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

## 二 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

(参考：投資信託振替制度)

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 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】

イ 当ファンドは、次の投資信託証券に投資することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

1. G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）

2. G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）

上記の投資信託証券への投資を通じて実質的に、日本を除く先進国のソブリン債券に加えて、先進国の投資適格債券および現地通貨建て新興国ソブリン債券への分散投資により収益の向上とともに高利回りを目指します。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の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	海外	目論見書または信託約款において、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。
投資対象資産 （収益の源泉）	債券	目論見書または信託約款において、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。

##### （ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年12回（毎月）	目論見書または信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）、エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産およびエマージング地域（新興成長国（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。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「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	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
-------	---------	---

## 商品分類表

単字型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単字型	国内	株式
		<b>債券</b>
	<b>海外</b>	不動産投信
<b>追加型</b>		その他資産 ( )
	内外	資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 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
株式	年1回	<b>グローバル</b>		
一般		<b>(日本を除く)</b>		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米	ファミリーファンド	あり
債券	年6回(隔月)	欧州		
一般	<b>年12回(毎月)</b>	アジア		
公債		オセアニア		
社債	日々	中南米		
その他債券	その他	中近東(中東)	<b>ファンド・オブ・ファンズ</b>	<b>なし</b>
クレジット属性 ( )	( )	アフリカ		
不動産投信				
<b>その他資産</b>				
<b>(投資信託証券(債券 一般))</b>		<b>エマージング</b>		
資産複合 ( )				
資産配分固定 型				
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円ででの為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

## (2)【ファンドの沿革】

2006年9月20日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3)【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三菱UFJ信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

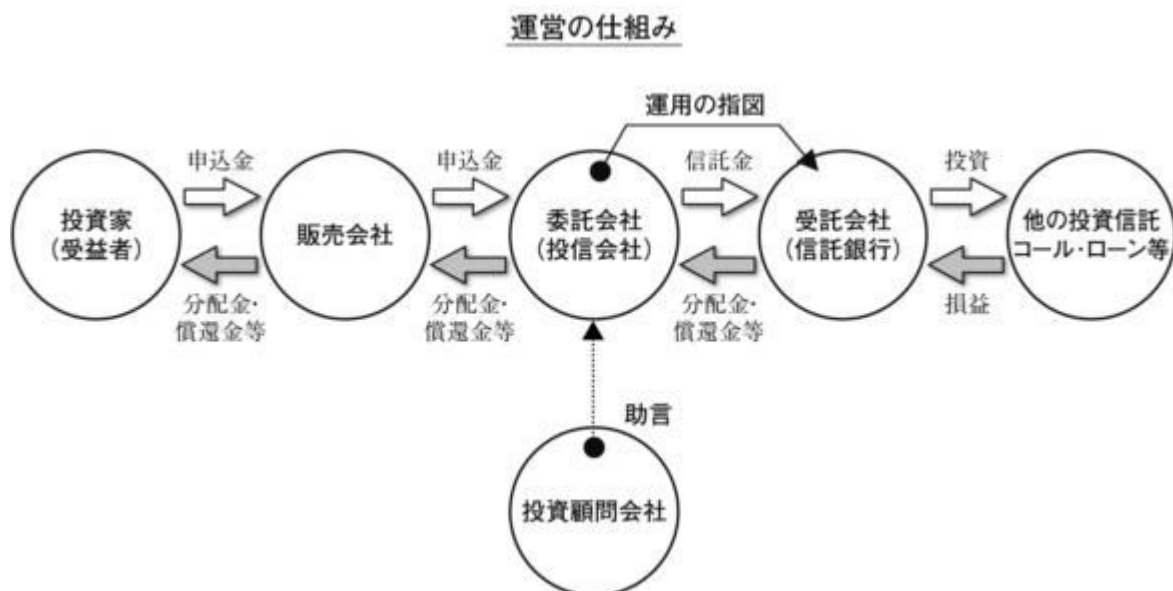
委託会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問いません。)に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

[参考情報：投資顧問会社]

以下の法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

JPMorgan・アセット・マネジメント株式会社

当ファンドの投資顧問会社として、委託会社に対して、主として、基本資産配分等に関する助言を行います。



## □ 委託会社の概況

## (イ) 資本金の額

20億円（2019年4月1日現在）

## (ロ) 会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

## (ハ) 大株主の状況

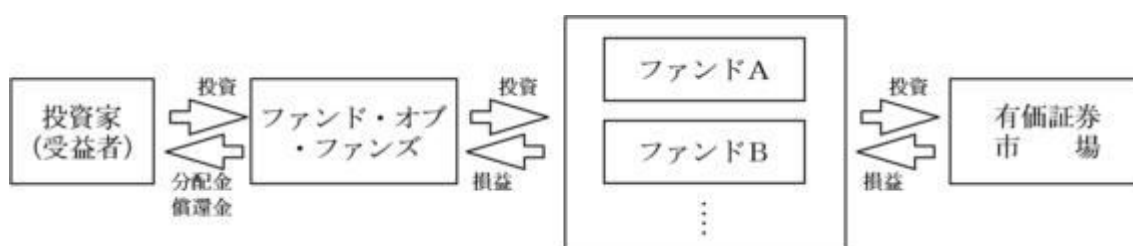
(2019年4月1日現在)

名称	住所	所有 株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

## 八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

## 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕





## (1) 【投資方針】

## イ 基本方針

当ファンドは、次の投資信託証券に投資することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

1. GIM世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）
2. GIM新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）

## ロ 投資態度

- (イ) 投資信託証券への投資を通じて実質的に、日本を除く先進国のソブリン債券に加えて、先進国の投資適格債券および現地通貨建て新興国ソブリン債券への分散投資により収益の向上とともに高利回りを目指します。
- (ロ) GIM世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）への投資比率70%、GIM新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）への投資比率30%を基本資産配分比率としますが、市場環境に応じて、上下10%の範囲内で投資比率を変更する場合があります。
- (ハ) 原則として対円での為替ヘッジは行いません。
- (ニ) 運用にあたっては、JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社より助言を受けます。
- (ホ) 資金動向、市場動向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。
- (ヘ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。

## a. GIM世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）

運用会社	JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社
主要投資対象	GIM世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）を通じて、世界各国の国債、政府機関債、国際機関債等に投資します。ただし、日本に所在する発行体の発行するものは除きます。
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。

## b. GIM新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）

運用会社	JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社
主要投資対象	GIM新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）を通じて、新興国の政府または政府機関の発行する債券に投資します。
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。

上記ファンドの詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。

## ファンドの特色

### 1

海外の様々な債券に投資し、安定的な収益確保を目指します。

■主として、日本を除く先進国の債券、および現地通貨建ての新興国のソブリン債券に分散投資します。

■基本資産配分比率は、先進国債券70%、新興国ソブリン債券等30%とします。

※JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社の助言を受け、基本資産配分比率から±10%の範囲で比率を変更する場合があります。

### 2

毎月分配に加えて、3ヵ月毎に売買益等からの分配を行うことを目指します。

■分配金額は委託会社が分配方針に基づき、基準価額水準、市況動向等を考慮して決定します。

ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### ▶ 分配のイメージ

売買益等からの分配を目指します。

	¥			¥			¥			¥	
1月決算	2月決算	3月決算	4月決算	5月決算	6月決算	7月決算	8月決算	9月決算	10月決算	11月決算	12月決算

配当等収益を中心に安定的な分配を目指します。

※「安定的な分配を目指します。」としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。また、基準価額の水準、運用の状況等によっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

※上記は分配のイメージであり、今後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。

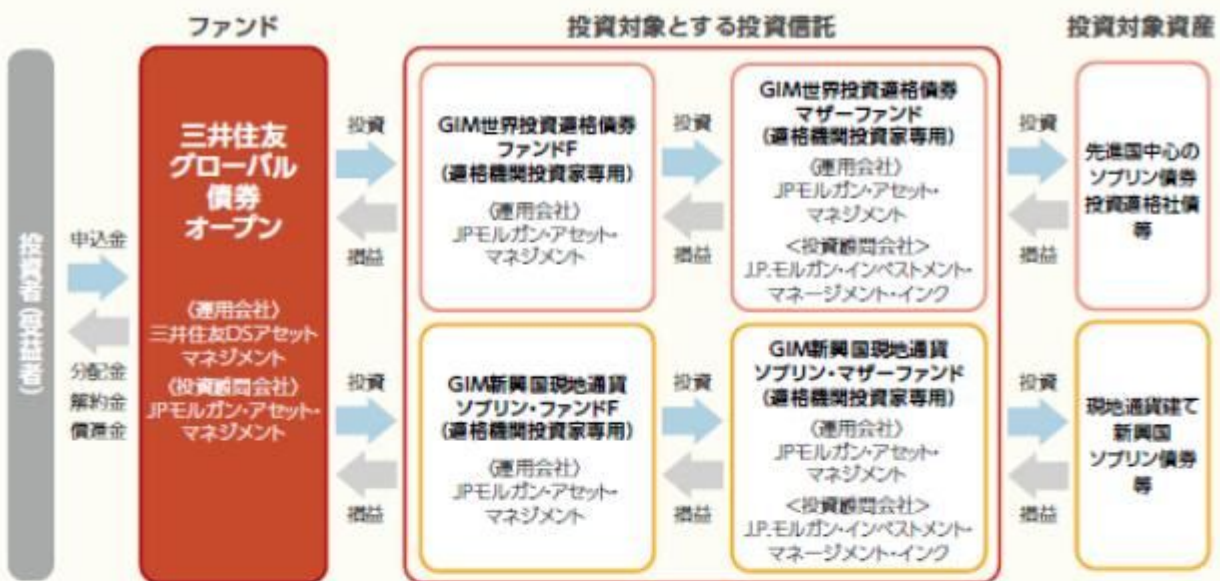
### 3

原則として、対円での為替ヘッジは行いません。

※資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドのしくみ

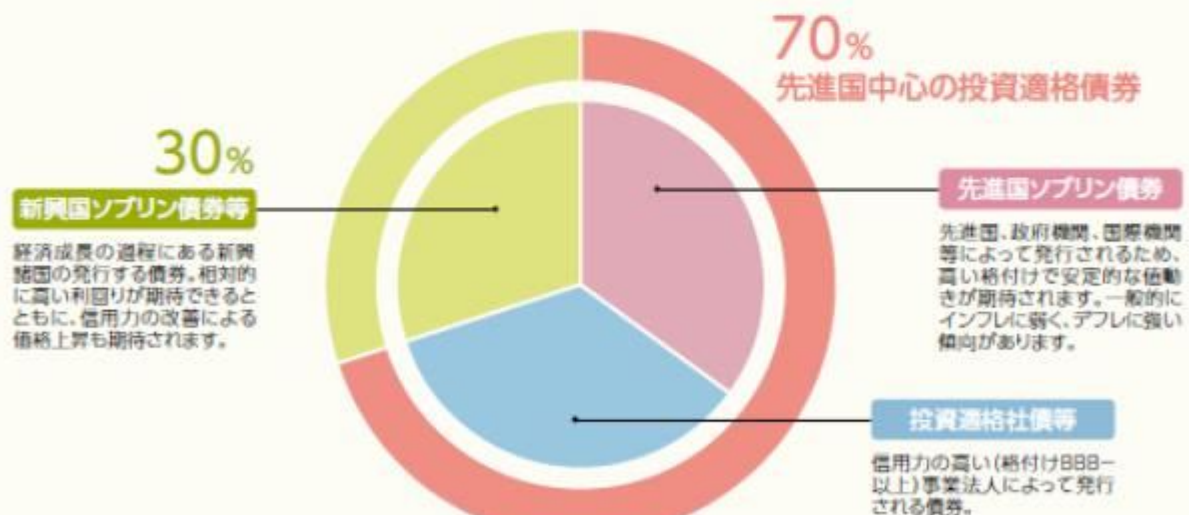
■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



## 運用のイメージ

■原則として、先進国中心のソブリン債券および投資適格社債等（除く日本）へ70%、現地通貨建て新興国ソブリン債券等へ30%を基本資産配分とします。

※基本資産配分比率から±10%の範囲で比率を変更する場合があります。



ソブリン債券とは

国債や政府機関債など中央政府により発行・保証される債券の総称です。広義には世界銀行などの国際機関が発行・保証するものも含まれます。

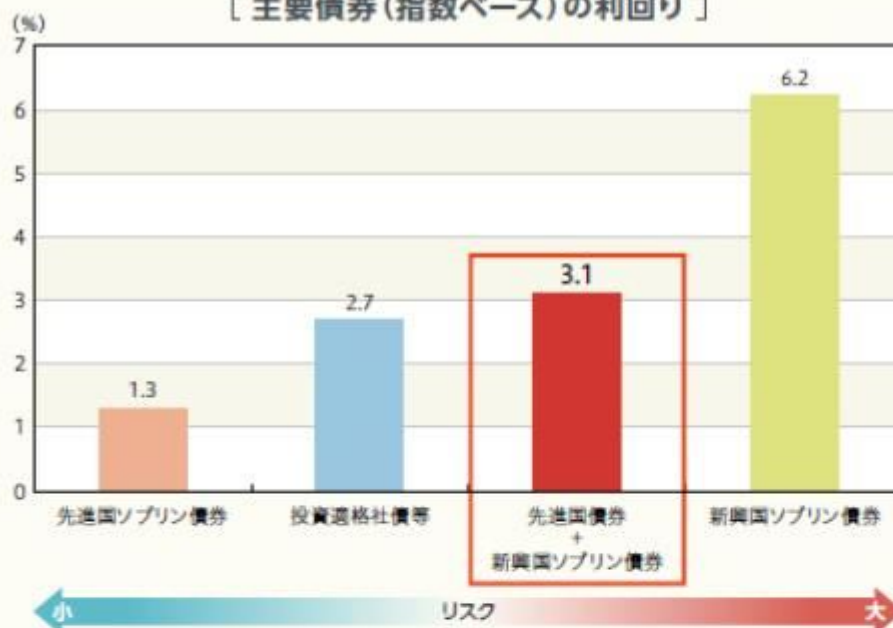
※上記は、資産配分のイメージを示したものであり、実際の配分比率を示すものではありません。



## グローバル債券投資

- 様々な債券を組み合わせることで長期的に保有することにより、収益の安定化を目指します。
- 投資対象を拡大することで、より高い利回りを目指します。

### [ 主要債券(指数ベース)の利回り ]



〈ご参考〉  
当ファンドの  
ポートフォリオ概況  
(2019年3月29日現在)

最終利回り

3.4%

デュレーション\*

5.9年

\*デュレーションとは、金利がある一定の割合で変動した場合、債券価格がどの程度変化するかを示す指標です。この数値が大きければ、金利の変化に対する債券価格の変動率が大きくなります。

(注1) データは2019年3月末現在。

(注2) 先進国サブリン債券：ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル債券総合指数のサブリン債券部分。  
投資適格社債等：ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル債券総合指数のサブリン債券を除く部分。  
新興国サブリン債券：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド指数(GBI-EM)、  
先進国債券+新興国サブリン債券：ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル債券総合指数(先進国サブリン債券と投資適格社債等)を70%とJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド指数(新興国サブリン債券)を30%として委託会社が作成しています。

(出所) FactSetのデータを基に委託会社作成

### [ 基準価額の推移と主なイベント ]



(注1) データは2006年9月20日(設定日)～2019年3月29日。

(注2) 分配金再投資基準価額、基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後。

(注3) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算した価額です。

※グラフ・データは、過去の実績であり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

## 投資対象とする投資信託の運用会社について

## ▶ JPモルガン・アセット・マネジメント

[ 約1,080名の運用プロフェッショナルを  
擁するグローバル・ネットワーク ]



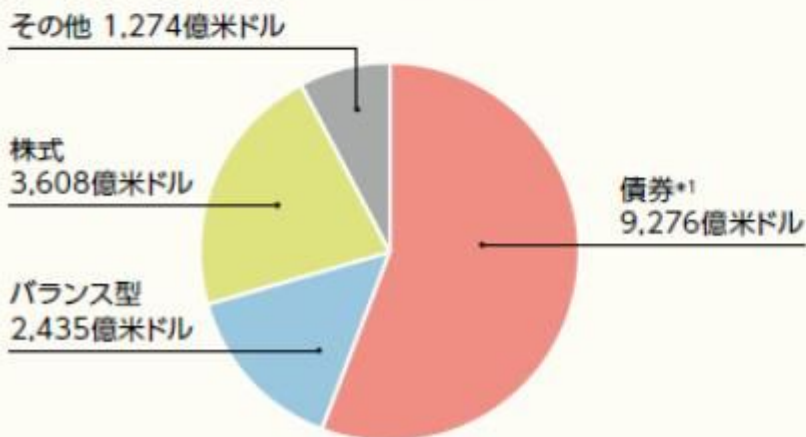
■ JPモルガン・アセット・マネジメント<sup>※</sup>は、世界有数の金融サービス会社であるJPモルガン・チェース・アンド・カンパニーの傘下にあり、欧州・アフリカ・中近東、アジア太平洋、北米・中南米の主要国・地域をベースに世界中の投資家にグローバル資産運用サービスを提供しています。

■ 世界30の国・地域に拠点

■ 約1,080名の運用プロフェッショナル

※JPモルガン・アセット・マネジメントは、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーおよび世界の関連会社の資産運用ビジネスのブランドです。

## [ 運用総資産残高の種類別内訳 ]



■ 運用資産は約182兆円(約1兆6,593億米ドル)<sup>\*2</sup>を誇ります。

\*1: キャッシュ(マネー・マーケット商品、手形、短期証券等)を含む。

\*2: 1米ドル=109.72円で換算。

(注) データは2018年12月末現在。

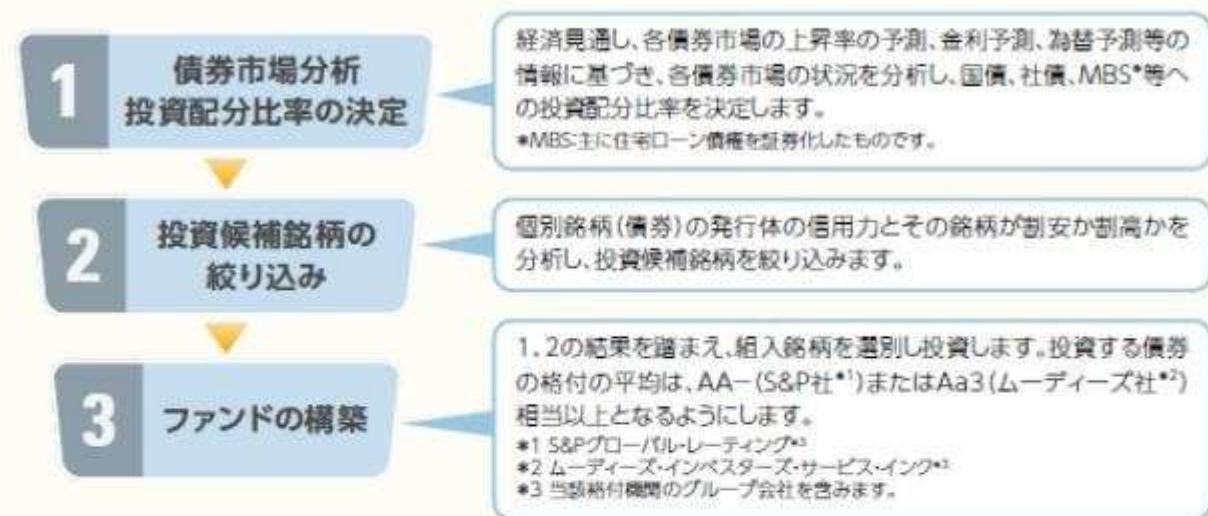
(出所) JPモルガン・アセット・マネジメントのデータを基に委託会社作成



## ▶ 運用チームおよび運用プロセス

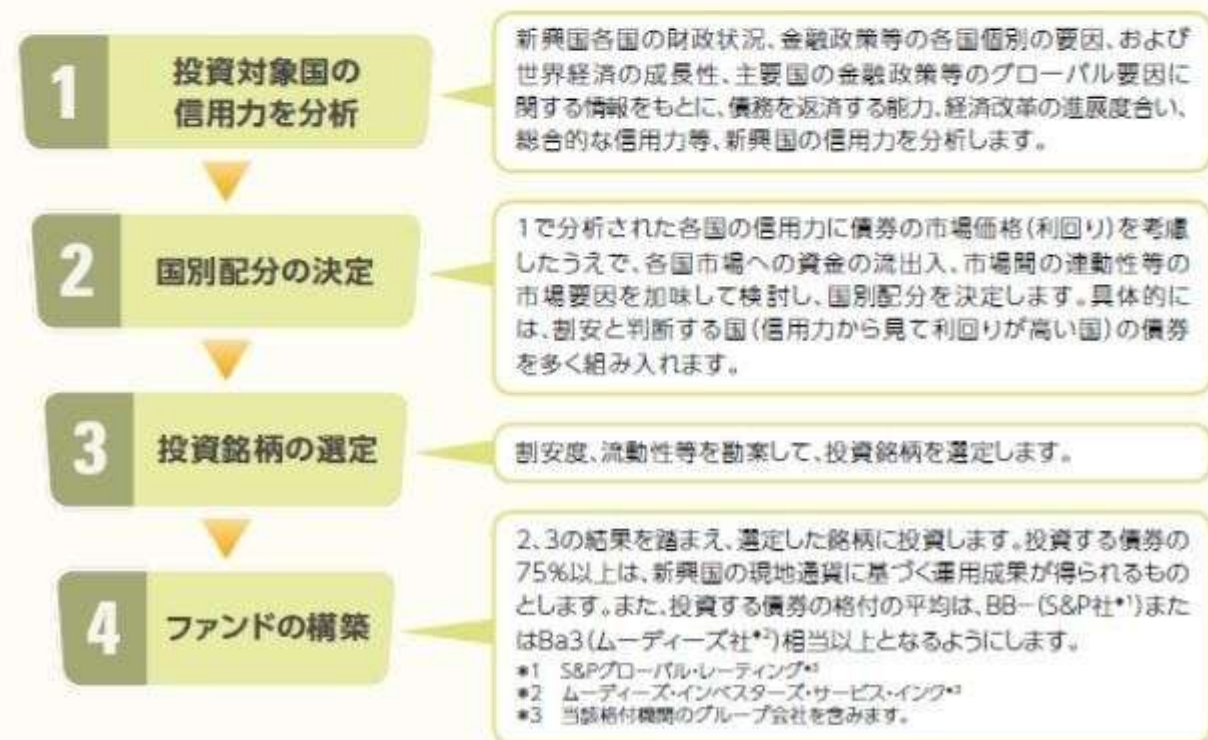
### [ GIM世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用） ]

