

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年3月10日提出
【発行者名】	新光投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 後藤 修一
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目17番10号
【事務連絡者氏名】	坂本 久
【電話番号】	03-3277-1800
【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】	バンクローン・ファンド（ヘッジなし） バンクローン・ファンド（ヘッジあり）
【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】	継続募集額(平成27年9月11日から平成28年9月9日まで) バンクローン・ファンド（ヘッジなし） 3兆円を上限とします。 バンクローン・ファンド（ヘッジあり） 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出しましたので、平成27年 9月10日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するため提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

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】

(3)【ファンドの仕組み】

b. 委託会社の概況

<訂正前>

(イ) 資本金の額（平成27年6月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成27年6月末現在)

株主名	住所	持株数	持株比率
みずほ証券株式会社	東京都千代田区大手町1-5-1	1,396,362株	76.58%
株式会社みずほ銀行	東京都千代田区大手町1-5-5	182,115	9.98
株式会社みずほ証券リサーチ & コンサルティング	東京都中央区日本橋1-17-10	137,200	7.52

<訂正後>

(イ) 資本金の額（平成27年12月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成27年12月末現在)

株主名	住所	持株数	持株比率
みずほ証券株式会社	東京都千代田区大手町1-5-1	1,396,362株	76.58%
株式会社みずほ銀行	東京都千代田区大手町1-5-5	182,115	9.98
株式会社みずほ証券リサーチ & コンサルティング	東京都中央区日本橋1-17-10	137,200	7.52

2【投資方針】

(2)【投資対象】

各ファンドが投資する投資信託証券の概要

< 訂正前 >

1. バンクローン・ポートフォリオの概要

ファンド名	イートン・バンス・インターナショナル(ケイマン・アイランズ)フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラスI 3 \$ シェアーズ
形態	ケイマン諸島籍外国投資法人 / 米ドル建て投資証券
運用方針	主として米ドル建ての企業向けバンクローン(貸付債権)に投資することで、高いインカムゲインの確保を目指して運用を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 主として、優先担保付のバンクローンに投資しますが、劣後担保付や無担保のバンクローンに投資する場合があります。 総資産の80%以上を変動金利のバンクローンもしくは債券に投資します。 総資産の25%を上限に米国以外のバンクローンに投資する場合がありますが、原則として、それらは米ドル建てのものとしします。 流動性の低い有価証券への投資は15%を上限としします。 解約への対応時やその他の一時的な対応を除き、総資産の5%以上の借り入れは行いません。
決算日	10月末
関係法人	投資顧問会社兼管理事務代行会社：イートン・バンス・マネジメント 保管会社(純資産価格の算出業務を含む)：ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー 登録機関兼名義書換代理人：シティバンク・ヨーロッパ・ピーエルシー
信託報酬等	純資産総額に対し年率0.59%程度 上記料率には、投資顧問会社、保管会社、登録機関兼名義書換代理人などの費用が含まれます。ただし、投資対象ファンド全体またはクラスごとに発生する最低支払額、固定費、取引頻度に応じた費用などは含んでいないため、資産規模、取引頻度などの影響により上記料率を上回る場合があります。
その他の費用・手数料	法務費用、監査その他の会計関係費用、金利、印刷費用なども当該外国投資法人から支払われます。これらは定率でないため事前に概算料率や上限額などを表示することができません。
収益分配方針	原則として、毎月分配を行います。
設定日	平成19年12月10日(ポートフォリオを共有する別クラスの設定日)

2. 日本短期公社債マザーファンドの概要

ファンド名	日本短期公社債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。 ファンドの資金動向、市況動向などによっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年7月3日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。

信託設定日	平成21年7月6日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	みずほ信託銀行株式会社 (再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社)

上記の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

上記の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。

また、各概要は平成27年9月10日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

<訂正後>

1. バンクローン・ポートフォリオの概要

ファンド名	イートン・バンス・インターナショナル(ケイマン・アイランズ)フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ-クラスI 3\$シェアーズ
形態	ケイマン諸島籍外国投資法人/米ドル建て投資証券
運用方針	主として米ドル建ての企業向けバンクローン(貸付債権)に投資することで、高いインカムゲインの確保を目指して運用を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 主として、優先担保付のバンクローンに投資しますが、劣後担保付や無担保のバンクローンに投資する場合があります。 総資産の80%以上を変動金利のバンクローンもしくは債券に投資します。 総資産の25%を上限に米国以外のバンクローンに投資する場合がありますが、原則として、それらは米ドル建てのものとしします。 流動性の低い有価証券への投資は15%を上限としします。 解約への対応時やその他の一時的な対応を除き、総資産の5%以上の借り入れは行いません。
決算日	10月末
関係法人	投資顧問会社兼管理事務代行会社：イートン・バンス・マネジメント 保管会社(純資産価格の算出業務を含む)：ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー 登録機関兼名義書換代理人：シティバンク・ヨーロッパ・ピーエルシー
信託報酬等	純資産総額に対し年率0.59%程度 上記料率には、投資顧問会社、保管会社、登録機関兼名義書換代理人などの費用が含まれます。ただし、投資対象ファンド全体またはクラスごとに発生する最低支払額、固定費、取引頻度に応じた費用などは含んでいないため、資産規模、取引頻度などの影響により上記料率を上回る場合があります。
その他の費用・手数料	法務費用、監査その他の会計関係費用、金利、印刷費用なども当該外国投資法人から支払われます。これらは定率でないため事前に概算料率や上限額などを表示することができません。
収益分配方針	原則として、毎月分配を行います。
設定日	平成19年12月10日(ポートフォリオを共有する別クラスの設定日)