■ J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクのグローバル債券運用グループに所属する国際ナショナル債券運用チームのポートフォリオ・マネジャーにより運用されます。



### [ GIM新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用） ]

■ J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクのグローバル債券運用グループに所属するエマージング債券運用チームのポートフォリオ・マネジャーにより運用されます。



※ 上記の運用プロセスは2019年3月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

(出所)JPモルガン・アセット・マネジメントのデータを基に委託会社作成

## 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、ファンド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。

ファンドで分配金が支払われるイメージ

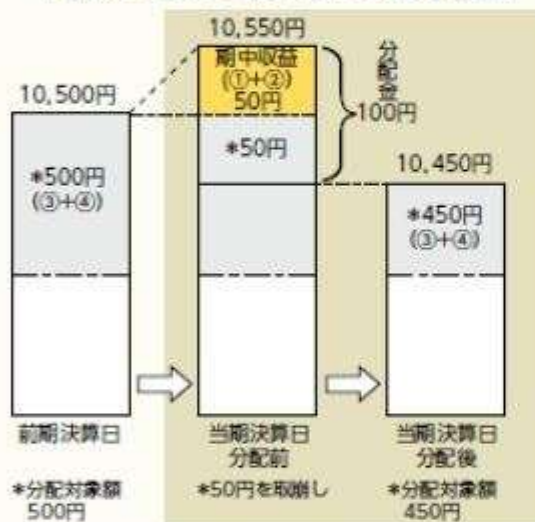


■分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

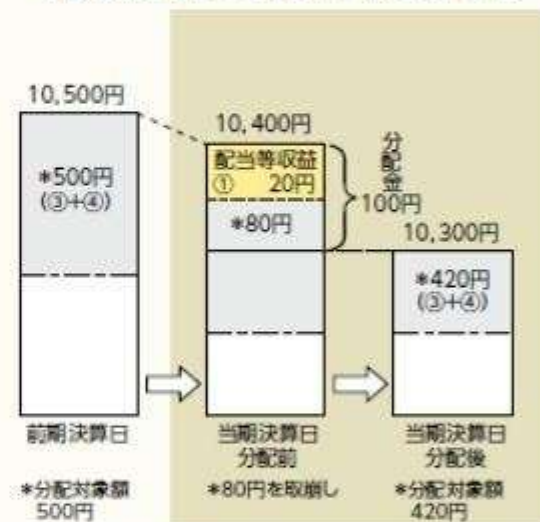
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### （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〕



(注) 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。

※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。

■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。

## (2) 【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいい

ます。以下同じ。）

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

口 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）受益証券
- 2．G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）受益証券
- 3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
- 4．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 5．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
- 6．投資信託または外国投資信託の受益証券（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。）
- 7．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 8．外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号、第2号、第6号の証券および第7号の証券を以下「投資信託証券」といいます。また、第3号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（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。

八 投資対象とする金融商品

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

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

主要投資対象となるファンドの名称、運用会社、主要運用対象、運用の基本方針に関しましては、上記「（1）投資方針」の記載をご覧ください。

### （3）【運用体制】

イ 運用体制

他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。また、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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



#### (4)【分配方針】

毎月決算(原則として毎月12日、休業日の場合は翌営業日)を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

- イ 分配対象額の範囲は、経費控除後の、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、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。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「(1)投資方針」と同一の運用を行います。

ファンドは計算期間中の基準価額の変動にかかわらず継続的な分配を目指します。このため、計算期間中の基準価額の上昇分を上回る分配を行う場合があります。分配金額は運用状況により変動することがあります。

#### (5)【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券、コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限  
外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- ト 外国為替予約取引の指図  
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- チ 資金の借入れ

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

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

産総額の10%を超えないものとします。

- (八) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)  
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)  
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

[参考情報：投資対象とする投資信託の概要]

## ▶ GIM世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）

主要投資対象	GIM世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)を通じて、世界各国の国債、政府機関債、国際機関債等に投資します。ただし、日本に所在する発行体の発行するものは除きます。
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
ベンチマーク	ありません。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>●株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>●外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
決算日	原則として毎月7日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬	純資産総額に対して年0.47628%*(税抜き0.441%) *消費税率が10%となった場合は年0.4851%となります。
その他の費用	有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用、監査費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
委託会社	JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

### G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）の投資対象・投資態度

#### 1．投資対象

主要投資対象は、世界各国の国債、政府機関債、国際機関債、MBS（モーゲージ・バック証券）、ABS（アセット・バック証券）、社債等の投資適格債とします。ただし、日本に所在する発行体の発行するものは投資対象としません。

上記のほか、一つまたは複数の発行体（日本に所在するものを除きます。）の信用リスクまたは債券指数の収益率を主として反映する仕組債に投資する場合があります。当該債券は、反映する信用リスクまたは債券指数の収益率を増大させる仕組みを持たないものに限りません。

#### 2．投資態度

上記1．およびに掲げる債券（以下「投資対象債券」といいます。）に分散投資を行い、安定的かつ高水準の配当等収益の確保を目指します。

投資対象債券の平均格付けは、AA-（S&P）またはAa3（ムーディーズ）以上に維持します。

投資対象債券の格付けは、BBB-（S&P）またはBaa3（ムーディーズ）以上とします。上記の各格付機関から異なる格付けを得ている場合は、最も高い格付けにより判断します。上記のいずれの格付機関からも格付けを得ていない投資対象債券であっても、J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（投資顧問会社）が上記格付けと同等であると判断したものに投資する場合があります。当該債券に投資した場合の平均格付けは、投資顧問会社の判断により当該債券をS&Pまたはムーディーズの同等の格付けにあてはめた上で算出します。保有する債券の格付けが変更され、上記の格付基準を満たさなくなった場合でも、投資顧問会社の判断により保有し続ける場合があります。外貨建資産については、円貨に対する為替ヘッジを行いません。なお、保有する債券について、円以外の通貨に対する為替ヘッジも原則として行いませんが、市況に応じて投資顧問会社が必要と判断した場合は、その建値以外の通貨（円以外）に基づく為替リスクを

ヘッジするために、機動的に外国為替の売買の予約を行うことがあります。

### ▶ GIM新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）

主要投資対象	GIM新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）を通じて、新興国の政府または政府機関の発行する債券に投資します。
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
ベンチマーク	ありません。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>● 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
決算日	原則として毎月7日（休業日の場合は翌営業日）
信託報酬	純資産総額に対して年0.80028%*（税抜き0.741%） *消費税率が10%となった場合は年0.8151%となります。
その他の費用	有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用、監査費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
委託会社	JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

## G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）の投資対象・投資態度

### 1．投資対象

主要投資対象は、新興国の政府または政府機関の発行する債券とします。

新興国とは、J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（投資顧問会社）が、国内経済が成長過程にあると判断する国をいいます。また、政府機関の発行する債券とは、政府機関により発行され、元本および利息の支払いについて政府保証の付いた債券をいいます。

上記のほか、信託財産の純資産総額の20%を上限に、政府および政府機関の発行する債券以外の、新興国に所在する発行体の発行する債券を投資対象とします。

上記およびのほか、一つまたは複数の新興国の発行体の信用リスクまたは債券指数の収益率を主として反映する仕組債に投資する場合があります。当該債券は、反映する信用リスクまたは債券指数の収益率を増大させる仕組みを持たないものに限り、またその場合、当該債券の発行体の格付けは、信用リスクを反映しようとする発行体の格付け（格付機関が公表するもの）または収益率を反映しようとする債券指数の格付け（当該指数の作成者が公表するもの）以上とします。

### 2．投資態度

上記1．、およびに掲げる債券（以下「投資対象債券」といいます。）に投資し、安定的かつ高水準の配当等収益の確保と信託財産の長期的な成長を目指した運用を行います。

投資対象債券は、主に当該債券発行国（なお、上記1．に掲げる仕組債に関しては、反映対象の信用リスクまたは収益率にかかる発行体の所在国とします。）の現地通貨に基づく運用成果が得られるものとし、信託財産の純資産総額の75%以上をそのような債券に投



資します。

投資対象債券の平均格付けは、BB-（S&P）またはBa3（ムーディーズ）以上に維持します。上記の各格付機関から異なる格付けを得ている場合は、最も高い格付けにより判断します。上記のいずれの格付機関からも格付けを得ていない債券であっても、投資顧問会社が上記格付けと同等であると判断したものに投資する場合があります。当該債券に投資した場合の平均格付けは、投資顧問会社の判断により当該債券をS&Pまたはムーディーズの同等の格付けにあてはめた上で算出します。

外貨建資産については、円貨に対する為替ヘッジを行いません。なお、保有する債券について、円以外の通貨に対する為替ヘッジも原則として行いませんが、市況に応じて投資顧問会社が必要と判断した場合は、その建値以外の通貨（円以外）に基づく為替リスクをヘッジするために、機動的に外国為替の売買の予約を行うことがあります。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として海外の債券を投資対象としており、その価格は、保有する債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。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。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入していません。

当ファンドが有するリスク等（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

#### （イ）債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

#### （ロ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

#### （ハ）為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### （二）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券

の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(ホ) 市場流動性リスク

ファンドの資金流入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

ロ 投資リスクの管理体制

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

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

### 〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX (配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発した指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額 × 申込口数）に、3.24%<sup>\*</sup>（税抜き

3.0%)を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

\*消費税率が10%になった場合は3.3%となります。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

ただし、解約の際には、1口につき解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た信託財産留保額が差し引かれます。

## (3) 【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年0.86292%*（税抜き0.799%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。 *消費税率が10%となった場合は年0.8789%となります。 信託報酬の実質的配分は以下の通りです。 <信託報酬の配分（税抜き）>		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.169%	ファンド運用の指図等の対価
	販売会社	年0.6%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
	上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。 委託会社の配分には、ファンドの運用に関して、助言を行う投資顧問会社に支払う投資顧問報酬が含まれています。		
投資対象とする投資信託	年0.57348%*（税抜き0.531%）程度（基本資産配分比率による試算） *消費税率が10%となった場合は年0.5841%となります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年1.4364%*（税抜き1.33%）程度（基本資産配分比率による試算） *消費税率が10%となった場合は年1.463%となります。		

## (4) 【その他の手数料等】

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0108%\*（税抜き0.01%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、各



計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

\*消費税率が10%となった場合は年0.011%となります。

- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

当ファンドが組み入れる他の投資信託は、その委託会社、受託会社の業務の対価として、信託報酬を支払います。また、その他、当該他の投資信託の諸経費は、その信託財産から支弁されません。この費用は、当該他の投資信託の基準価額に反映され、結果的に当ファンドがその持分にに応じて負担することになります。なお、現在、当ファンドが投資を行っている他の投資信託については、取得時、換金時に手数料はかかりません。

上記(1)～(4)にかかる手数料等および他の投資信託(ファンド)の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

#### (5)【課税上の取扱い】

##### イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 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。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

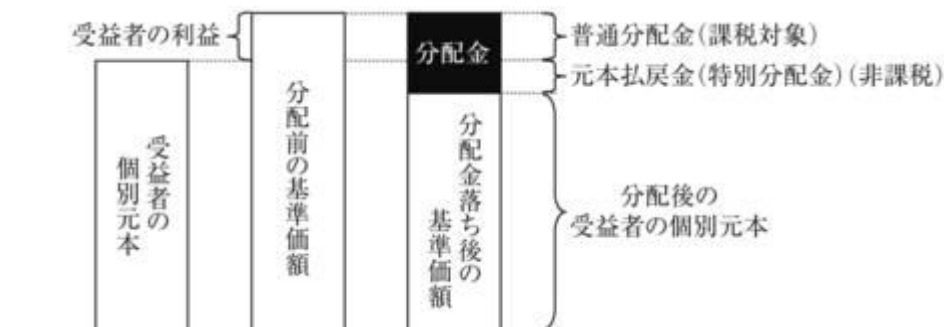
##### ハ 収益分配金の課税について

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

収益分配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ます。



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、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への直接投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません(約款規定なし)。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2019年3月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

#### 三井住友グローバル債券オープン

2019年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	12,694,175,931	95.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		550,140,704	4.15
合計(純資産総額)		13,244,316,635	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比率をいいます。以下同じ。

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### 三井住友グローバル債券オープン

##### イ 主要投資銘柄

2019年 3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資信託受益証券	GIM世界投資適格債券ファンドF (適格機関投資家専用)	10,394,787,785	0.8636	8,976,938,731	0.8707	9,050,741,724	68.34
日本	投資信託受益証券	GIM新興国現地通貨ソブリン・ ファンドF(適格機関投資家専用)	8,241,199,293	0.4456	3,672,278,404	0.4421	3,643,434,207	27.51

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

##### ロ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	95.85
合計	95.85

## 【投資不動産物件】

三井住友グローバル債券オープン

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友グローバル債券オープン

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

三井住友グローバル債券オープン

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
特定6期 (2009年 9月14日)	181,037,731,977	188,811,990,892	7,308	7,608
特定7期 (2010年 3月12日)	154,374,944,405	161,298,326,235	7,160	7,460
特定8期 (2010年 9月13日)	112,164,789,172	117,839,120,559	6,582	6,882
特定9期 (2011年 3月14日)	83,995,781,540	88,452,265,860	6,319	6,619
特定10期 (2011年 9月12日)	66,093,990,994	69,688,519,580	5,958	6,258
特定11期 (2012年 3月12日)	49,014,480,608	51,299,009,892	6,134	6,364
特定12期 (2012年 9月12日)	38,423,218,973	39,057,896,561	5,877	5,967
特定13期 (2013年 3月12日)	40,463,644,497	41,001,597,283	7,242	7,332
特定14期 (2013年 9月12日)	34,577,073,001	35,035,282,000	7,084	7,174
特定15期 (2014年 3月12日)	31,895,962,908	32,304,728,289	7,406	7,496
特定16期 (2014年 9月12日)	29,950,788,954	30,316,260,480	7,762	7,852
特定17期 (2015年 3月12日)	27,421,327,748	27,743,486,351	8,021	8,111
特定18期 (2015年 9月14日)	23,813,125,964	24,103,282,035	7,677	7,767
特定19期 (2016年 3月14日)	21,362,556,963	21,632,505,561	7,285	7,375
特定20期 (2016年 9月12日)	18,870,420,206	19,126,994,704	6,757	6,847
特定21期 (2017年 3月13日)	18,323,002,108	18,563,945,230	7,106	7,196

特定22期	(2017年 9月12日)	16,871,104,322	17,090,363,978	7,246	7,336
特定23期	(2018年 3月12日)	15,026,193,216	15,225,794,469	6,960	7,050
特定24期	(2018年 9月12日)	13,635,956,996	13,824,350,642	6,676	6,766
特定25期	(2019年 3月12日)	13,272,089,742	13,451,197,755	6,783	6,873
	2018年 3月末日	14,957,880,968		6,962	
	4月末日	14,905,550,299		6,998	
	5月末日	14,256,854,270		6,756	
	6月末日	14,125,608,612		6,757	
	7月末日	14,216,983,853		6,853	
	8月末日	13,753,859,606		6,705	
	9月末日	13,964,647,348		6,861	
	10月末日	13,630,113,727		6,752	
	11月末日	13,582,720,414		6,781	
	12月末日	13,211,619,826		6,664	
	2019年 1月末日	13,223,632,509		6,695	
	2月末日	13,331,159,710		6,796	
	3月末日	13,244,316,635		6,803	

## 【分配の推移】

## 三井住友グローバル債券オープン

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
特定6期	2009年 3月13日～2009年 9月14日	300
特定7期	2009年 9月15日～2010年 3月12日	300
特定8期	2010年 3月13日～2010年 9月13日	300
特定9期	2010年 9月14日～2011年 3月14日	300
特定10期	2011年 3月15日～2011年 9月12日	300
特定11期	2011年 9月13日～2012年 3月12日	230
特定12期	2012年 3月13日～2012年 9月12日	90
特定13期	2012年 9月13日～2013年 3月12日	90
特定14期	2013年 3月13日～2013年 9月12日	90
特定15期	2013年 9月13日～2014年 3月12日	90
特定16期	2014年 3月13日～2014年 9月12日	90
特定17期	2014年 9月13日～2015年 3月12日	90
特定18期	2015年 3月13日～2015年 9月14日	90
特定19期	2015年 9月15日～2016年 3月14日	90
特定20期	2016年 3月15日～2016年 9月12日	90
特定21期	2016年 9月13日～2017年 3月13日	90
特定22期	2017年 3月14日～2017年 9月12日	90
特定23期	2017年 9月13日～2018年 3月12日	90
特定24期	2018年 3月13日～2018年 9月12日	90

特定25期	2018年 9月13日 ~ 2019年 3月12日	90
-------	---------------------------	----

## 【収益率の推移】

## 三井住友グローバル債券オープン

	収益率（％）
特定6期	9.9
特定7期	2.1
特定8期	3.9
特定9期	0.6
特定10期	1.0
特定11期	6.8
特定12期	2.7
特定13期	24.8
特定14期	0.9
特定15期	5.8
特定16期	6.0
特定17期	4.5
特定18期	3.2
特定19期	3.9
特定20期	6.0
特定21期	6.5
特定22期	3.2
特定23期	2.7
特定24期	2.8
特定25期	3.0

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（当該特定期間中の分配金累計額を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除したものをいいます。

## （４）【設定及び解約の実績】

## 三井住友グローバル債券オープン

	設定口数（口）	解約口数（口）
特定6期	10,645,676,775	33,743,729,456
特定7期	6,540,455,590	38,628,966,205
特定8期	2,970,977,677	48,193,114,072
特定9期	1,563,528,354	39,042,694,639
特定10期	1,492,984,344	23,483,344,117
特定11期	983,396,314	32,005,102,787

特定12期	270,769,383	14,797,850,356
特定13期	229,341,447	9,735,724,522
特定14期	174,765,257	7,241,258,389
特定15期	135,671,807	5,874,561,373
特定16期	98,142,380	4,581,548,081
特定17期	244,761,488	4,645,977,576
特定18期	110,280,798	3,276,165,000
特定19期	70,737,543	1,768,256,566
特定20期	83,166,714	1,480,049,261
特定21期	77,303,279	2,218,468,575
特定22期	61,991,810	2,562,958,341
特定23期	63,488,058	1,758,101,639
特定24期	57,301,545	1,221,362,316
特定25期	60,593,070	918,100,817

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）

投資有価証券の主要銘柄

2019年3月29日

国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	G I M世界投資適格債券マザー ファンド（適格機関投資家専用）	6,137,173,765	1.4619	8,971,934,328	1.4751	9,052,945,020	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）」は「G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券を主要投資対象としており、「G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

2019年3月29日

国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.375% FEB24	4,550,000	11,078.88	504,089,040	11,184.84	508,910,395	2.375	2024/2/29	5.19
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.875% OCT23	3,058,700	11,305.73	345,808,453	11,414.62	349,139,219	2.875	2023/10/31	3.56

オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 2.75% NOV28 152	2,000,000	8,360.21	167,204,368	8,575.37	171,507,549	2.75	2028/11/21	1.75
イギリス	国債証券	UK GOVT 4.25% DEC40	780,000	21,329.45	166,369,769	21,880.52	170,668,107	4.25	2040/12/7	1.74
アメリカ	特殊債券	G2SF 4.5% APR49 TBA	1,350,000	11,473.59	154,893,482	11,525.61	155,595,840	4.5	2049/4/1	1.59
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.375% MAR21	1,210,000	11,075.58	134,014,616	11,124.14	134,602,169	2.375	2021/3/15	1.37
アメリカ	特殊債券	FGLMC 3.5% APR49 TBA	1,180,000	11,144.08	131,500,258	11,265.48	132,932,723	3.5	2049/4/1	1.35
カナダ	国債証券	CANADA GOVT 3.25% JUN21	1,550,000	8,550.51	132,532,949	8,573.23	132,885,202	3.25	2021/6/1	1.35
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.875% NOV21	1,150,000	11,218.66	129,014,601	11,281.96	129,742,540	2.875	2021/11/15	1.32
フランス	特殊債券	UNEDIC 0.25% EMTN	1,000,000	12,598.74	125,987,457	12,651.80	126,518,083	0.25	2023/11/24	1.29
イタリア	国債証券	ITALY BTP 0.05% OCT19	1,000,000	12,462.85	124,628,508	12,462.10	124,621,034	0.05	2019/10/15	1.27
アメリカ	特殊債券	FNCL 4.0% APR49 TBA	1,050,000	11,341.79	119,088,802	11,421.56	119,926,429	4	2049/4/1	1.22
イタリア	国債証券	ITALY BTP 3.85% SEP49	916,000	12,863.06	117,825,648	13,053.26	119,567,909	3.85	2049/9/1	1.22
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 1.75% DEC20	1,045,000	10,952.45	114,453,191	10,995.38	114,901,725	1.75	2020/12/31	1.17
アメリカ	特殊債券	FNCL 4.5% APR49 TBA	900,000	11,496.13	103,465,225	11,567.23	104,105,152	4.5	2049/4/1	1.06
イギリス	国債証券	UK GOVT 2% SEP25	650,000	15,461.97	100,502,818	15,605.79	101,437,649	2	2025/9/7	1.03
イタリア	社債券	INTESA SANPAOLO 0.5%	800,000	12,472.19	99,777,543	12,480.53	99,844,307	0.5	2020/2/3	1.02
アメリカ	特殊債券	FNCI 3.0% APR34 TBA	880,000	11,099.00	97,671,200	11,199.58	98,556,345	3	2034/4/1	1.00
アメリカ	特殊債券	FGLMC 4.0% APR49 TBA	840,000	11,345.25	95,300,176	11,431.97	96,028,548	4	2049/4/1	0.98
アメリカ	国債証券	US T-BOND 3% FEB47	813,100	11,090.32	90,175,464	11,513.47	93,616,092	3	2047/2/15	0.95
カナダ	地方債証券	ONTARIO 2.6%	1,090,000	8,398.95	91,548,567	8,495.88	92,605,177	2.6	2025/6/2	0.94
フランス	国債証券	FRANCE OAT 0.75% MAY28	679,900	12,918.74	87,834,516	13,089.51	88,995,593	0.75	2028/5/25	0.91
スペイン	国債証券	SPAIN GOVT 1.5% APR27	660,000	13,083.53	86,351,320	13,141.08	86,731,128	1.5	2027/4/30	0.88



フランス	国債証券	FRANCE OAT 3.25% MAY45	464,800	17,715.91	82,343,594	18,320.28	85,152,684	3.25	2045/5/25	0.87
オーストラ リア	国債証券	AUSTRALIA5.75% MAY21 124	950,000	8,548.95	81,215,067	8,565.94	81,376,436	5.75	2021/5/15	0.83
イギリス	国債証券	UK GOVT 4.25% DEC55	300,000	24,936.61	74,809,854	26,016.08	78,048,243	4.25	2055/12/7	0.80
オーストラ リア	国債証券	AUSTRALIA4.25% APR26 142	840,000	9,116.42	76,577,934	9,266.54	77,838,973	4.25	2026/4/21	0.79
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.875% AUG28	650,000	11,328.74	73,636,871	11,548.16	75,063,057	2.875	2028/8/15	0.76
アメリカ	国債証券	POLAND USD 3% MAR23	650,000	11,072.91	71,973,963	11,155.60	72,511,432	3	2023/3/17	0.74
イギリス	社債券	NAB 1.125% EMTN	500,000	14,407.53	72,037,662	14,456.53	72,282,678	1.125	2021/11/10	0.74

(注) 上記は、JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社から入手した情報を基に、委託会社が作成しています。

## G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF (適格機関投資家専用)

### 投資有価証券の主要銘柄

2019年3月29日

国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	G I M新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド(適格機関投資家専用)	2,459,036,412	1.4991	3,686,341,486	1.4823	3,645,029,673	100.05

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF (適格機関投資家専用)」は「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)」受益証券を主要投資対象としており、「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

2019年3月29日

国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN21 NTN	24,430,000	3,022.85	738,484,501	3,036.39	741,792,149	10	2021/1/1	7.31
ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN23 NTN	17,458,000	3,050.99	532,643,202	3,072.91	536,470,056	10	2023/1/1	5.29

メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.25% DEC21	74,000,000	562.15	415,993,301	565.21	418,257,568	7.25	2021/12/9	4.12
インドネシア	国債証券	INDON 9% MAR29 FR71	46,542,000,000	0.82	384,624,114	0.84	392,044,397	9	2029/3/15	3.86
コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 6% APR28	11,222,500,000	3.34	375,219,226	3.39	380,522,373	6	2028/4/28	3.75
メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 6.5% JUN22	63,980,000	548.45	350,900,025	552.26	353,337,951	6.5	2022/6/9	3.48
南アフリカ	国債証券	S.AFRICA10.5% DEC26 R186	39,456,829	837.42	330,419,851	835.84	329,796,117	10.5	2026/12/21	3.25
ブラジル	国債証券	BRAZIL 1/L 6% AUG22 NTN	3,166,000	9,725.53	307,910,326	9,775.39	309,489,066	6	2022/8/15	3.05
メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.5% JUN27	50,600,000	551.70	279,163,903	555.94	281,306,545	7.5	2027/6/3	2.77
南アフリカ	国債証券	S.AFRICA8.75% FEB48 2048	36,635,031	688.73	252,318,207	682.53	250,046,249	8.75	2048/2/28	2.46
インドネシア	国債証券	INDON 8.25% MAY36 FR72	29,435,000,000	0.76	226,523,342	0.78	231,686,889	8.25	2036/5/15	2.28
ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN25 NTN	6,940,000	3,055.49	212,051,079	3,085.33	214,122,044	10	2025/1/1	2.11
ロシア	国債証券	RUSSIA 8.15% FEB27 6207	116,550,000	171.55	199,942,248	172.71	201,293,505	8.15	2027/2/3	1.98
チリ	国債証券	CHILE GOVT 4.5% MAR26	1,190,000,000	16.69	198,614,365	16.82	200,236,716	4.5	2026/3/1	1.97
ポーランド	国債証券	POLAND 2.5% JUL26 0726	6,317,000	2,880.39	181,954,615	2,894.31	182,833,942	2.5	2026/7/25	1.80
メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 10% DEC24	26,836,600	625.46	167,853,239	629.46	168,926,580	10	2024/12/5	1.67
ポーランド	国債証券	POLAND 2.75% APR28 0428	5,569,000	2,890.16	160,953,511	2,906.40	161,857,917	2.75	2028/4/25	1.60
インドネシア	国債証券	INDON 7% MAY27 FR59	21,302,000,000	0.73	155,556,531	0.74	159,112,262	7	2027/5/15	1.57
ポーランド	国債証券	POLAND GOVT 4% OCT23	4,840,000	3,140.78	152,014,091	3,140.26	151,988,826	4	2023/10/25	1.50
タイ	国債証券	THAI GOVT 3.775% JUN32	37,900,000	383.85	145,479,582	390.07	147,836,651	3.775	2032/6/25	1.46
南アフリカ	国債証券	S.AFRICA 7% FEB31 R213	23,210,000	635.32	147,460,000	631.46	146,563,908	7	2031/2/28	1.44
ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN27 NTN	4,690,000	3,055.65	143,310,127	3,083.82	144,631,296	10	2027/1/1	1.43
コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 7.25% OCT34	3,630,000,000	3.53	128,153,836	3.54	128,693,722	7.25	2034/10/18	1.27

ドイツ	国債証券	RUSSIA 7.6% APR21 6205	74,800,000	171.31	128,147,188	170.89	127,828,697	7.6	2021/4/14	1.26
アメリカ	国債証券	PERU GOVT6.95% AUG31 GDN	3,025,000	3,694.34	111,753,803	3,757.60	113,667,406	6.95	2031/8/12	1.12
マレーシア	国債証券	MALAYSIA 4.059% SEP24	4,100,000	2,758.10	113,082,395	2,766.43	113,423,646	4.059	2024/9/30	1.12
南アフリカ	国債証券	S.AFRICA8.25% MAR32 2032	16,400,872	694.38	113,885,884	690.08	113,180,384	8.25	2032/3/31	1.12
マレーシア	国債証券	MALAYSIA 4.642% NOV33	3,900,000	2,829.45	110,348,660	2,888.80	112,663,325	4.642	2033/11/7	1.11
ポーランド	国債証券	POLAND 2.75% OCT29 1029	3,860,000	2,871.92	110,856,270	2,881.67	111,232,539	2.75	2029/10/25	1.10
メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 10% NOV36	16,607,300	653.89	108,594,494	660.15	109,634,591	10	2036/11/20	1.08

(注) 上記は、J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社から入手した情報を基に、委託会社が作成しています。

#### 参考情報

基準日:2019年3月29日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移



※分配金再投資基準価額、基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。  
※分配金再投資基準価額は、上記期間における分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算した価額です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2019年 3月	15円
2019年 2月	15円
2019年 1月	15円
2018年12月	15円
2018年11月	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	4,457円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## 主要な資産の状況

### ■三井住友グローバル債券オープン

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	95.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.15
合計(純資産総額)		100.00

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。  
※[主要投資銘柄(上位10銘柄)]は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資信託受益証券	GIM世界投資適格債券ファンドF (適格機関投資家専用)	68.34
日本	投資信託受益証券	GIM新興国現地通貨ソブリンファンドF (適格機関投資家専用)	27.51

### ▶投資対象とする投資信託の現況

#### ■GIM世界投資適格債券ファンドF(適格機関投資家専用)

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	GIM世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)	100.03

[GIM世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)]が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.375% FEB24	2.375	2024/02/29	5.19
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.875% OCT23	2.875	2023/10/31	3.56
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA2.75% NOV28 152	2.750	2028/11/21	1.75
イギリス	国債証券	UK GOVT 4.25% DEC40	4.250	2040/12/07	1.74
アメリカ	特殊債券	G2SF 4.5% APR49 TBA	4.500	2049/04/01	1.59
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.375% MAR21	2.375	2021/03/15	1.37
アメリカ	特殊債券	FGLMC 3.5% APR49 TBA	3.500	2049/04/01	1.35
カナダ	国債証券	CANADA GOVT 3.25% JUN21	3.250	2021/06/01	1.35
アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.875% NOV21	2.875	2021/11/15	1.32
フランス	特殊債券	UNEDIC 0.25% EMTN	0.250	2023/11/24	1.29

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託のマザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。  
※[主要投資銘柄(上位10銘柄)]は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。  
※JPモルガン・アセット・マネジメントのデータを基に委託会社作成



## ■GIM新興国現地通貨ソブリン・ファンドF(適格機関投資家専用)

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	GIM新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)	100.05

[GIM新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)]が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

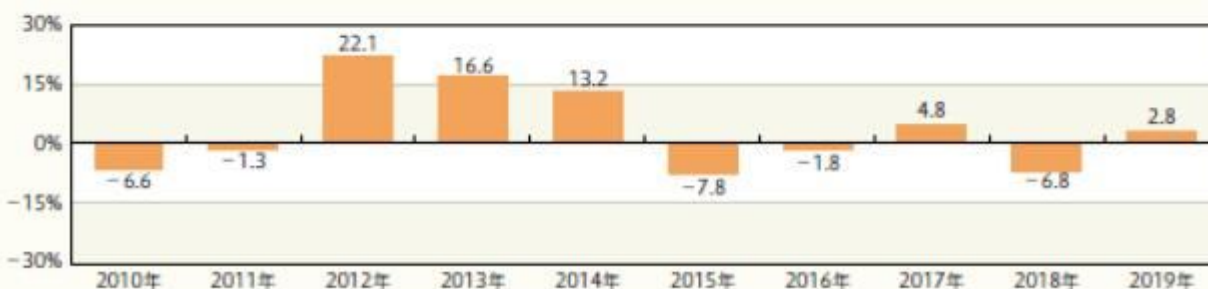
国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN21 NTN	10.000	2021/01/01	7.31
ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN23 NTN	10.000	2023/01/01	5.29
メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.25% DEC21	7.250	2021/12/09	4.12
インドネシア	国債証券	INDON 9% MAR29 FR71	9.000	2029/03/15	3.86
コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 6% APR28	6.000	2028/04/28	3.75
メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 6.5% JUN22	6.500	2022/06/09	3.48
南アフリカ	国債証券	S.AFRICA 10.5% DEC26 R186	10.500	2026/12/21	3.25
ブラジル	国債証券	BRAZIL I/L 6% AUG22 NTN	6.000	2022/08/15	3.05
メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.5% JUN27	7.500	2027/06/03	2.77
南アフリカ	国債証券	S.AFRICA 8.75% FEB48 2048	8.750	2048/02/28	2.46

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託のマザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※[主要投資銘柄(上位10銘柄)]は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

※JPモルガン・アセット・マネジメントのデータを基に委託会社作成

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2019年のファンドの収益率は、年初から2019年3月29日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

#### イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

#### ハ 申込手数料

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、3.24%<sup>\*</sup>（税抜き3.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

<sup>\*</sup>消費税率が10%になった場合は3.3%となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

申込手数料、申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（0.3%）を差し引いた価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-

2976)にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「グロ債券」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### (2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

2006年9月20日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### (4)【計算期間】

毎月13日から翌月12日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日

とします。

## （５）【その他】

### イ 信託の終了

#### （イ）信託契約の解約

- a．委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が20億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c．上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d．上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
- e．委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f．上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

#### （ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### （ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

#### （ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c．委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

### ロ 収益分配金、償還金の支払い

#### （イ）収益分配金

- a．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、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。
- b．分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかか



る決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

### 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

### 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

### ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受け付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

### へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

### ト 公告

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

<https://www.smd-am.co.jp>

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

#### チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は6ヵ月（原則として3月、9月の各決算時までの期間）毎に、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

#### 4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

##### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

##### ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

##### ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

##### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求す

ることができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)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。
2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、特定25期(平成30年9月13日から平成31年3月12日まで)の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友グローバル債券オープン】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	特定24期 (平成30年 9月12日現在)	特定25期 (平成31年 3月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	364,031	690,809
コール・ローン	501,970,829	590,355,073
投資信託受益証券	13,197,896,466	12,733,343,773
流動資産合計	13,700,231,326	13,324,389,655
資産合計	13,700,231,326	13,324,389,655
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	30,636,728	29,350,467
未払解約金	23,744,593	14,032,258
未払受託者報酬	366,582	330,764
未払委託者報酬	9,396,774	8,478,553
未払利息	1,306	1,293
その他未払費用	128,347	106,578
流動負債合計	64,274,330	52,299,913
負債合計	64,274,330	52,299,913
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	20,424,485,892	19,566,978,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	6,788,528,896	6,294,888,403
元本等合計	13,635,956,996	13,272,089,742
純資産合計	13,635,956,996	13,272,089,742
負債純資産合計	13,700,231,326	13,324,389,655

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	特定24期		特定25期	
	自	平成30年 3月13日 至 平成30年 9月12日	自	平成30年 9月13日 至 平成31年 3月12日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		230,176,419		214,429,261
受取利息		25		23
有価証券売買等損益		574,657,434		236,447,307
<b>営業収益合計</b>		<b>344,480,990</b>		<b>450,876,591</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		151,705		129,303
受託者報酬		2,354,384		2,162,784
委託者報酬		60,350,658		55,439,330
その他費用		754,001		743,944
<b>営業費用合計</b>		<b>63,610,748</b>		<b>58,475,361</b>
営業利益又は営業損失（ ）		408,091,738		392,401,230
経常利益又は経常損失（ ）		408,091,738		392,401,230
当期純利益又は当期純損失（ ）		408,091,738		392,401,230
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（ ）		2,354,012		1,910,263
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,562,353,447		6,788,528,896
剰余金増加額又は欠損金減少額		385,951,018		302,158,488
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		385,951,018		302,158,488
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		17,995,095		19,900,949
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		17,995,095		19,900,949
分配金		188,393,646		179,108,013
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,788,528,896		6,294,888,403

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	特定25期	
	自 平成30年 9月13日	至 平成31年 3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	特定24期		特定25期	
	( 平成30年 9月12日現在 )		( 平成31年 3月12日現在 )	
1. 当特定期間の末日における受益権の総数		20,424,485,892口		19,566,978,145口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	6,788,528,896円	元本の欠損	6,294,888,403円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.6676円	1口当たり純資産額	0.6783円
	(10,000口当たりの純資産額)	6,676円	(10,000口当たりの純資産額)	6,783円

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	特定24期 自 平成30年 3月13日 至 平成30年 9月12日	特定25期 自 平成30年 9月13日 至 平成31年 3月12日
分配金の計算過程	<p>(自 平成30年 3月13日 至 平成30年 4月12日)</p> <p>第139計算期間末における費用控除後の配当等収益(30,050,000円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(8,569,354円)、および分配準備積立金(676,556,138円)より、分配対象収益は715,175,492円(1万口当たり333.63円)であり、うち32,152,663円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自 平成30年 4月13日 至 平成30年 5月14日)</p> <p>第140計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,159,764円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(8,779,681円)、および分配準備積立金(668,285,580円)より、分配対象収益は696,225,025円(1万口当たり327.84円)であり、うち31,853,588円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自 平成30年 5月15日 至 平成30年 6月12日)</p> <p>第141計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,139,547円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(6,862,299円)、および分配準備積立金(651,553,111円)より、分配対象収益は683,554,957円(1万口当たり324.99円)であり、うち31,547,951円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自 平成30年 6月13日 至 平成30年 7月12日)</p> <p>第142計算期間末における費用控除後の配当等収益(28,737,366円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(7,108,672円)、および分配準備積立金(638,584,633円)より、分配対象収益は674,430,671円(1万口当たり324.01円)であり、うち31,221,307円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自 平成30年 9月13日 至 平成30年10月12日)</p> <p>第145計算期間末における費用控除後の配当等収益(23,362,015円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(7,836,716円)、および分配準備積立金(635,416,793円)より、分配対象収益は666,615,524円(1万口当たり328.80円)であり、うち30,408,954円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自 平成30年10月13日 至 平成30年11月12日)</p> <p>第146計算期間末における費用控除後の配当等収益(30,794,538円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(8,085,485円)、および分配準備積立金(624,234,316円)より、分配対象収益は663,114,339円(1万口当たり329.23円)であり、うち30,210,360円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自 平成30年11月13日 至 平成30年12月12日)</p> <p>第147計算期間末における費用控除後の配当等収益(23,287,137円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(8,323,289円)、および分配準備積立金(618,124,481円)より、分配対象収益は649,734,907円(1万口当たり326.15円)であり、うち29,880,746円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自 平成30年12月13日 至 平成31年 1月15日)</p> <p>第148計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,574,128円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(8,568,246円)、および分配準備積立金(607,502,439円)より、分配対象収益は630,644,813円(1万口当たり318.64円)であり、うち29,685,412円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>



項目	特定24期	特定25期
	自 平成30年 3月13日 至 平成30年 9月12日	自 平成30年 9月13日 至 平成31年 3月12日
	<p>（自 平成30年 7月13日 至 平成30年 8月13日）</p> <p>第143計算期間末における費用控除後の配当等収益（48,982,312円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（7,320,031円）、および分配準備積立金（631,268,561円）より、分配対象収益は687,570,904円（1万口当たり332.87円）であり、うち30,981,409円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（自 平成30年 8月14日 至 平成30年 9月12日）</p> <p>第144計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,739,473円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（7,572,964円）、および分配準備積立金（642,155,869円）より、分配対象収益は678,468,306円（1万口当たり332.17円）であり、うち30,636,728円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>	<p>（自 平成31年 1月16日 至 平成31年 2月12日）</p> <p>第149計算期間末における費用控除後の配当等収益（59,395,022円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（8,845,807円）、および分配準備積立金（589,948,370円）より、分配対象収益は658,189,199円（1万口当たり333.84円）であり、うち29,572,074円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（自 平成31年 2月13日 至 平成31年 3月12日）</p> <p>第150計算期間末における費用控除後の配当等収益（33,911,526円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（9,086,006円）、および分配準備積立金（615,103,072円）より、分配対象収益は658,100,604円（1万口当たり336.32円）であり、うち29,350,467円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項目	特定25期
	自 平成30年 9月13日 至 平成31年 3月12日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当特定期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク</p>

項 目	特定25期 自 平成30年 9月13日 至 平成31年 3月12日
	有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	特定25期 （平成31年 3月12日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	特定25期 (平成31年 3月12日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

特定24期(自平成30年 3月13日 至平成30年 9月12日)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	23,126,614円
合計	23,126,614円

特定25期(自平成30年 9月13日 至平成31年 3月12日)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	99,828,478円
合計	99,828,478円

## (デリバティブ取引に関する注記)

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)

特定25期 自平成30年 9月13日 至平成31年 3月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項目	特定24期 (平成30年 9月12日現在)	特定25期 (平成31年 3月12日現在)
期首元本額	21,588,546,663円	20,424,485,892円
期中追加設定元本額	57,301,545円	60,593,070円
期中一部解約元本額	1,221,362,316円	918,100,817円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）	10,492,201,678	9,061,065,369	
	G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）	8,241,199,293	3,672,278,404	
合計		18,733,400,971	12,733,343,773	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

三井住友グローバル債券オープンは、「G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）」および「G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）」（以下、両者を併せて同ファンドという。）投資信託受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は全て同ファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外となっております。

## G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

区分	注記 番号	前期 (平成30年 8月 7日現在)	当期 (平成31年 2月 7日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			

親投資信託受益証券		9,614,625,459	9,042,623,607
流動資産合計		9,614,625,459	9,042,623,607
資産合計		9,614,625,459	9,042,623,607
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		16,694,598	15,914,444
未払受託者報酬		334,167	326,955
未払委託者報酬		3,349,997	3,277,721
その他未払費用		167,073	163,466
流動負債合計		20,545,835	19,682,586
負債合計		20,545,835	19,682,586
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,129,732,206	10,609,629,884
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	1,535,652,582	1,586,688,863
（分配準備積立金）		536,442,439	503,899,871
元本等合計		9,594,079,624	9,022,941,021
純資産合計		9,594,079,624	9,022,941,021
負債純資産合計		9,614,625,459	9,042,623,607

## ( 2 ) 損益及び剰余金計算書

( 単位 : 円 )

区分	注記 番号	前期	当期
		(自 平成30年 2月 8日 至 平成30年 8月 7日)	(自 平成30年 8月 8日 至 平成31年 2月 7日)
		金額	金額
営業収益			
有価証券売買等損益		119,758,372	1,945,125
営業収益合計		119,758,372	1,945,125
営業費用			
受託者報酬	1	2,116,284	2,014,280
委託者報酬		21,215,646	20,193,074
その他費用		1,058,074	1,007,077
営業費用合計		24,390,004	23,214,431
営業利益又は営業損失（ ）		144,148,376	21,269,306
経常利益又は経常損失（ ）		144,148,376	21,269,306
当期純利益又は当期純損失（ ）		144,148,376	21,269,306
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（ ）		138,060	303,300

期首剰余金又は期首欠損金( )		1,426,655,843	1,535,652,582
剰余金増加額又は欠損金減少額		151,584,684	86,036,658
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		151,584,684	86,036,658
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,665,848	13,631,033
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,665,848	13,631,033
分配金	2	102,629,139	101,869,300
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,535,652,582	1,586,688,863

## (3) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
有価証券の評価基準および評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (平成30年8月7日現在)	当期 (平成31年2月7日現在)
1 期首元本額	12,073,512,979円	11,129,732,206円
期中追加設定元本額	93,665,848円	90,631,033円
期中一部解約元本額	1,037,446,621円	610,733,355円
2 元本の欠損	1,535,652,582円	1,586,688,863円
受益権の総数	11,129,732,206口	10,609,629,884口
1 口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額)	0.8620円 (8,620円)	0.8504円 (8,504円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期 (自 平成30年2月8日 至 平成30年8月7日)	当期 (自 平成30年8月8日 至 平成31年2月7日)
1 信託財産の運用の指図に関す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委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に年率0.25%を乗じて得た額	同左
2 分配金の計算過程	(自 平成30年2月8日 至 平成30年3月7日)	(自 平成30年8月8日 至 平成30年9月7日)
費用控除後の配当等収益額	14,520,190円	15,375,671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	- 円	- 円
収益調整金額	25,064,111円	27,418,421円



分配準備積立金額	588,256,698円	528,559,139円
当ファンドの分配対象収益額	627,840,999円	571,353,231円
当ファンドの期末残存口数	12,011,698,190口	10,966,180,804口
1万口当たり収益分配対象額	522.69円	521.01円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	18,017,547円	16,449,271円
	(自 平成30年3月8日 至 平成30年4月9日)	(自 平成30年9月8日 至 平成30年10月9日)
費用控除後の配当等収益額	20,076,418円	19,149,525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	- 円	- 円
収益調整金額	23,989,116円	26,903,562円
分配準備積立金額	559,679,112円	517,580,490円
当ファンドの分配対象収益額	603,744,646円	563,633,577円
当ファンドの期末残存口数	11,496,539,498口	10,760,254,709口
1万口当たり収益分配対象額	525.15円	523.81円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	17,244,809円	16,140,382円
	(自 平成30年4月10日 至 平成30年5月7日)	(自 平成30年10月10日 至 平成30年11月7日)
費用控除後の配当等収益額	14,252,479円	15,144,060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	- 円	- 円
収益調整金額	23,759,708円	29,030,277円
分配準備積立金額	557,131,420円	520,589,633円
当ファンドの分配対象収益額	595,143,607円	564,763,970円
当ファンドの期末残存口数	11,386,598,519口	10,801,004,506口
1万口当たり収益分配対象額	522.67円	522.88円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	17,079,897円	16,201,506円

区分	前期 (自 平成30年2月8日 至 平成30年8月7日)	当期 (自 平成30年8月8日 至 平成31年2月7日)
	(自 平成30年5月8日 至 平成30年6月7日)	(自 平成30年11月8日 至 平成30年12月7日)
費用控除後の配当等収益額	15,734,163円	14,935,390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	- 円	- 円
収益調整金額	23,267,274円	28,748,404円
分配準備積立金額	542,815,714円	514,487,721円
当ファンドの分配対象収益額	581,817,151円	558,171,515円
当ファンドの期末残存口数	11,150,596,668口	10,696,133,847口
1万口当たり収益分配対象額	521.78円	521.84円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	16,725,895円	16,044,200円

	(自 平成30年6月8日 至 平成30年7月9日)	(自 平成30年12月8日 至 平成31年1月7日)
費用控除後の配当等収益額	19,194,042円	14,733,581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	- 円	- 円
収益調整金額	28,113,712円	28,381,816円
分配準備積立金額	541,823,982円	506,832,509円
当ファンドの分配対象収益額	589,131,736円	549,947,906円
当ファンドの期末残存口数	11,244,262,516口	10,559,748,648口
1万口当たり収益分配対象額	523.93円	520.79円
1万口当たり分配金額	15.00円	20.00円
収益分配金金額	16,866,393円	21,119,497円
	(自 平成30年7月10日 至 平成30年8月7日)	(自 平成31年1月8日 至 平成31年2月7日)
費用控除後の配当等収益額	14,527,895円	19,367,722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	- 円	- 円
収益調整金額	27,827,358円	30,947,096円
分配準備積立金額	538,609,142円	500,446,593円
当ファンドの分配対象収益額	580,964,395円	550,761,411円
当ファンドの期末残存口数	11,129,732,206口	10,609,629,884口
1万口当たり収益分配対象額	521.99円	519.11円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	16,694,598円	15,914,444円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、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。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される親投資信託受益証券であります。 G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用) 親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドで投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果(パフォーマンス)のモニターおよびリスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。更に、投資制限の管理を行います。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。</p>
-------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

	各特定期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2)有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品は、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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (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8月7日現在)	当期 (平成31年2月7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)
親投資信託受益証券	6,020,847	207,757,584
合計	6,020,847	207,757,584

## (デリバティブ取引等に関する注記)

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。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表(平成31年2月7日現在)

## (イ) 株式

該当事項はありません。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
----	----	----	----	-----	----

親投資信託 受益証券	日本円	G I M世界投資適格債券マザーファン ド（適格機関投資家専用）	6,290,958,402	9,042,623,607	
合計			6,290,958,402	9,042,623,607	

## 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 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

「G I M世界投資適格債券ファンドF（適格機関投資家専用）」は「G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、全て同親投資信託の受益証券であります。

尚、同親投資信託の状況は以下の通りであります。

## 「G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」の状況

尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

区分	注記 番号	(平成30年 8月 7日現在)	(平成31年 2月 7日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		1,447,521,294	1,494,099,097
コール・ローン		27,643,842	61,698,051
国債証券		4,530,630,914	4,348,709,545
地方債証券		132,098,065	135,547,947
特殊債券		2,200,687,523	1,890,882,762
社債券		3,505,556,994	3,138,787,927
派生商品評価勘定		67,547,948	25,817,543
未収入金		1,435,182,231	471,762,220
未収利息		61,245,294	62,645,977
前払費用		10,853,242	9,682,700
流動資産合計		13,418,967,347	11,639,633,769
資産合計		13,418,967,347	11,639,633,769
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		58,294,219	19,662,960
未払金		2,864,948,216	1,821,480,352
未払解約金		99,999	310,533
未払利息		78	157
流動負債合計		2,923,342,512	1,841,454,002
負債合計		2,923,342,512	1,841,454,002

純資産の部			
元本等			
元本	1	7,302,574,420	6,816,400,731
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,193,050,415	2,981,779,036
元本等合計		10,495,624,835	9,798,179,767
純資産合計		10,495,624,835	9,798,179,767
負債純資産合計		13,418,967,347	11,639,633,769

(注) 「G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年3月11日から9月10日および9月11日から翌年3月10日まで（計算期間終了日が休業日の場合は、その翌営業日まで）であり、当ファンドの特定期間と異なります。

## (2) 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場）で評価しております。 当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条および第61条に従って処理しております。</p>

### (貸借対照表に関する注記)

区分	(平成30年8月7日現在)	(平成31年2月7日現在)
1期首元本額	8,007,081,756円	7,302,574,420円

期中追加設定元本額	62,059,415円	70,676,938円
期中解約元本額	766,566,751円	556,850,627円
元本の内訳(注)		
JPMグローバル債券3分散ファンド (毎月決算型)	557,309,760円	525,442,329円
GIM世界投資適格債券ファンドF (適格機関投資家専用)	6,689,831,241円	6,290,958,402円
GIM世界投資適格債券ファンドF1 (適格機関投資家専用)	55,433,419円	-円
合計	7,302,574,420円	6,816,400,731円
受益権の総数	7,302,574,420口	6,816,400,731口
1口当たりの純資産額	1.4372円	1.4374円
(1万口当たりの純資産額)	(14,372円)	(14,374円)

(注) 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、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。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。 なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的として利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果(パフォーマンス)のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っております。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

	各期間末
--	------



1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。一部の債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に対する上乘せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうるキャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算出した価格を利用しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(平成30年8月7日現在)	(平成31年2月7日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	22,277,138	55,163,352
地方債証券	265,574	2,010,619
特殊債券	1,172,550	2,501,199
社債券	16,347,241	18,248,602
合計	37,717,403	77,923,772

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

区分	種類	(平成30年8月7日現在)				(平成31年2月7日現在)			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
	為替予約取引 買建								
	アメリカドル	2,355,101,775	-	2,328,347,451	26,754,324	920,073,221	-	928,149,994	8,076,773
	カナダドル	511,211,338	-	510,088,619	1,122,719	345,747,306	-	348,452,961	2,705,655
	ユーロ	376,851,328	-	372,237,566	4,613,762	391,464,658	-	392,566,761	1,102,103
	英ポンド	255,193,196	-	248,495,335	6,697,861	260,736,295	-	259,826,256	910,039

市場取引以外の取引	スウェーデンクローネ	-	-	-	-	3,896,973	-	3,859,374	37,599
	ノルウェークローネ	525,789,477	-	514,930,779	10,858,698	640,727,823	-	645,648,106	4,920,283
	デンマーククローネ	29,543,295	-	28,939,547	603,748	-	-	-	-
	チェココルナ	12,724,200	-	12,599,159	125,041	12,241,080	-	12,146,495	94,585
	ハンガリーフォリント	-	-	-	-	9,186,763	-	9,277,880	91,117
	ポーランドズロチ	16,084,284	-	16,025,230	59,054	-	-	-	-
	オーストラリアドル	497,997,927	-	495,614,671	2,383,256	158,590,723	-	157,586,549	1,004,174
	ニュージーランドドル	9,314,305	-	9,185,738	128,567	126,875,230	-	127,287,052	411,822
	香港ドル	-	-	-	-	32,267,934	-	32,623,057	355,123
	シンガポールドル	26,157,622	-	25,772,927	384,695	25,406,958	-	25,687,345	280,387
	タイバーツ	37,243,895	-	36,794,592	449,303	37,456,678	-	38,557,208	1,100,530
	イスラエルシェケル	25,832,351	-	25,036,116	796,235	13,606,972	-	13,881,169	274,197
売建									
	アメリカドル	1,746,012,431	-	1,727,561,525	18,450,906	1,225,661,313	-	1,237,243,657	11,582,344
	カナダドル	316,082,880	-	317,628,852	1,545,972	79,696,800	-	80,226,573	529,773
	ユーロ	1,482,283,434	-	1,453,641,888	28,641,546	787,974,270	-	788,249,735	275,465
	英ポンド	427,266,535	-	418,915,134	8,351,401	406,103,823	-	405,620,711	483,112
	スウェーデンクローネ	42,898,617	-	41,988,033	910,584	46,006,186	-	45,102,321	903,865
	ノルウェークローネ	352,297,413	-	346,725,795	5,571,618	245,939,286	-	246,472,194	532,908
	デンマーククローネ	15,857,186	-	15,702,526	154,660	-	-	-	-
	オーストラリアドル	321,346,497	-	317,650,248	3,696,249	59,339,237	-	59,193,382	145,855
	ニュージーランドドル	-	-	-	-	127,557,699	-	127,287,051	270,648
合計		9,383,089,986	-	9,263,881,731	9,253,729	5,956,557,228	-	5,984,945,831	6,154,583

(注) 1. 為替予約の時価の算定方法

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

為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該為替予約は当該仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。
- ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値により評価しております。

(2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(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。

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表（平成31年2月7日現在）

## (イ) 株式

該当事項はありません。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	ABU DHABI 3.125% OCT27 REGS		200,000.00	194,922.00	
		BERMUDA 4.75% FEB29 REGS		210,000.00	218,565.90	
		HUNGARY USD 5.375% MAR24		100,000.00	108,820.00	
		INDNSA 5.375% OCT23 REGS		400,000.00	427,996.00	
		KUWAIT 2.75% MAR22 REGS		280,000.00	276,026.80	
		MEXICO USD 4.15% MAR27		210,000.00	207,053.70	
		POLAND USD 3% MAR23		650,000.00	647,757.50	
		SAUDI USD 4.375% APR29 REGS		200,000.00	204,882.00	
		US T-BOND 2.75% NOV47		690,000.00	651,187.50	
		US T-BOND 3.125% MAY48		1,135,000.00	1,153,266.40	
		US T-BOND 3% AUG48		105,000.00	104,114.06	
		US T-BOND 3% FEB47		813,100.00	808,780.40	
		US T-BOND 3% FEB48		685,000.00	679,327.32	
		US T-BOND 3% MAY47		667,500.00	663,119.53	
		US T-BOND 6.375% AUG27		200,000.00	256,250.00	
		US T-NOTE 1.125% FEB19		1,530,000.00	1,528,744.92	
		US T-NOTE 1.125% FEB21		580,000.00	563,642.19	
		US T-NOTE 1.375% OCT20		365,000.00	357,657.22	
		US T-NOTE 1.75% DEC20		1,045,000.00	1,029,937.30	
		US T-NOTE 2.375% MAR21		1,210,000.00	1,206,313.28	
		US T-NOTE 2.75% FEB28		781,500.00	785,773.82	
		US T-NOTE 2.875% AUG28		820,000.00	832,428.10	
		US T-NOTE 2.875% MAY28		1,125,000.00	1,142,226.56	
		US T-NOTE 2.875% NOV21		420,000.00	424,068.74	
		US T-NOTE 2.875% OCT23		3,090,000.00	3,139,246.87	
		US T-NOTE 3.125% NOV28		1,610,900.00	1,669,798.51	
	計	銘柄数：	26	19,123,000.00	19,281,906.62	
					(2,119,852,813)	
		組入時価比率：	21.6%		22.2%	
	カナダドル	CANADA GOVT 2% JUN28		310,000.00	311,977.80	
		CANADA GOVT 3.25% JUN21		1,550,000.00	1,600,111.50	
		CANADA GOVT 5% JUN37		460,000.00	658,329.00	
	計	銘柄数：	3	2,320,000.00	2,570,418.30	
					(213,833,098)	
		組入時価比率：	2.2%		2.2%	

	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		5,500,000.00	5,961,175.00	
	計	銘柄数 :	1	5,500,000.00	5,961,175.00	
					(34,276,756)	
		組入時価比率 :	0.3%		0.4%	
	ユーロ	AUSTRIA GOVT 1.5% FEB47		130,000.00	138,184.80	
		BELGIUM GOVT 5% MAR35 44		240,000.00	376,348.80	
		BELGIUM GOVT5.5%MAR28 31		30,000.00	43,303.50	
		CYPRUS 2.375% SEP28 EMTN		454,000.00	467,202.32	
		FINLAND 1.375% APR47 30Y		60,000.00	64,753.20	
		FRANCE OAT 0.75% MAY28		920,000.00	940,203.20	
		FRANCE OAT 2% MAY48		220,047.00	243,994.71	
		FRANCE OAT 3.25% MAY45		464,800.00	650,115.76	
		GERMANY BUND 1.25% AUG48		80,000.00	90,163.20	
		GERMANY BUND 4.75% JUL34		88,925.00	146,704.90	
		IRELAND GOVT 1.3% MAY33		37,457.00	37,701.96	
		IRELAND GOVT 1% MAY26		177,000.00	184,166.73	
		ITALY BTP 0.05% OCT19		1,000,000.00	999,580.00	
		ITALY BTP 2.05% AUG27		485,000.00	464,625.15	
		ITALY BTP 2.2% JUN27		640,000.00	622,502.40	
		ITALY BTP 2.7% MAR47		4,000.00	3,399.44	
		ITALY BTP 4.75% SEP44		145,000.00	169,526.75	
		ITALY BTP 5.5% NOV22		570,000.00	651,646.80	
		MEXICO EUR 2.375% APR21		446,000.00	467,015.52	
		NETHERLANDS 2.75% JAN47		161,600.00	239,129.21	
		POLAND EUR1.5%SEP25 EMTN		100,000.00	105,825.00	
		PORTUGAL OT 2.25% APR34		55,000.00	55,975.15	
		PORTUGAL OT 4.125% APR27		605,000.00	735,171.80	
		SLOVAKIA 2.25% JUN68 235		7,977.00	8,176.34	
		SLOVENIA 1.1875% MAR29		800,000.00	811,800.00	
		SLOVENIA 1% MAR28		90,000.00	90,833.40	
		SPAIN GOVT 0.4% APR22		400,000.00	405,600.00	
		SPAIN GOVT 1.5% APR27		660,000.00	683,073.60	
		SPAIN GOVT 2.7% OCT48		52,000.00	54,739.36	
		SPAIN GOVT 2.9% OCT46		475,000.00	524,989.00	
		SPAIN GOVT 4% APR20		540,000.00	568,242.00	
	計	銘柄数 :	31	10,138,806.00	11,044,694.00	
					(1,379,592,727)	
		組入時価比率 :	14.1%		14.5%	
	英ポンド	UK GOVT 2% SEP25		650,000.00	693,452.50	
		UK GOVT 4.25% DEC40		780,000.00	1,146,522.00	
		UK GOVT 4.25% DEC55		320,000.00	550,800.00	
	計	銘柄数 :	3	1,750,000.00	2,390,774.50	
					(339,968,133)	
		組入時価比率 :	3.5%		3.6%	

	デンマーククローネ	DENMARK GOVT 4.5% NOV39		700,000.00	1,235,591.00	
	計	銘柄数 :	1	700,000.00	1,235,591.00	
					(20,671,437)	
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%	
	ポーランドズロチ	POLAND GOVT 5.75% SEP22		650,000.00	737,607.00	
	計	銘柄数 :	1	650,000.00	737,607.00	
					(21,442,235)	
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%	
	ロシアルーブル	RUSSIA 8.15% FEB27 6207		4,100,000.00	4,146,822.00	
	計	銘柄数 :	1	4,100,000.00	4,146,822.00	
					(6,966,660)	
		組入時価比率 :	0.1%		0.1%	
	オーストラリアドル	AUSTRALIA 3% MAR47 150		133,000.00	139,732.46	
		AUSTRALIA4.25% APR26 142		840,000.00	966,033.60	
		AUSTRALIA5.75% MAY21 124		950,000.00	1,034,645.00	
	計	銘柄数 :	3	1,923,000.00	2,140,411.06	
					(167,144,699)	
		組入時価比率 :	1.7%		1.8%	
	ニュージーランドドル	NEW ZEALAND GOV2.75%0437		56,000.00	57,455.12	
	計	銘柄数 :	1	56,000.00	57,455.12	
					(4,276,959)	
		組入時価比率 :	0.0%		0.0%	
	タイバーツ	THAI GOVT 2.125% DEC26		11,760,000.00	11,590,891.20	
	計	銘柄数 :	1	11,760,000.00	11,590,891.20	
					(40,684,028)	
		組入時価比率 :	0.4%		0.4%	
	小計				4,348,709,545	
					(4,348,709,545)	
地方債証券	カナダドル	HYDRO QUEBEC 6.5% 19		100,000.00	144,262.00	
		ONTARIO 2.6%		1,090,000.00	1,097,259.40	
		PROV BRCOL 2.8%		60,000.00	57,939.00	
		QUEBEC 5%		250,000.00	329,917.50	
	計	銘柄数 :	4	1,500,000.00	1,629,377.90	
					(135,547,947)	
		組入時価比率 :	1.4%		1.4%	
	小計				135,547,947	
					(135,547,947)	
特殊債券	アメリカドル	FGLMC 3.5% FEB49 TBA		2,570,000.00	2,574,818.75	
		FGLMC 4.0% FEB49 TBA		840,000.00	858,112.50	
		FNCI 3.0% FEB34 TBA		880,000.00	879,450.00	
		FNCL 3.0% FEB49 TBA		610,000.00	596,656.25	
		FNCL 4.0% FEB49 TBA		1,050,000.00	1,071,984.37	
		FNCL 4.5% FEB49 TBA		900,000.00	933,750.00	

		FREDDIE MAC 3.75%		3,700,000.00	3,706,438.00	
		G2SF 3.0% FEB49 TBA		120,000.00	118,575.00	
		G2SF 3.5% FEB49 TBA		1,400,000.00	1,412,687.50	
		G2SF 4.5% FEB49 TBA		1,350,000.00	1,398,937.50	
		G2SF 5.0% FEB49 TBA		570,000.00	594,581.25	
		PEMEX 4.25%		110,000.00	100,395.90	
	計	銘柄数 :	12	14,100,000.00	14,246,387.02	
					(1,566,247,788)	
		組入時価比率 :	16.0%		16.5%	
	ユーロ	DEXIA CREDIT 1.25%		500,000.00	522,410.00	
		EFSF 0.75% EMTN		65,000.00	66,482.00	
		EIB 0.875% EMTN		500,000.00	522,395.00	
		ESM 1.125% EMTN		150,000.00	154,396.50	
		EUROPEAN UNION3.375%EMTN		50,000.00	65,395.00	
		KOREA HOUSING 0.75% REGS		100,000.00	101,015.00	
		UNEDIC 0.25% EMTN		1,000,000.00	1,007,470.00	
	計	銘柄数 :	7	2,365,000.00	2,439,563.50	
					(304,725,876)	
		組入時価比率 :	3.1%		3.2%	
	スウェーデンクローネ	EIB 1.25% EMTN		1,610,000.00	1,667,428.70	
	計	銘柄数 :	1	1,610,000.00	1,667,428.70	
					(19,909,098)	
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%	
	小計				1,890,882,762	
					(1,890,882,762)	
社債券	アメリカドル	AB INBEV 3.65% 144A		180,000.00	176,250.60	
		AB INBEV 4.15%		140,000.00	143,558.80	
		AB INBEV 4.7% 144A		80,000.00	77,646.40	
		AB INBEV 4.75%		110,000.00	114,182.20	
		AB INBEV 5.55%		55,000.00	57,974.95	
		ABBOTT LABS 3.75%		108,000.00	110,203.20	
		ACTAVIS 3.25%		90,000.00	88,884.00	
		AIG 3.9%		110,000.00	108,555.70	
		ALTRIA GROUP 2.85%		48,000.00	46,811.04	
		AMER AIRLINE 3.2% AA		161,910.00	154,175.55	
		AMERICAN TOWER 4%		20,000.00	20,188.00	
		ANTHEM 5.1%		60,000.00	63,502.80	
		ARGENTUM VAR		200,000.00	197,210.00	
		AT&T 4.5%		10,000.00	8,969.70	
		AT&T INC 4.3%		205,000.00	182,359.80	
		BALTIMORE GAS&ELEC 2.8%		100,000.00	98,063.00	
		BANK NOVA 3.125% BKNT		455,000.00	455,914.55	
		BANK OF MONTREAL 3.3% E		120,000.00	119,274.00	

	BARCLAYS BK 2.65%		655,000.00	647,225.15	
	BAT 3.557%		340,000.00	312,147.20	
	BBCMS 2017-C1 A4		250,000.00	251,935.00	
	BCARD 2018-1X A		334,000.00	332,997.66	
	BERKSHIRE 4.45% WI		65,000.00	65,948.35	
	BK OF AMERICA 3.248% MTN		140,000.00	133,446.60	
	BK OF AMERICA FLT		65,000.00	65,132.60	
	BK OF AMERICA FLT MTN		150,000.00	149,181.00	
	BK OF AMERICA FLT MTN Q		95,000.00	95,210.90	
	BNSF 4.15%		85,000.00	86,433.10	
	BP CAPITAL 3.79%		225,000.00	230,757.75	
	BPCE 4%		250,000.00	254,465.00	
	CAPITAL ONE 3.75%		215,000.00	207,075.10	
	CGCMT 2016-P6 A5		250,000.00	255,790.00	
	CITIGROUP 4.65%		30,000.00	31,217.40	
	CITIGROUP FLT		240,000.00	237,991.20	
	CITIGROUP FLT V		340,000.00	337,334.40	
	CLEVELAND 3.5% 144A		160,000.00	150,486.40	
	CMS ENERGY 2.95%		35,000.00	32,487.00	
	COMCAST 2.35%		25,000.00	22,845.25	
	COMCAST 3.9%		45,000.00	42,607.80	
	COMCAST 3.95%		50,000.00	51,513.50	
	COMCAST 4.7%		50,000.00	52,007.00	
	COMCAST CORP 4.45%		110,000.00	109,354.30	
	COMCAST CORP 4.6%		50,000.00	51,032.00	
	CONSTELLATION BR 4.5%		25,000.00	23,400.75	
	COX COMMS 3.35% 144A		170,000.00	160,500.40	
	CREDIT SUISSE FLT 144A		260,000.00	247,130.00	
	CSFB 2004-3 2A1		993.45	993.45	
	CSX 3.25%		45,000.00	43,450.20	
	CVS HEALTH 4.3%		159,000.00	160,553.43	
	CVS HEALTH 4.78%		90,000.00	89,943.30	
	DBS BANK 3.3% REGS		400,000.00	402,352.00	
	DOMINION RESOURCES 4.7%		130,000.00	131,227.20	
	ENTERGY 2.95%		45,000.00	41,989.50	
	ENTERGY MISSISSIPPI2.85%		70,000.00	65,230.20	
	EPPLP 4.9%		95,000.00	98,070.40	
	EXELON 3.4%		325,000.00	322,497.50	
	FIFTH THIRD BANCOPR3.65%		20,000.00	20,074.40	
	FORTIS 3.055%		155,000.00	144,613.45	
	GE 3.1% GMTN		168,000.00	162,948.24	
	GE 4.125%		25,000.00	20,877.25	
	GE CAPITAL 4.418%		210,000.00	187,250.70	
	GILEAD 4.5%		40,000.00	39,482.40	



		GM 3.95%		30,000.00	29,152.80	
		GM 5.15%		30,000.00	27,044.70	
		GOLDMAN SACHS 3.5%		270,000.00	260,390.70	
		GOLDMAN SACHS 3.85%		315,000.00	309,789.90	
		GOLDMAN SACHS FLT		45,000.00	43,966.35	
		GSMS 2017-GS5 A4		125,000.00	126,358.75	
		HALLIBURTON 5%		105,000.00	108,938.55	
		HSBC HLDGS VAR		270,000.00	265,104.90	
		INDIANA MICHIGAN PW4.25%		30,000.00	29,736.60	
		JOHN DEERE 2.8% MTN		310,000.00	306,847.30	
		KEURIG DR PEPPER 2.55%		51,000.00	45,487.92	
		KIMCO REALITY 3.125%		265,000.00	257,574.70	
		KIMCO REALITY 3.4%		45,000.00	44,476.65	
		KRAFT HEINZ FOOD 4.375%		65,000.00	56,318.60	
		KROGER 2.65%		165,000.00	148,882.80	
		M STANLEY FLT		330,000.00	332,653.20	
		MAPLE ESCROW 4.417% 144A		109,000.00	110,813.76	
		MARTIN MARIETTA 4.25%		70,000.00	58,135.70	
		MEDTRONIC 4.375%		110,000.00	115,430.70	
		METLIFE INC 2.3% 144A		510,000.00	509,750.10	
		MPLX 4.5%		35,000.00	32,515.35	
		MSAC 2004-SD2 A		192,161.32	191,742.40	
		NATL RURAL UTIL 4.3%		10,000.00	10,272.70	
		NISOURCE 5.65%		20,000.00	22,199.60	
		NORFOLK SOUTHERN 3.942%		75,000.00	70,545.75	
		ORACLE CORP 4.5%		130,000.00	135,996.90	
		PENAR 2018-2X A1		333,000.00	331,838.82	
		PHILIP MORRIS 2.5%		250,000.00	244,047.50	
		PHILLIPS 66 4.875%		10,000.00	10,433.10	
		RBS FLT		250,000.00	243,662.50	
		REALTY INCOME 3.65%		95,000.00	92,701.00	
		REYNOLDS AMERICAN 5.7%		70,000.00	69,916.70	
		ROCKWELL COLLINS 3.5%		215,000.00	207,337.40	
		S CALIF EDISON 3.6% C		50,000.00	41,193.50	
		S CALIF EDISON 3.65% B		65,000.00	61,619.35	
		SEMPRA ENERGY 3.8%		50,000.00	43,966.50	
		SHERWIN-WILLIAMS 4.5%		25,000.00	23,513.50	
		SHIRE ACQ 2.875%		212,000.00	204,109.36	
		SIERRA PACIFIC 2.6%		75,000.00	70,242.00	
		SUNOCO LOGISTICS 5.3%		155,000.00	144,312.75	
		SWEPCO 3.9% J		15,000.00	13,549.05	
		TRANSCANADA 4.25% 10YR		165,000.00	168,710.85	
		UBS FLT 144A		200,000.00	194,244.00	
		UNITED AIR 3.1% AA		165,752.72	157,508.17	

		UNITED TECH 3.95%		35,000.00	35,807.10	
		UNITED TECH 4.125%		80,000.00	81,921.60	
		UNITED TECH 4.45%		40,000.00	40,318.40	
		VENTAS 4.375%		24,000.00	21,845.76	
		VERIZON 2.625%		80,000.00	74,590.40	
		VERIZON 3.85%		72,000.00	64,822.32	
		VERIZON 4.272%		65,000.00	63,304.80	
		VODAFONE 4.125%		35,000.00	35,046.55	
		VODAFONE 4.375%		70,000.00	69,584.90	
		WELLS FARGO 3.75% MTN		40,000.00	40,537.20	
		WELLS FARGO 4.15% MTN		45,000.00	45,956.70	
		WELLS FARGO 5.375%		125,000.00	136,755.00	
		WELLS FARGO FLT BKNT		490,000.00	490,779.10	
		WESTPAC VAR EMTN		90,000.00	87,345.90	
		WFCM 2017-RC1 A4		250,000.00	251,820.00	
		WFMB 2005-2 2A1		21,067.35	21,067.35	
	計	銘柄数：	122	16,614,884.84	16,327,467.23	
					(1,795,041,747)	
		組入時価比率：	18.3%		18.9%	
	ユーロ	ABN AMRO 6.375% EMTN		200,000.00	225,258.00	
		ABN AMRO BANK VAR EMTN		200,000.00	205,358.00	
		AMERICAN TOWER 1.375%		140,000.00	138,390.00	
		ANZ BANK 0.45% EMTN		500,000.00	501,600.00	
		APPLE 1.375%		100,000.00	103,747.00	
		ASB FIN 0.75% EMTN		240,000.00	241,190.40	
		BANK NOVA 0.375% EMTN		150,000.00	151,009.50	
		BK OF AMERICA FLT EMTN		249,000.00	253,581.60	
		BP CAPITAL 0.9% EMTN		100,000.00	101,301.00	
		BP CAPITAL 2.972% EMTN		100,000.00	113,238.00	
		BPM 2 A2		175,947.52	173,980.42	
		CBA 0.375% EMTN		891,000.00	894,492.72	
		CBA 0.5% EMTN		550,000.00	541,244.00	
		CIBC 0.25% EMTN		372,000.00	373,309.44	
		EDP FIN 1.5% EMTN		161,000.00	156,677.15	
		ENEL 1.125% EMTN		136,000.00	131,501.12	
		GE 1.875%		100,000.00	98,498.00	
		GOLDMAN SACHS 2.625% EMTN		147,000.00	152,524.26	
		HAMMERSON 2% EMTN		258,000.00	262,473.72	
		HEATHROW 1.5% EMTN		154,000.00	153,875.26	
		IMERYSA 1.875% EMTN		100,000.00	98,388.00	
		ING GRP VAR EMTN		300,000.00	314,310.00	
		INTESA SANPAOLO 0.5%		800,000.00	799,656.00	
		LIB MUTUAL 1.75% REGS		114,000.00	115,902.66	
		M STANLEY 1.875% GMTN		300,000.00	307,752.00	

		MOTABILITY 0.875% EMTN		122,000.00	122,298.90	
		NATIONWIDE 0.625% EMTN		300,000.00	296,481.00	
		NATIONWIDE 0.75% EMTN		282,000.00	287,535.66	
		NORTEGAS 2.065% EMTN		100,000.00	97,820.00	
		RCI BANQUE 0.625% EMTN		138,000.00	138,652.74	
		SCENTRE GROUP 1.5% EMTN		272,000.00	276,452.64	
		SEB VAR 26 S.289		355,000.00	367,070.00	
		SIEMENS 1.375% EMTN		70,000.00	71,236.20	
		SKY 2.25% GMTN		100,000.00	106,634.00	
		TORONTO-DOMI 0.625% EMTN		100,000.00	101,208.00	
		TOTAL 1.375% EMTN		100,000.00	103,128.00	
		VINCI 1.75% EMTN		100,000.00	101,994.00	
		VOLKSWAGEN 2.625%		60,000.00	62,841.00	
	計	銘柄数：	38	8,636,947.52	8,742,610.39	
					(1,092,039,463)	
		組入時価比率：	11.1%		11.5%	
	英ポンド	BSKY UK2 A		280,000.00	279,267.80	
		CENTRICA 4.375% EMTN		100,000.00	112,462.00	
		EVERSHOLT 6.359% EMTN		100,000.00	121,528.00	
		HEATHROW 6.75% EMTN		150,000.00	195,882.00	
		LLOYDS BK 9.625%		200,000.00	254,196.00	
		LONDON & QUADRANT 3.125%		140,000.00	135,744.00	
		NAB 1.125% EMTN		500,000.00	496,380.00	
	計	銘柄数：	7	1,470,000.00	1,595,459.80	
					(226,874,383)	
		組入時価比率：	2.3%		2.4%	
	スウェーデンクローネ	STADSHYPOTEK 1.5% 1587		2,000,000.00	2,079,760.00	
	計	銘柄数：	1	2,000,000.00	2,079,760.00	
					(24,832,334)	
		組入時価比率：	0.3%		0.3%	
	小計				3,138,787,927	
					(3,138,787,927)	
	合計				9,513,928,181	
					(9,513,928,181)	

(注) 各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 小計・合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各通貨計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

## G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）

## （ 1 ）貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	前期 (平成30年 8 月 7 日現在)	当期 (平成31年 2 月 7 日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		3,997,217,527	3,757,463,998
流動資産合計		3,997,217,527	3,757,463,998
資産合計		3,997,217,527	3,757,463,998
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		43,367,027	45,326,596
未払受託者報酬		138,928	137,191
未払委託者報酬		2,434,714	2,404,233
その他未払費用		69,453	68,583
流動負債合計		46,010,122	47,936,603
負債合計		46,010,122	47,936,603
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,673,405,591	8,241,199,293
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	4,722,198,186	4,531,671,898
（分配準備積立金）		4,019,821	5,292,362
元本等合計		3,951,207,405	3,709,527,395
純資産合計		3,951,207,405	3,709,527,395
負債純資産合計		3,997,217,527	3,757,463,998

## （ 2 ）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

区分	注記 番号	前期 (自 平成30年 2 月 8 日 至 平成30年 8 月 7 日)	当期 (自 平成30年 8 月 8 日 至 平成31年 2 月 7 日)
		金額	金額
営業収益			
有価証券売買等損益		326,427,628	83,988,260
営業収益合計		326,427,628	83,988,260
営業費用			
受託者報酬		905,632	828,007

委託者報酬	1	15,871,114	14,510,800
その他費用		452,754	413,942
営業費用合計		17,229,500	15,752,749
営業利益又は営業損失( )		343,657,128	68,235,511
経常利益又は経常損失( )		343,657,128	68,235,511
当期純利益又は当期純損失( )		343,657,128	68,235,511
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( )		4,348,797	3,010,296
期首剰余金又は期首欠損金( )		4,214,267,970	4,722,198,186
剰余金増加額又は欠損金減少額		402,431,973	394,481,313
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		402,431,973	394,481,313
剰余金減少額又は欠損金増加額		442,985,923	154,264,716
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		442,985,923	154,264,716
分配金	2	128,067,935	114,915,524
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,722,198,186	4,531,671,898

## (3) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
有価証券の評価基準および評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (平成30年8月7日現在)	当期 (平成31年2月7日現在)
1 期首元本額	8,574,200,434円	8,673,405,591円
期中追加設定元本額	852,985,923円	271,264,716円
期中一部解約元本額	753,780,766円	703,471,014円
2 元本の欠損	4,722,198,186円	4,531,671,898円
受益権の総数	8,673,405,591口	8,241,199,293口
1 口当たりの純資産額	0.4556円	0.4501円
(1万口当たりの純資産額)	(4,556円)	(4,501円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期 (自 平成30年 2月 8日 至 平成30年 8月 7日)	当期 (自 平成30年 8月 8日 至 平成31年 2月 7日)
1 信託財産の運用の指図に関す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委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に年率0.35%を乗じて得た額	同左
2 分配金の計算過程	(自 平成30年 2月 8日 至 平成30年 3月 7日)	(自 平成30年 8月 8日 至 平成30年 9月 7日)
費用控除後の配当等収益額	21,539,483円	17,106,846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	- 円	- 円
収益調整金額	5,339,344円	7,493,895円
分配準備積立金額	3,297,783円	4,019,821円
当ファンドの分配対象収益額	30,176,610円	28,620,562円
当ファンドの期末残存口数	8,479,993,179口	8,899,039,460口
1万口当たり収益分配対象額	35.58円	32.16円
1万口当たり分配金額	25.00円	25.00円
収益分配金金額	21,199,982円	22,247,598円
	(自 平成30年 3月 8日 至 平成30年 4月 9日)	(自 平成30年 9月 8日 至 平成30年 10月 9日)
費用控除後の配当等収益額	19,168,220円	16,529,548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	- 円	- 円
収益調整金額	6,803,999円	6,438,229円
分配準備積立金額	3,637,284円	9,247円
当ファンドの分配対象収益額	29,609,503円	22,977,024円
当ファンドの期末残存口数	9,097,785,601口	8,944,670,307口
1万口当たり収益分配対象額	32.54円	25.68円
1万口当たり分配金額	20.00円	10.00円
収益分配金金額	18,195,571円	8,944,670円
	(自 平成30年 4月 10日 至 平成30年 5月 7日)	(自 平成30年 10月 10日 至 平成30年 11月 7日)
費用控除後の配当等収益額	14,654,959円	13,163,994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	- 円	- 円
収益調整金額	6,742,901円	6,148,843円
分配準備積立金額	4,568,538円	7,252,784円
当ファンドの分配対象収益額	25,966,398円	26,565,621円
当ファンドの期末残存口数	9,016,086,255口	8,542,603,821口
1万口当たり収益分配対象額	28.80円	31.09円
1万口当たり分配金額	15.00円	20.00円
収益分配金金額	13,524,129円	17,085,207円

区分	前期 (自 平成30年 2月 8日 至 平成30年 8月 7日)	当期 (自 平成30年 8月 8日 至 平成31年 2月 7日)
----	--	--

	(自 平成30年 5月 8日 至 平成30年 6月 7日)	(自 平成30年11月 8日 至 平成30年12月 7日)
費用控除後の配当等収益額	15,287,013円	12,000,954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	- 円	- 円
収益調整金額	7,362,111円	6,135,870円
分配準備積立金額	5,699,368円	3,324,542円
当ファンドの分配対象収益額	28,348,492円	21,461,366円
当ファンドの期末残存口数	9,251,279,756口	8,524,581,745口
1万口当たり収益分配対象額	30.64円	25.17円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	18,502,559円	17,049,163円
	(自 平成30年 6月 8日 至 平成30年 7月 9日)	(自 平成30年12月 8日 至 平成31年 1月 7日)
費用控除後の配当等収益額	44,698,777円	41,082,415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	- 円	- 円
収益調整金額	7,044,719円	4,396,855円
分配準備積立金額	2,376,741円	15,348円
当ファンドの分配対象収益額	54,120,237円	45,494,618円
当ファンドの期末残存口数	8,852,444,892口	8,524,581,745口
1万口当たり収益分配対象額	61.13円	53.36円
1万口当たり分配金額	15.00円	5.00円
収益分配金金額	13,278,667円	4,262,290円
	(自 平成30年 7月10日 至 平成30年 8月 7日)	(自 平成31年 1月 8日 至 平成31年 2月 7日)
費用控除後の配当等収益額	14,273,539円	15,007,970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	- 円	- 円
収益調整金額	6,902,239円	4,250,695円
分配準備積立金額	33,113,309円	35,610,988円
当ファンドの分配対象収益額	54,289,087円	54,869,653円
当ファンドの期末残存口数	8,673,405,591口	8,241,199,293口
1万口当たり収益分配対象額	62.59円	66.57円
1万口当たり分配金額	50.00円	55.00円
収益分配金金額	43,367,027円	45,326,596円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、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。



2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される親投資信託受益証券であります。</p> <p>G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）</p> <p>親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドで投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターおよびリスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。更に、投資制限の管理を行います。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

	各特定期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2)有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品は、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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (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8月7日現在)	当期 (平成31年2月7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)
親投資信託受益証券	62,456,523	151,130,655
合計	62,456,523	151,130,655

## (デリバティブ取引等に関する注記)

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。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表（平成31年2月7日現在）

## (イ) 株式

該当事項はありません。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	G I M新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド（適格機関投資家専用）	2,506,312,699	3,757,463,998	
合計			2,506,312,699	3,757,463,998	

## 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 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

G I M新興国現地通貨ソブリン・ファンドF（適格機関投資家専用）は「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、全て同親投資信託の受益証券であります。

尚、同親投資信託の状況は以下の通りであります。

「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）」の状況

尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	(平成30年8月7日現在)	(平成31年2月7日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		489,598,895	191,256,270
コール・ローン		2,017,454	26,700,301
国債証券		10,201,870,609	10,094,940,248
派生商品評価勘定		253,814,180	58,262,659
未収入金		10,711,136	-
未収利息		111,414,755	133,086,920
前払費用		21,224,469	35,047,801
差入委託証拠金		6,608,583	10,826,053
流動資産合計		11,097,260,081	10,550,120,252
資産合計		11,097,260,081	10,550,120,252
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		192,158,042	77,501,306

未払金		-	77,277,344
未払解約金		22,620,840	11,361,830
未払利息		5	68
流動負債合計		214,778,887	166,140,548
負債合計		214,778,887	166,140,548
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,425,462,020	6,926,522,367
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		3,457,019,174	3,457,457,337
元本等合計		10,882,481,194	10,383,979,704
純資産合計		10,882,481,194	10,383,979,704
負債純資産合計		11,097,260,081	10,550,120,252

(注)「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)」の計算期間は、毎年3月11日から9月10日および9月11日から翌年3月10日まで(計算期間終了日が休業日の場合は、その翌営業日まで)であり、当ファンドの特定期間と異なります。

## (2) 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場(外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場)で評価しております。 当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	<p>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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)第60条および第61条に従って処理しております。
----------------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

区分	(平成30年8月7日現在)	(平成31年2月7日現在)
1期首元本額	7,500,867,486円	7,425,462,020円
期中追加設定元本額	1,107,269,212円	566,516,109円
期中解約元本額	1,182,674,678円	1,065,455,762円
元本の内訳(注)		
JPMグローバル債券3分散ファンド(毎月決算型)	552,451,993円	522,808,732円
GIM新興国現地通貨ソブリン・ファンドF(適格機関投資家専用)	2,727,359,121円	2,506,312,699円
JPM新興国毎月決算ファンド	4,132,846,360円	3,878,681,479円
JPM新興国年1回決算ファンド	12,804,546円	18,719,457円
合計	7,425,462,020円	6,926,522,367円
受益権の総数	7,425,462,020口	6,926,522,367口
1口当たりの純資産額	1.4656円	1.4992円
(1万口当たりの純資産額)	(14,656円)	(14,992円)

(注) 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、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。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、債券関連では債券先物取引、通貨関連では為替予約取引、金利関連では金利先物取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。</p> <p>なお、デリバティブ取引は、債券関連では将来の債券の価格変動リスクを回避し、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的、金利関連では金利変動リスクを回避し、効率的な運用に資することを目的として利用しております。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。</p> <p>(3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。</p>
-------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

	各期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。一部の債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に対する上乘せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうるキャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算出した価格を利用しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(平成30年 8月 7日現在)	(平成31年 2月 7日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	309,703,199	332,208,594
合計	309,703,199	332,208,594

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## （通貨関連）

区分	種類	（平成30年 8月 7日現在）				（平成31年 2月 7日現在）				
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）	
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 買建									
	アメリカドル	3,856,828,994	-	3,881,228,443	24,399,449	2,916,176,683	-	2,905,942,840	10,233,843	
	メキシコペソ	595,570,050	-	652,946,493	57,376,443	255,500,272	-	260,246,616	4,746,344	
	トルコリラ	643,474,491	-	586,878,140	56,596,351	545,481,818	-	557,735,261	12,253,443	
	チェココルナ	760,551,669	-	766,899,217	6,347,548	576,999,737	-	573,379,462	3,620,275	
	ハンガリーフォリ ント	448,414,110	-	455,916,191	7,502,081	582,501,488	-	585,810,507	3,309,019	
	ポーランドズロチ	578,502,079	-	591,229,277	12,727,198	594,125,322	-	592,469,463	1,655,859	
	タイバーツ	598,883,147	-	589,509,577	9,373,570	94,011,687	-	95,186,130	1,174,443	
	南アフリカランド	403,787,571	-	405,192,528	1,404,957	526,535,770	-	529,570,282	3,034,512	
	売建									
	アメリカドル	4,094,183,117	-	4,133,424,497	39,241,380	3,210,156,094	-	3,227,942,580	17,786,486	
	メキシコペソ	594,399,553	-	626,122,893	31,723,340	238,100,668	-	237,300,215	800,453	
	トルコリラ	671,874,690	-	583,271,430	88,603,260	337,014,388	-	341,133,998	4,119,610	
	チェココルナ	313,418,075	-	318,536,454	5,118,379	474,904,237	-	471,519,023	3,385,214	
	ハンガリーフォリ ント	853,892,923	-	868,832,348	14,939,425	579,016,485	-	574,883,448	4,133,037	
	ポーランドズロチ	303,959,061	-	306,995,174	3,036,113	302,514,035	-	300,541,983	1,972,052	
	タイバーツ	371,574,501	-	367,349,078	4,225,423	143,604,155	-	143,400,670	203,485	
	南アフリカランド	747,710,191	-	728,611,854	19,098,337	841,022,715	-	855,180,253	14,157,538	
	合計		15,837,024,222	-	15,862,943,594	61,656,138	12,217,665,554	-	12,252,242,731	16,561,609

## （注）1．為替予約の時価の算定方法

- （1）対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。  
 ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値により評価しております。
- （2）対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。
- 2．換算において円未満の端数は切り捨てております。  
 3．契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （金利関連）

区分	種類	（平成30年 8月 7日現在）				（平成31年 2月 7日現在）			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）

市場取引	金利先物取引								
	売建	-	-	-	-	1,949,755,667	-	1,952,432,705	2,677,038
合計		-	-	-	-	1,949,755,667	-	1,952,432,705	2,677,038

## (注) 1. 先物取引の時価の算定方法

金利先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 金利先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (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。

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表(平成31年2月7日現在)

## (イ) 株式

該当事項はありません。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	US T-NOTE 2.5% DEC20		1,900,000.00	1,898,515.62	
	計	銘柄数:	1	1,900,000.00	1,898,515.62	
					(208,722,807)	
		組入時価比率:	2.0%		2.1%	
	アルゼンチンペソ	ARGENTINE GOVT15.5%OCT26		4,300,000.00	3,765,037.00	
		ARGENTINE GOVT18.2%OCT21		14,643,586.00	13,005,847.34	
	計	銘柄数:	2	18,943,586.00	16,770,884.34	
					(49,138,691)	
		組入時価比率:	0.5%		0.5%	
	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		26,836,600.00	29,086,848.91	
		MEXICO GOVT 10% NOV36		16,607,300.00	18,605,490.33	
		MEXICO GOVT 5.75% MAR26		15,000,000.00	12,981,150.00	
		MEXICO GOVT 6.5% JUN21		3,200,000.00	3,085,760.00	
		MEXICO GOVT 6.5% JUN22		63,980,000.00	60,898,083.40	
		MEXICO GOVT 7.25% DEC21		9,000,000.00	8,792,640.00	
		MEXICO GOVT 7.5% JUN27		13,600,000.00	12,905,312.00	
		MEXICO GOVT 7.75% MAY31		31,800,000.00	29,888,502.00	
		MEXICO GOVT 8.5% MAY29		15,710,000.00	15,769,069.60	
		MEXICO GOVT 8.5% NOV38		13,600,000.00	13,345,136.00	
		MEXICO GOVT 8% DEC23		7,000,000.00	6,953,030.00	
		MEXICO I/L 4% NOV40		530,000.00	3,214,785.70	
	計	銘柄数:	12	216,863,900.00	215,525,807.94	
					(1,239,273,395)	
		組入時価比率:	11.9%		12.2%	
	ブラジルリアル	BRAZIL 10% JAN21 NTF		23,610,000.00	25,020,980.82	



		BRAZIL 10% JAN23 NTN		17,458,000.00	18,664,539.83	
		BRAZIL 10% JAN25 NTN		6,940,000.00	7,436,508.42	
		BRAZIL 10% JAN27 NTN		4,690,000.00	5,031,469.52	
		BRAZIL I/L 6% AUG22 NTN		3,166,000.00	11,057,697.91	
		BRAZIL I/L 6% AUG26 NTN		420,000.00	1,521,405.48	
		BRAZIL I/L 6% AUG50 NTN		550,000.00	2,205,994.94	
	計	銘柄数：	7	56,834,000.00	70,938,596.92	
					(2,106,166,942)	
		組入時価比率：	20.3%		20.8%	
	チリペソ	CHILE GOVT 4.5% MAR26		1,190,000,000.00	1,237,623,800.00	
	計	銘柄数：	1	1,190,000,000.00	1,237,623,800.00	
					(207,797,036)	
		組入時価比率：	2.0%		2.1%	
	コロンビアペソ	COLOMBIA 6% APR28 GDN		150,000,000.00	143,833,500.00	
		COLOMBIA GOVT 9.85%JUN27		1,292,000,000.00	1,587,118,640.00	
		COLOMBIA GOVT4.375%MAR23		475,000,000.00	450,946,000.00	
		COLOMBIA TES 10% JUL24		2,191,300,000.00	2,588,889,472.00	
		COLOMBIA TES 6% APR28		11,222,500,000.00	10,754,297,300.00	
		COLOMBIA TES 7% MAY22		1,340,000,000.00	1,397,740,600.00	
	計	銘柄数：	6	16,670,800,000.00	16,922,825,512.00	
					(599,068,023)	
		組入時価比率：	5.8%		5.9%	
	ペルーソル	PERU GOVT 5.94% FEB29		520,000.00	537,851.60	
		PERU GOVT 5.94%FEB29 GDN		180,000.00	185,902.20	
		PERU GOVT 6.15% AUG32		1,564,000.00	1,608,214.28	
		PERU GOVT 6.35% AUG28		2,210,000.00	2,356,500.90	
		PERU GOVT 6.9% AUG37 GDN		800,000.00	870,848.00	
		PERU GOVT6.95% AUG31 GDN		3,025,000.00	3,337,331.25	
	計	銘柄数：	6	8,299,000.00	8,896,648.23	
					(294,123,190)	
		組入時価比率：	2.8%		2.9%	
	ウルグアイペソ	URUGUAY9.875% JUN22 REGS		4,880,000.00	4,884,001.60	
	計	銘柄数：	1	4,880,000.00	4,884,001.60	
					(16,507,925)	
		組入時価比率：	0.2%		0.2%	
	ドミニカペソ	DOMINICA 8.9% FEB23 REGS		17,000,000.00	16,575,000.00	
	計	銘柄数：	1	17,000,000.00	16,575,000.00	
					(36,133,500)	
		組入時価比率：	0.3%		0.4%	
	ディナール	SERBIA 5.875% FEB28 10Y		43,410,000.00	46,113,140.70	
	計	銘柄数：	1	43,410,000.00	46,113,140.70	
					(48,626,306)	
		組入時価比率：	0.5%		0.5%	
	トルコリラ	TURKEY GOVT 10.6% FEB26		5,850,000.00	4,885,101.00	

		TURKEY GOVT 11% MAR22		2,186,046.00	1,917,096.76
		TURKEY GOVT 12.4% MAR28		994,183.00	907,589.66
		TURKEY GOVT 23% AUG20		2,211,461.00	2,348,040.83
		TURKEY GOVT 7.1% MAR23		219,389.00	165,263.53
		TURKEY GOVT 8.5% SEP22		121,507.00	97,638.16
		TURKEY GOVT 8.8% SEP23		1,530,000.00	1,204,844.40
		TURKEY GOVT 9.2% SEP21		2,052,812.00	1,728,549.81
	計	銘柄数：	8	15,165,398.00	13,254,124.15
					(279,264,395)
		組入時価比率：	2.7%		2.8%
	チェココルナ	CZECH REPUBLIC 2.75% 105		5,410,000.00	5,846,857.50
	計	銘柄数：	1	5,410,000.00	5,846,857.50
					(28,298,790)
		組入時価比率：	0.3%		0.3%
	ハンガリーフォリント	HUNGARY 1% SEP20 20/C		270,930,000.00	273,295,218.90
		HUNGARY 2.5% OCT24 24/C		54,980,000.00	55,882,221.80
		HUNGARY 3% JUN24 24/B		101,110,000.00	106,217,066.10
		HUNGARY 5.5% JUN25 25/B		218,710,000.00	260,468,300.30
		HUNGARY 7% JUN22 22/A		153,150,000.00	181,462,840.50
	計	銘柄数：	5	798,880,000.00	877,325,647.60
					(343,648,456)
		組入時価比率：	3.3%		3.4%
	ポーランドズロチ	POLAND 2.25% APR22 0422		710,000.00	720,096.20
		POLAND 2.5% JUL26 0726		6,317,000.00	6,294,006.12
		POLAND 2.75% APR28 0428		9,449,000.00	9,450,984.29
		POLAND GOVT 4% OCT23		4,840,000.00	5,252,174.40
	計	銘柄数：	4	21,316,000.00	21,717,261.01
					(631,320,777)
		組入時価比率：	6.1%		6.3%
	ロシアルーブル	RUSSIA 7.05% JAN28 6212		40,300,000.00	37,950,913.00
		RUSSIA 7.1% OCT24 6222		39,300,000.00	37,907,208.00
		RUSSIA 7.6% APR21 6205		105,000,000.00	104,787,900.00
		RUSSIA 7.75% SEP26 6219		43,358,000.00	42,853,746.46
		RUSSIA 7% JAN23 6211		30,000,000.00	29,177,400.00
		RUSSIA 8.15% FEB27 6207		116,550,000.00	117,881,001.00
	計	銘柄数：	6	374,508,000.00	370,558,168.46
					(622,537,723)
		組入時価比率：	6.0%		6.2%
	ルーマニアレイ	ROMANIA GOVT 3.25% APR24		585,000.00	550,408.95
		ROMANIA GOVT 4.75% FEB25		2,110,000.00	2,134,328.30
		ROMANIA GOVT 5% FEB29		1,670,000.00	1,686,816.90
	計	銘柄数：	3	4,365,000.00	4,371,554.15
					(115,234,167)
		組入時価比率：	1.1%		1.1%

	マレーシアリングット	MALAYSIA 3.48% MAR23		402,000.00	397,459.32
		MALAYSIA 3.8% AUG23		2,500,000.00	2,498,672.20
		MALAYSIA 3.844% APR33		100,000.00	93,875.90
		MALAYSIA 3.882% MAR22		1,963,000.00	1,976,139.14
		MALAYSIA 4.048% SEP21		62,000.00	62,704.87
		MALAYSIA 4.059% SEP24		4,100,000.00	4,136,744.61
		MALAYSIA 4.07% SEP26		869,000.00	869,505.32
		MALAYSIA 4.16% JUL21		633,000.00	641,735.90
		MALAYSIA 4.232% JUN31		2,872,000.00	2,857,212.27
		MALAYSIA 4.642% NOV33		3,900,000.00	4,005,628.38
		MALAYSIA 4.786% OCT35		400,000.00	406,246.48
	計	銘柄数：	11	17,801,000.00	17,945,924.39
					(480,950,773)
		組入時価比率：	4.6%		4.8%
	タイパーツ	THAI GOVT 2.125% DEC26		4,200,000.00	4,139,604.00
		THAI GOVT 2.4% DEC23 0		14,800,000.00	15,004,536.00
		THAI GOVT 2.875% DEC28		36,092,000.00	37,636,376.68
		THAI GOVT 2% DEC22		29,000,000.00	29,010,730.00
		THAI GOVT 3.4% JUN36		2,200,000.00	2,328,590.00
		THAI GOVT 3.58% DEC27		834,000.00	910,361.04
		THAI GOVT 3.625% JUN23		3,176,000.00	3,384,282.08
		THAI GOVT 3.65% JUN31		8,200,000.00	9,044,272.00
		THAI GOVT 3.775% JUN32		37,900,000.00	42,147,832.00
		THAI GOVT 4.875% JUN29		579,000.00	699,211.98
	計	銘柄数：	10	136,981,000.00	144,305,795.78
					(506,513,343)
		組入時価比率：	4.9%		5.0%
	フィリピンペソ	PHIL GOVT 8% JUL31 2017		5,600,000.00	6,475,840.00
		PHIL GOVT5.75%APR25 7-61		2,963,554.00	2,937,112.16
	計	銘柄数：	2	8,563,554.00	9,412,952.16
					(19,767,199)
		組入時価比率：	0.2%		0.2%
	インドネシアルピア	INDON 10.5% AUG30 FR52		6,191,000,000.00	7,300,497,158.00
		INDON 6.625% MAY33 FR65		4,960,000,000.00	4,330,526,400.00
		INDON 7.5% MAY38 FR75		2,937,000,000.00	2,759,634,570.00
		INDON 7% MAY27 FR59		21,302,000,000.00	20,203,242,840.00
		INDON 8.25% MAY36 FR72		26,865,000,000.00	27,189,797,850.00
		INDON 8.375% MAR34 FR68		3,838,000,000.00	3,965,344,840.00
		INDON 8.75% MAY31 FR73		11,305,000,000.00	11,903,825,850.00
		INDON 9% MAR29 FR71		46,542,000,000.00	49,807,386,720.00
	計	銘柄数：	8	123,940,000,000.00	127,460,256,228.00
					(1,006,936,024)
		組入時価比率：	9.7%		9.9%

	エジプトポンド	EGYPT T-BILLO%APR19 273D		4,400,000.00	4,234,652.48	
		EGYPT T-BILLO%APR19 364D		3,450,000.00	3,312,180.30	
	計	銘柄数 :	2	7,850,000.00	7,546,832.78	
					(47,092,236)	
		組入時価比率 :	0.5%		0.5%	
	南アフリカランド	S.AFRICA 7% FEB31 R213		23,210,000.00	19,462,281.30	
		S.AFRICA 8.5% JAN37 2037		8,445,658.00	7,653,117.45	
		S.AFRICA 8% JAN30 2030		7,838,441.00	7,226,807.44	
		S.AFRICA 9% JAN40 2040		5,595,390.00	5,256,253.41	
		S.AFRICA10.5% DEC26 R186		39,456,829.00	43,557,182.66	
		S.AFRICA6.25% MAR36 R209		8,441,256.00	6,150,636.77	
		S.AFRICA8.25% MAR32 2032		16,400,872.00	15,046,323.98	
		S.AFRICA8.75% FEB48 2048		36,635,031.00	33,369,750.68	
		S.AFRICA8.75% JAN44 2044		3,805,030.00	3,467,561.88	
		S.AFRICA8.875%FEB35 2035		7,786,398.00	7,373,251.72	
	計	銘柄数 :	10	157,614,905.00	148,563,167.29	
					(1,207,818,550)	
		組入時価比率 :	11.6%		11.9%	
	小計				10,094,940,248	
					(10,094,940,248)	
	合計				10,094,940,248	
					(10,094,940,248)	

(注) 各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 小計・合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各通貨計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友グローバル債券オープン

2019年 3月29日現在

資産総額	13,255,606,901円
負債総額	11,290,266円
純資産総額（ - ）	13,244,316,635円
発行済口数	19,467,961,426口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6803円
（1万口当たり純資産額）	（6,803円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## ハ 受益者に対する特典

ありません。

## ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

## (イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記 a の申請のある場合には、上記 a の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記 a の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記 a の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

## ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 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】

（2019年4月1日現在）

#### イ 資本金の額および株式数

資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

#### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

#### ハ 会社の機構

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

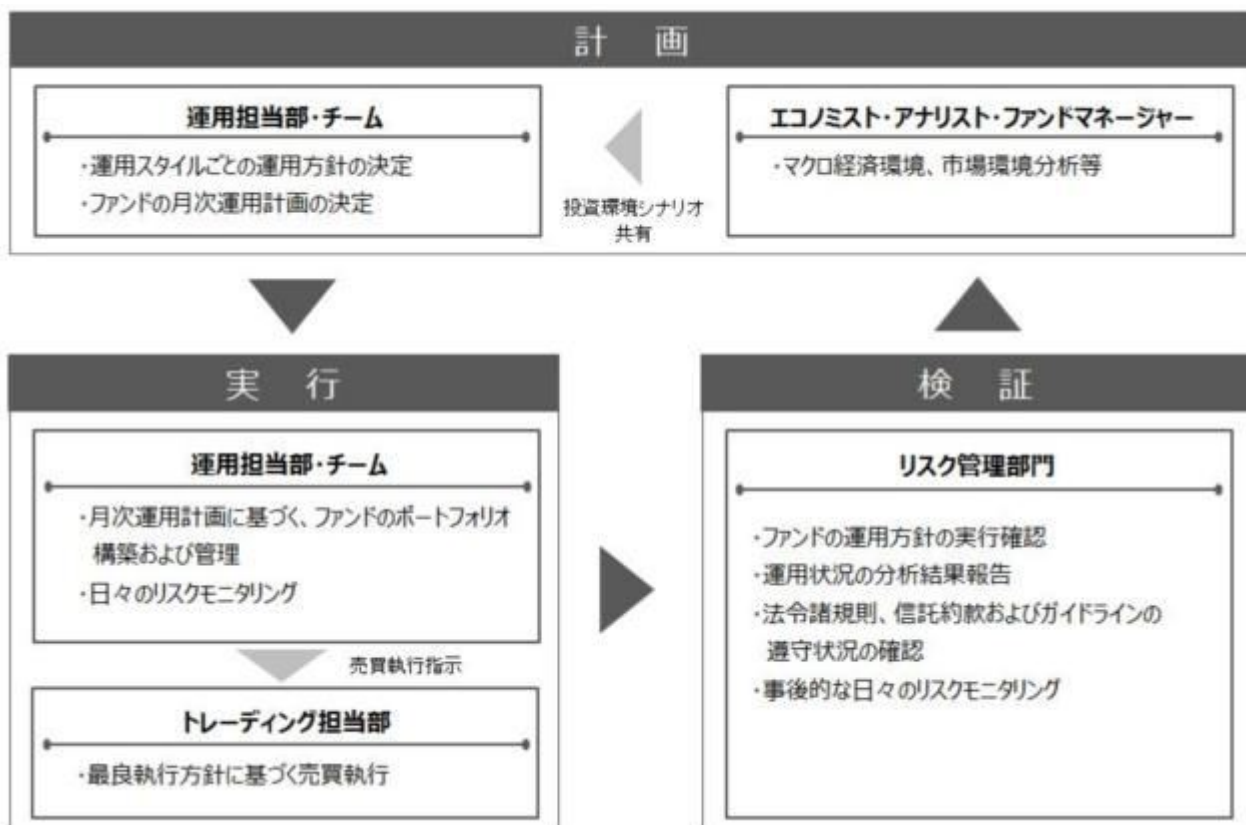
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

#### 二 投資信託の運用の流れ





## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2019年3月29日現在における三井住友アセットマネジメント株式会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(円)
追加型株式投資信託	467	5,759,755,732,324
単位型株式投資信託	92	523,512,840,677
追加型公社債投資信託	1	28,812,487,686
単位型公社債投資信託	115	311,786,512,725
合計	675	6,623,867,573,412

（ご参考）

2019年3月29日現在における大和住銀投信投資顧問株式会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(円)
追加型株式投資信託	309	2,926,233,606,958
単位型株式投資信託	21	57,872,142,748
追加型公社債投資信託	-	-
単位型公社債投資信託	72	250,140,415,808
合計	402	3,234,246,165,514

## 3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2 当社は、第33期（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任あずさ監査法人の監査を受けており、第34期中

間会計期間(平成30年4月1日から平成30年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

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

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に続き、大和住銀投信投資顧問株式会社の第46期事業年度の財務諸表及び第47期中間会計期間の中間財務諸表を参考情報として記載しております。

(1)【貸借対照表】

			(単位：千円)	
			前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部				
流動資産				
現金及び預金			13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託			20,008	20,010
前払費用			351,526	402,249
未収入金			40,544	39,030
未収委託者報酬			5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬			1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬			343,523	316,407
未収収益			20,789	50,321
繰延税金資産			482,535	715,988
その他の流動資産			5,560	10,891
流動資産合計			21,352,691	30,486,188
固定資産				
有形固定資産	1			
建物			198,767	185,371
器具備品			261,096	300,694
有形固定資産合計			459,864	486,065
無形固定資産				
ソフトウェア			493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定			141,025	5,755
電話加入権			68	56
商標権			3	-
無形固定資産合計			634,903	415,576
投資その他の資産				
投資有価証券			12,098,372	10,616,594
関係会社株式			10,412,523	10,412,523
長期差入保証金			677,681	658,505
長期前払費用			61,282	69,423
会員権			7,819	7,819
繰延税金資産			871,577	678,459
投資その他の資産合計			24,129,257	22,443,325
固定資産合計			25,224,025	23,344,968
資産合計			46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

			前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
--	--	--	-----------------------	-----------------------

負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(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	31,628,014	36,538,981
運用受託報酬	5,649,190	8,362,118

投資助言報酬	1,726,511	1,440,233
その他営業収益		
情報提供コンサルタント		
業務報酬	5,000	5,000
サービス支援手数料	61,268	128,324
その他	54,261	55,820
営業収益計	39,124,246	46,530,479
営業費用		
支払手数料	14,908,517	16,961,384
広告宣伝費	366,227	353,971
公告費	1,140	1,140
調査費		
調査費	1,325,978	1,654,233
委託調査費	4,343,104	5,972,473
営業雑経費		
通信費	46,030	40,066
印刷費	338,254	339,048
協会費	21,669	-
諸会費	20,054	45,465
情報機器関連費	2,516,497	2,582,734
販売促進費	24,896	34,333
その他	149,177	136,669
営業費用合計	24,061,549	28,121,520
一般管理費		
給料		
役員報酬	225,885	196,529
給料・手当	6,121,741	6,190,716
賞与	610,533	601,375
賞与引当金繰入額	989,925	1,566,810
交際費	23,136	25,709
事務委託費	317,928	256,413
旅費交通費	229,248	220,569
租税公課	268,527	282,036
不動産賃借料	622,662	654,286
退職給付費用	423,954	419,884
固定資産減価償却費	384,068	329,756
諸経費	335,840	285,490
一般管理費合計	10,553,451	11,029,580
営業利益	4,509,246	7,379,378
営業外収益		
受取配当金	1	106,651
受取利息	1	745
時効成立分配金・償還金		1,721
原稿・講演料		1,474
雑収入		12,592
営業外収益合計	123,184	66,042
営業外費用		
為替差損	9,737	5,125
雑損失	1,084	913
営業外費用合計	10,821	6,038
経常利益	4,621,608	7,439,383
特別利益		
投資有価証券償還益	353,462	61,842

投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
ゴルフ会員権売却損		3,894	-
事務所移転費用		21,175	-
特別損失合計		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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	利益剰余金			利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
当期純利益							3,519,223	3,519,223	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,508,263	1,508,263	1,508,263
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263

	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	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
当期純利益			3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

	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	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額			
剰余金の配当			1,887,480
当期純利益			4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

## [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) 満期保有目的の債券

償却原価法

## (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

## (2)無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

## 3.引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

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

## (2)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	291,976千円	312,784千円
器具備品	651,918千円	768,929千円

## 2 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入金未実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

## 3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	256,031千円	204,923千円

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
受取配当金	106,640千円	- 千円
受取利息	18千円	- 千円

## 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	6,952千円	- 千円
器具備品	1,204千円	0 千円
ソフトウェア	- 千円	9,000千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	345,695千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

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

平成29年6月27日開催の第32回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

当事業年度(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
----	-------	-------	----------------	-----------------	-----	-------



平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
----------------------	------	-------	-----------	---------	----------------	----------------

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

(金融商品関係)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

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

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているた

め、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券			
其他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-
(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### 資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

### 負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,279,384	-	-	-
顧客分別金信託	20,008	-	-	-
未収委託者報酬	5,511,715	-	-	-
未収運用受託報酬	1,297,104	-	-	-
未収投資助言報酬	343,523	-	-	-
長期差入保証金	31,201	646,480	-	-
合計	20,482,937	646,480	-	-

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成29年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2.その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
228,204	2,579	15,012

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

(退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	当事業年度 （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	3,028,212	3,177,131
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の発生額	15,494	51,212

退職給付の支払額	116,111	94,727
退職給付債務の期末残高	3,177,131	3,319,830

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,177,131	3,319,830
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の費用処理額	15,494	51,212
その他	158,924	182,458
確定給付制度に係る退職給付費用	423,954	419,884

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	0.000%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988

## 固定の部

## 繰延税金資産

退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

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

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.1	-
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.8	-
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	2.2	1.9
その他	0.0	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9	29.4

## (セグメント情報等)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	31,628,014	5,649,190	1,726,511	120,529	39,124,246

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

### (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

#### 1. 関連当事者との取引

##### (1) 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
子会社	SumitomoMitsui AssetManagement (HongKong)Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコン ドル)	投資運 用業	% (所有) 直接100	投信の助 言業務 役員の 兼任	剰余金 の配当	106,640	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等  
受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

##### (2) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,737,677	未払 手数料	489,567
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託	委託販売 手数料	5,485,934	未払 手数料	862,697

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等  
投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。  
3. ㈱三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付けで、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付けで「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。  
4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。  
なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

#### 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

#### 1. 関連当事者との取引

##### (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436



親会社 の子会 社	SMBC日興証 券㈱	東京都 千代田 区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売 委託 役員 兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752
-----------------	---------------	-----------------	------------	-----	--------	-------------------------	-------------	-----------	-----------	---------

(注)1.上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2.取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2.親会社に関する注記

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

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (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	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11円

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

2.1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,519,223	4,955,483
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	3,519,223	4,955,483
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

### (重要な後発事象)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

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

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

## 中間財務諸表

### (1)中間貸借対照表

(単位:千円)

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	19,085,678
顧客分別金信託	20,010
前払費用	414,616
未収委託者報酬	7,225,367
未収運用受託報酬	1,541,190

未収投資助言報酬		306,565
未収収益		51,614
その他		53,465
流動資産合計		28,698,508
固定資産		
有形固定資産	1	508,186
無形固定資産		437,397
投資その他の資産		
投資有価証券		9,519,317
関係会社株式		10,412,523
繰延税金資産		1,364,662
その他		1,500,406
投資その他の資産合計		22,796,910
固定資産合計		23,742,493
資産合計		52,441,002
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		649
その他の預り金		116,730
未払金		3,491,463
未払費用		3,428,351
未払法人税等		1,080,277
前受収益		8,509
賞与引当金		1,233,571
その他	2	228,340
流動負債合計		9,587,893
固定負債		
退職給付引当金		3,435,254
賞与引当金		41,631
その他		1,383
固定負債合計		3,478,268
負債合計		13,066,162
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		26,222,740
利益剰余金合計		28,043,944

株主資本合計	38,672,928
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	701,911
評価・換算差額等合計	701,911
純資産合計	39,374,840
負債純資産合計	52,441,002

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			20,003,107
運用受託報酬			3,216,910
投資助言報酬			696,543
その他の営業収益			117,677
営業収益計			24,034,239
営業費用			15,495,987
一般管理費	1		5,200,633
営業利益			3,337,618
営業外収益	2		13,622
営業外費用	3		10,296
経常利益			3,340,944
特別利益	4		293,441
特別損失	5		35,355
税引前中間純利益			3,599,031
法人税、住民税及び事業税			1,010,764
法人税等調整額			104,205
法人税等合計			1,114,969
中間純利益			2,484,061

## (3)中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,822,400	2,822,400	2,822,400

中間純利益							2,484,061	2,484,061	2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	338,338	338,338	338,338
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,222,740	28,043,944	38,672,928

	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	870,535	870,535	39,881,802
当中間期変動額			
剰余金の配当			2,822,400
中間純利益			2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	168,624	168,624	168,624
当中間期変動額合計	168,624	168,624	506,962
当中間期末残高	701,911	701,911	39,374,840

## 注記事項

### (重要な会計方針)

#### 1. 資産の評価基準及び評価方法

##### (1) 有価証券

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

#### 2. 固定資産の減価償却の方法

##### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

##### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

#### 3. 引当金の計上基準

##### (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

##### (2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

##### （表示方法の変更）

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

##### （中間貸借対照表関係）

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	1,162,157千円
2. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	
3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座借越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 差引額 10,000,000千円	
4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額198,989千円の支払保証を行っております。	

##### （中間損益計算書関係）

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
1. 減価償却実施額 有形固定資産 80,772千円 無形固定資産 84,457千円	
2. 営業外収益のうち主要なもの 雑益 13,281千円	
3. 営業外費用のうち主要なもの 為替差損 10,293千円	
4. 特別利益のうち主要なもの 投資有価証券償還益 289,451千円 投資有価証券売却益 3,990千円	
5. 特別損失のうち主要なもの 合併関連費用 23,103千円 合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等 あります。 投資有価証券売却損 12,101千円	

##### （中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）

##### 1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

##### 2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

## (リース取引関係)

第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	595,231千円
1年超	3,853,814千円
合 計	4,449,045千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第34期中間会計期間(平成30年9月30日)

平成30年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	19,085,678	19,085,678	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	7,225,367	7,225,367	-
(4)未収運用受託報酬	1,541,190	1,541,190	-
(5)未収投資助言報酬	306,565	306,565	-
(6)投資有価証券			
其他有価証券	9,519,019	9,519,019	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	1,434,365	1,434,365	-
資産計	39,132,197	39,132,197	-
(1)顧客からの預り金	649	649	-
(2)未払金			
未払手数料	3,310,988	3,310,988	-
負債計	3,311,637	3,311,637	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬、及び(5)未収投資助言報酬  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (6)投資有価証券

## 其他有価証券

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

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

## (7)投資その他の資産

## 長期差入保証金

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

## 負 債

## (1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 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	中間貸借対照表計上額
其他有価証券	
非上場株式	298
合計	298
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	10,412,523

合計	10,412,523
----	------------

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

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

(有価証券関係)

第34期中間会計期間（平成30年9月30日）

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（中間貸借対照表計上額 10,412,523千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,621,299	5,533,700	1,087,599
小計	6,621,299	5,533,700	1,087,599
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	2,897,719	2,973,628	75,908
小計	2,897,719	2,973,628	75,908
合計	9,519,019	8,507,328	1,011,691

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	20,003,107	3,216,910	696,543	117,677	24,034,239

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

ん。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報  
該当事項はありません。
4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報  
該当事項はありません。
5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報  
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,232円13銭
1株当たり中間純利益	140円81銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。</p>	
<p>(注) 当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、当事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益を算定しております。</p>	
<p>1株当たり純資産額の算定上の基礎</p>	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	39,374,840千円
普通株式に係る純資産額	39,374,840千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640,000株
<p>1株当たり中間純利益の算定上の基礎</p>	
中間損益計算書上の中間純利益	2,484,061千円
普通株式に係る中間純利益	2,484,061千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定に用いられた普通株式の期中平均株式数	17,640,000株

(追加情報)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間の合併契約の締結について

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社(以下「大和住銀」)との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。また、平成30年10月31日に当社臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ております。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社  
事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

(2) 企業結合を行う主な理由

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

(3) 企業結合日



平成31年4月1日(予定)

#### (4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀を消滅会社とする吸収合併方式であります。

#### (5)結合後企業の名称

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社

#### (6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

### (1)合併比率

大和住銀の普通株式1株に対し、当社の普通株式4.2156株を割当て交付いたします。

### (2)合併比率の算定方法

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

### (3)交付予定の株式数

普通株式：16,230,060株

## (重要な後発事象)

### 株式分割

当社は、平成30年9月28日開催の取締役会決議に基づき、平成30年11月1日付で株式分割を行っております。

### 1. 株式分割の目的

合併に伴い株主の議決権割合が変更となる見込みであり、円滑に変更手続きを行うために株式分割を行っております。

### 2. 株式分割の概要

#### (1)分割の方法

平成30年10月31日を基準日として、同日最終の株主名簿に記載された株主の所有する普通株式1株につき、1,000株の割合をもって分割しております。

#### (2)分割により増加した株式数

株式分割前の発行済株式総数	17,640株
今回の分割により増加した株式数	17,622,360株
株式分割後の発行済株式数	17,640,000株
株式分割後の発行可能株式総数	60,000,000株

#### (3)株式分割の日程

基準日公告日	平成30年10月12日
基準日	平成30年10月31日
効力発生日	平成30年11月1日

#### (4)1株当たり情報に及ぼす影響

1株当たり情報に及ぼす影響については、当該箇所に記載しております。

(参考) 大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。  
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号。)並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「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。)により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第46期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表及び、第47期中間会計期間(平成30年4月1日から平成30年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

**独立監査人の監査報告書**

平成30年5月5日

大和住銀投信投資顧問株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯 田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 梅 津 広 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第46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、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成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。

**強調事項**

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付にて、会社及び三井住友アセットマネジメント株式会社の主要株主が、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以 上

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

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年12月3日

大和住銀投信投資顧問株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 坂 田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経営状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**強調事項**

追加情報に記載されているとおり、会社は、平成30年9月27日開催の会社の取締役会において、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、平成30年9月28日付で締結した。また、平成30年10月31日に会社の臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ている。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**（1）貸借対照表**

（単位：千円）

第45期

第46期

（平成29年3月31日）

（平成30年3月31日）

## 資産の部

## 流動資産

現金・預金		21,770,643	21,360,895
前払費用		206,930	204,460
未収入金		7,453	12,823
未収委託者報酬		3,291,565	3,363,312
未収運用受託報酬		912,489	1,198,432
未収収益		50,722	41,310
繰延税金資産		447,651	504,497
その他		428	7,553
流動資産計		26,687,885	26,693,285

## 固定資産

## 有形固定資産

建物	1	110,298	75,557
器具備品	1	66,464	122,169
土地		710	710
リース資産	1	10,562	7,275
有形固定資産計		188,035	205,712

## 無形固定資産

ソフトウェア		96,732	73,887
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		109,439	86,593

## 投資その他の資産

投資有価証券		6,783,747	10,257,600
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,546	1,170
長期差入保証金		511,637	534,699
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		523,217	536,754
その他		192	-
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		8,838,366	12,348,249

## 固定資産計

	9,135,840	12,640,555
--	-----------	------------

## 資産合計

	35,823,726	39,333,840
--	------------	------------

(単位：千円)

第45期

第46期

(平成29年3月31日)

(平成30年3月31日)

## 負債の部

## 流動負債

リース債務		3,524	3,143
-------	--	-------	-------

未払金	61,012	29,207
未払手数料	1,419,878	1,434,393
未払費用	1,150,008	1,287,722
未払法人税等	459,723	1,397,293
未払消費税等	26,700	135,042
賞与引当金	1,251,100	1,263,100
役員賞与引当金	82,900	85,600
その他	46,283	23,128
流動負債計	4,501,131	5,658,632
固定負債		
リース債務	7,841	4,698
退職給付引当金	1,482,500	1,540,203
役員退職慰労引当金	93,560	88,050
固定負債計	1,583,902	1,632,952
負債合計	6,085,034	7,291,585

(単位：千円)

	第45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	26,100,773	28,387,042
利益剰余金合計	27,544,504	29,830,773
株主資本合計	29,700,773	31,987,042
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	37,917	55,213
評価・換算差額等合計	37,917	55,213
純資産合計	29,738,691	32,042,255
負債純資産合計	35,823,726	39,333,840

## (2) 損益計算書

(単位:千円)

	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	4,371,647	5,111,757
委託者報酬	28,124,470	26,383,145
その他営業収益	64,558	82,997
営業収益計	32,560,677	31,577,899
営業費用		
支払手数料	13,056,474	11,900,832
広告宣伝費	169,346	93,131
公告費	2,915	-
調査費		
調査費	1,331,709	1,637,364
委託調査費	3,213,013	2,959,680
委託計算費	137,135	79,120
営業雑経費		
通信費	39,943	42,497
印刷費	501,370	517,371
協会費	24,788	24,374
諸会費	2,492	3,778
その他	109,609	122,930
営業費用計	18,588,799	17,381,079
一般管理費		
給料		
役員報酬	209,010	218,127
給料・手当	2,852,929	2,809,008
賞与	129,064	86,028
退職金	32,873	9,864
福利厚生費	639,080	647,269
交際費	22,638	29,121
旅費交通費	142,966	159,224
租税公課	174,826	199,255
不動産賃借料	620,232	622,807
退職給付費用	217,625	219,724
固定資産減価償却費	57,699	71,624
賞与引当金繰入額	1,251,100	1,263,100
役員退職慰労引当金繰入額	38,169	36,130
役員賞与引当金繰入額	80,300	85,500

諸経費	564,747	901,001
一般管理費計	7,033,264	7,357,787
営業利益	6,938,613	6,839,032
営業外収益		
受取配当金	4,517	23,350
受取利息	675	199
投資有価証券売却益	6,051	6,350
業務委託関連引当金戻入	4,000	-
為替差益	123	-
その他	5,690	2,831
営業外収益計	21,058	32,732
営業外費用		
投資有価証券売却損	21,990	5,000
為替差損	-	1,784
その他	113	0
営業外費用計	22,103	6,784
経常利益	6,937,568	6,864,980
税引前当期純利益	6,937,568	6,864,980
法人税、住民税及び事業税	1,881,549	2,242,775
法人税等調整額	225,697	78,014
法人税等合計	2,107,247	2,164,761
当期純利益	4,830,321	4,700,218

## (3) 株主資本等変動計算書

第45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		利益剰余金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	24,034,752
当期変動額						
剰余金の配当						2,764,300
当期純利益						4,830,321
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,066,021
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				



当期首残高	25,478,483	27,634,752	27,182	27,182	27,661,934
当期変動額					
剰余金の配当	2,764,300	2,764,300			2,764,300
当期純利益	4,830,321	4,830,321			4,830,321
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			10,735	10,735	10,735
当期変動額合計	2,066,021	2,066,021	10,735	10,735	2,076,757
当期末残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項 目の当期変動額 (純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

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

## 注記事項

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。）を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 15～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（貸借対照表関係）

<p>第45期 （平成29年3月31日）</p>	<p>第46期 （平成30年3月31日）</p>
------------------------------	------------------------------

1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	454,117千円	建物	465,964千円
器具備品	272,531千円	器具備品	266,621千円
リース資産	10,688千円	リース資産	8,719千円
2.保証債務		2.保証債務	
被保証者	従業員		-
被保証債務の内容	住宅ローン		
金額	940千円		

## (株主資本等変動計算書関係)

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1.発行済株式に関する事項

(単位：千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

## 2.配当に関する事項

## (1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,764,300	718	平成28年3月31日	平成28年6月24日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,413,950	利益 剰余金	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 1.発行済株式に関する事項

(単位：千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

## 2.配当に関する事項

## (1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

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

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

## (金融商品関係)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

第45期（平成29年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	21,770,643	21,770,643	-
(2) 未収委託者報酬	3,291,565	3,291,565	-
(3) 未収運用受託報酬	912,489	912,489	-
(4) 未収入金	7,453	7,453	-
(5) 投資有価証券			
その他有価証券	6,732,611	6,732,611	-

資産計	32,714,763	32,714,763	-
(1) 未払手数料	1,419,878	1,419,878	-
(2) 未払費用(*)	891,704	891,704	-
負債計	2,311,583	2,311,583	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

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

(単位:千円)

区分	第45期(平成29年3月31日)	第46期(平成30年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	51,135	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	511,637	534,699

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第45期(平成29年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超

現金・預金	21,770,643	-	-	-
未収委託者報酬	3,291,565	-	-	-
未収運用受託報酬	912,489	-	-	-
未収入金	7,453	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券の うち満期があるもの	-	2,222,381	467,133	-
合計	25,982,151	2,222,381	467,133	-

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

## 1. 子会社株式

第45期（平成29年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第45期（平成29年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
その他 証券投資信託の受益証券	3,882,464	3,705,555	176,909
小計	3,882,464	3,705,555	176,909
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託の受益証券	2,850,146	2,972,404	122,257
小計	2,850,146	2,972,404	122,257
合計	6,732,611	6,677,959	54,652

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,105,918	6,051	21,990

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	398,350	6,350	5,000

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	第45期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第46期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	1,546,322	1,482,500
退職給付費用	149,442	147,235
退職給付の支払額	213,264	105,520
その他	-	15,987
退職給付引当金の期末残高	1,482,500	1,540,203

（注）その他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

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

（単位：千円）

	第45期 （平成29年3月31日）	第46期 （平成30年3月31日）
積立型制度の退職給付債務	-	-

年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,482,500	1,540,203
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,482,500	1,540,203
退職給付引当金	1,482,500	1,540,203
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,482,500	1,540,203

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第45期 149,442千円 第46期 147,235千円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第45期は68,183千円、第46期は72,489千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30年3月31日)
(1) 流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	12,099	71,030
賞与引当金	386,089	386,761
社会保険料	29,075	30,549
未払事業所税	4,693	4,247
その他	21,191	11,908
繰延税金資産合計	453,148	504,497
繰延税金負債		
その他	5,496	-
繰延税金負債合計	5,496	-
繰延税金資産の純額	447,651	504,497
(2) 固定資産		
繰延税金資産		
退職給付引当金	454,152	471,610
投資有価証券	67,546	67,546
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	28,748	26,961
その他	57,051	62,550
繰延税金資産小計	618,499	639,668
評価性引当額	78,546	78,546
繰延税金資産合計	539,952	561,121
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	16,734	24,367
繰延税金負債合計	16,734	24,367
繰延税金資産の純額	523,217	536,754

## 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45期及び第46期は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下にあた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

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	28,124,470	4,371,647	64,558	32,560,677

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

第45期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金(億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,766,199	未払手数料	406,661
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	2,372,960	未払手数料	377,341

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金(億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46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	7,724円34銭	8,322円66銭
1株当たり当期純利益金額	1,254円63銭	1,220円84銭

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

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(千円)	4,830,321	4,700,218
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,830,321	4,700,218
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付にて、当社及び三井住友アセットマネジメント株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社、及び住友生命保険相互会社が、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成30年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		18,749,227
前払費用		220,062
未収入金		134,890
未収委託者報酬		3,199,531
未収運用受託報酬		1,318,844
未収収益		40,355
その他		3,640
流動資産計		23,666,551
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	304,462
器具備品	1	106,510
土地		710
リース資産	1	9,904
有形固定資産計		421,586
無形固定資産		103,187

投資その他の資産	
投資有価証券	11,160,853
関係会社株式	956,115
従業員長期貸付金	1,123
長期差入保証金	534,276
出資金	82,660
繰延税金資産	841,341
その他	945
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産計	13,556,564
固定資産計	14,081,338
資産合計	37,747,889

(単位：千円)

当中間会計期間  
(平成30年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

リース債務	3,727
未払金	66,584
未払手数料	1,372,290
未払費用	1,215,524
未払法人税等	754,735
未払消費税等	145,434
前受収益	43,935
賞与引当金	566,800
役員賞与引当金	36,000
その他	22,639
流動負債計	4,227,672

## 固定負債

リース債務	6,965
退職給付引当金	1,574,978
役員退職慰労引当金	100,760
資産除去債務	248,260
固定負債計	1,930,965

## 負債合計

6,158,637

(単位：千円)

当中間会計期間  
(平成30年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	156,268
資本剰余金合計	156,268
利益剰余金	
利益準備金	343,731
その他利益剰余金	
別途積立金	1,100,000
繰越利益剰余金	27,961,448
利益剰余金合計	29,405,179
株主資本合計	31,561,448
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	27,803
評価・換算差額等合計	27,803
純資産合計	31,589,252
負債純資産合計	37,747,889

## ( 2 ) 中間損益計算書

( 単位:千円 )

当中間会計期間  
( 自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日 )

営業収益	
委託者報酬	12,879,465
運用受託報酬	2,302,085
その他営業収益	34,382
営業収益計	15,215,933
営業費用	
一般管理費	1 3,616,813
営業利益	2,819,632
営業外収益	
受取配当金	14,987
受取利息	89
投資有価証券売却益	4,775
雑収入	635
営業外収益計	20,488
営業外費用	
投資有価証券売却損	4,300

為替差損		224
その他		389
営業外費用計		4,914
経常利益		2,835,206
特別損失	2	21,700
税引前中間純利益		2,813,506
法人税、住民税及び事業税		678,594
法人税等調整額		212,006
法人税等合計		890,600
中間純利益		1,922,905

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,348,500
中間純利益						1,922,905
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	425,594
当中間期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,961,448

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,348,500	2,348,500			2,348,500
中間純利益	1,922,905	1,922,905			1,922,905
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			27,409	27,409	27,409
当中間期変動額合計	425,594	425,594	27,409	27,409	453,003
当中間期末残高	29,405,179	31,561,448	27,803	27,803	31,589,252

## 注記事項

## （重要な会計方針）

1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>(1)子会社株式 …総平均法による原価法</p> <p>(2)その他有価証券</p> <p>時価のあるもの…中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は総平均法により算定）</p> <p>時価のないもの…総平均法による原価法</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1)有形固定資産（リース資産を除く）</p> <p>定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物2年～30年、器具備品4年～15年 （会計上の見積りの変更）</p> <p>当中間会計期間において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社（以下「S M A M」）との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ2,226千円減少しております。</p> <p>(2)無形固定資産（リース資産を除く）</p> <p>定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>(3)所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産</p> <p>リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1)貸倒引当金</p> <p>債権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、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2)賞与引当金</p> <p>従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(3)役員賞与引当金</p> <p>役員賞与の支払に備えるため、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(4)退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当中間会計期間末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5)役員退職慰労引当金</p> <p>役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末の要支給額を計上しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## (表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

## (追加情報)

当社とS M A Mとの間での合併契約の締結について

当社は、平成30年9月27日開催の当社取締役会において、当社とS M A Mとの間で合併契約を締結することについて決議し、平成30年9月28日付で締結しました。また、平成30年10月31日に当社臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ております。

## 1. 企業結合の概要

## (1) 吸収合併存続会社及び吸収合併消滅会社の名称及び事業の内容

吸収合併存続会社の名称	三井住友アセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業、投資助言・代理業等
吸収合併消滅会社の名称	大和住銀投信投資顧問株式会社
事業の内容	投資運用業、投資助言・代理業等

## (2) 企業結合を行う主な理由

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

## (3) 企業結合日

平成31年4月1日(予定)

## (4) 企業結合の法的形式

当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式であります。

## (5) 結合後企業の名称

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社

## (6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、S M A Mを取得企業としております。

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

## (1) 合併比率

当社の普通株式1株に対し、S M A Mの普通株式4.2156株を割当て交付いたします。

## (2) 合併比率の算定方法

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

## (3) 交付株式数

普通株式：16,230,060株



## （中間貸借対照表関係）

当中間会計期間（平成30年9月30日）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	781,783千円

## （中間損益計算書関係）

当中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産 無形固定資産	40,478千円 16,211千円
2.特別損失	合併関連費用	21,700千円
合併関連費用は、当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用等であります。		

## （中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）					
1.発行済株式に関する事項					
株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	
普通株式（千株）	3,850	-	-	3,850	
2.配当に関する事項					
配当金支払額					
決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

## （金融商品関係）

当中間会計期間（平成30年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

（（注2）をご参照ください。）

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	18,749,227	18,749,227	-
(2)未収委託者報酬	3,199,531	3,199,531	-
(3)未収運用受託報酬	1,318,844	1,318,844	-
(4)未収入金	134,890	134,890	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	11,109,717	11,109,717	-
(6)長期差入保証金	519,765	519,765	-
資産計	35,031,976	35,031,976	-
(1)未払手数料	1,372,290	1,372,290	-
(2)未払費用	878,527	878,527	-

負債計	2,250,818	2,250,818	-
-----	-----------	-----------	---

( ) 金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

(5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。

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

(6) 長期差入保証金

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

#### 負債

(1) 未払手数料及び(2) 未払費用

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

(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	中間貸借対照表計上額
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115
(3) 長期差入保証金	14,511

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成30年9月30日)

1. 子会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式956,115千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
証券投資信託の受益証券	5,053,937	4,797,266	256,671
小計	5,053,937	4,797,266	256,671
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
証券投資信託の受益証券	6,055,780	6,272,376	216,596

小計	6,055,780	6,272,376	216,596
合計	11,109,717	11,069,643	40,074

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 51,135千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間(平成30年9月30日)

デリバティブ取引を利用しておりませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

当該資産除去債務の総額の増減

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
期首残高	-
見積りの変更による増加額(注)	248,260
中間期末残高	248,260

(注) 主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について、当中間会計期間において、新たな情報の入手に伴い合理的な見積りが可能となったため、使用見込期間を当該契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上していません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)

1. サービスごとの情報

(単位:千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	12,879,465	2,302,085	34,382	15,215,933

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載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

当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)  
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報  
当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)  
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報  
当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)  
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成30年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	8,205円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	31,589,252
純資産の部の合計額から控除する金額(千円)	-
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	31,589,252
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末の普通株式の数(千株)	3,850

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	499円46銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,922,905
普通株式に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,922,905
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載しておりません。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内

閣府令で定めるものを除きます。)

- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### イ 定款の変更、その他の重要事項

#### (イ) 定款の変更

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

#### (ロ) その他の重要事項

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

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

## 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】

#### イ 受託会社

- (イ) 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 324,279百万円（2018年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### [参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円（2018年9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### ロ 販売会社

- (イ) 名称 株式会社三井住友銀行
- (ロ) 資本金の額 1,770,996百万円（2018年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

## 3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）  
該当ありません。

## 第3【その他】

### 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- （1）「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- （2）委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- （3）委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
- （4）請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- （5）目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- （6）投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- （7）請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
- （8）「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
- （9）当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
- （10）ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
- （11）写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。

### 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

### 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。

### 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。

### 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

### 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤陽一	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	池ヶ谷正	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井住友アセットマネジメント株式会社の平成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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付で会社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主が、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

(注)1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

平成31年4月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友グローバル債券オープンの平成30年9月13日から平成31年3月12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、三井住友グローバル債券オープンの平成31年3月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年11月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**強調事項**

追加情報に記載されているとおり、会社は、平成30年9月28日開催の会社の取締役会において、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結した。また、平成30年10月31日に会社の臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ている。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。