2. 日本短期公社債マザーファンドの概要

ファンド名	日本短期公社債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。 ファンドの資金動向、市況動向などによっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	・株式への投資は行いません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年7月3日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成21年7月6日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	みずほ信託銀行株式会社 (再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社)

上記の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

上記の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。

また、各概要は平成28年3月10日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

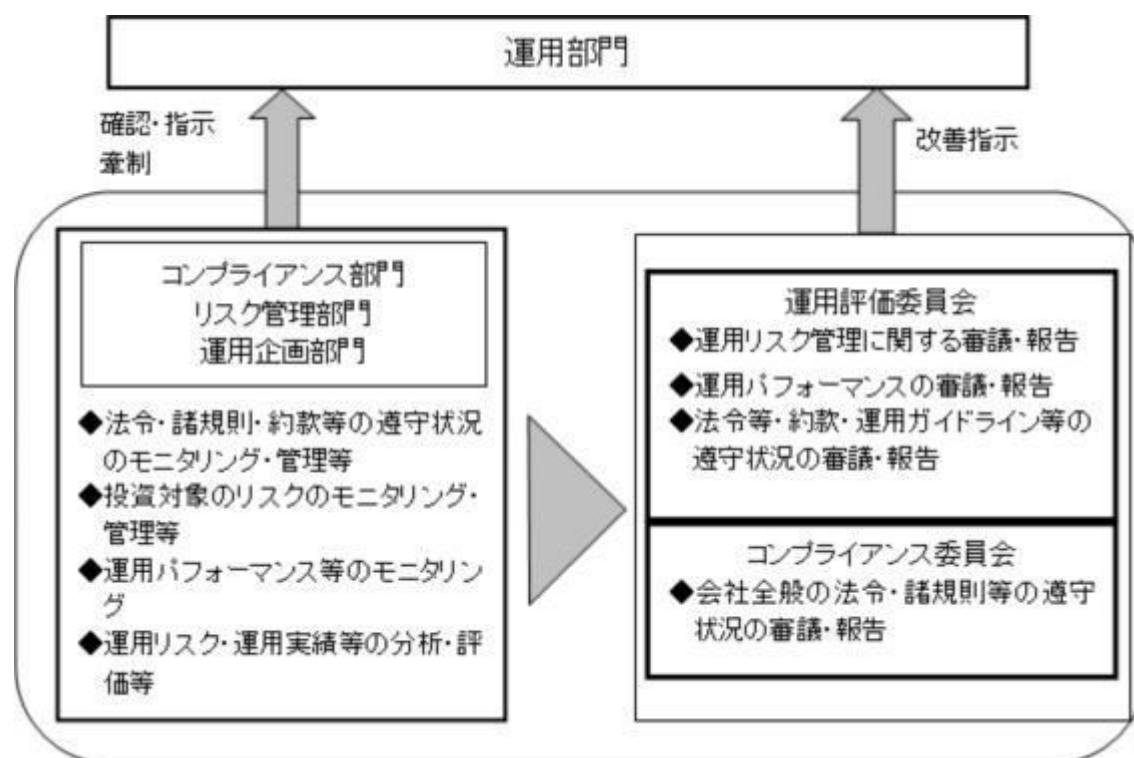
3【投資リスク】

(2) リスク管理体制

<更新後>

パフォーマンスの分析・管理 : 運用成果を分析し、その結果を審議・検討してその評価を行います。

運用リスクの管理 : 投資信託財産の運用リスクの管理およびその管理の現状・適正性を把握し、管理方針を協議、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。



上記リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

<参考情報>

「ヘッジなし」

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
*年間騰落率は、2013年12月から2015年12月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。

「ヘッジあり」

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

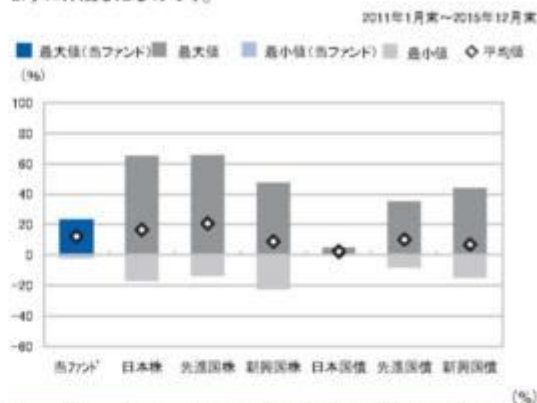


*分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
*年間騰落率は、2013年12月から2015年12月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

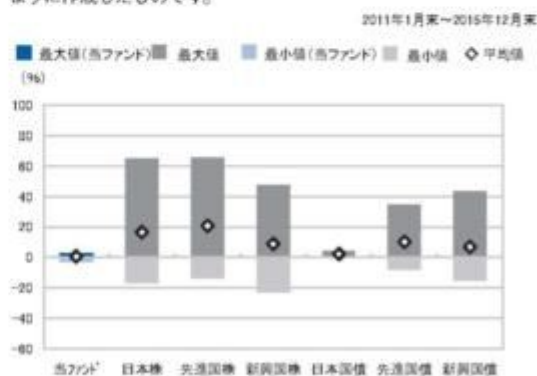


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	23.4	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値	△2.0	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△7.9	△15.0
平均値	12.2	16.6	20.7	8.8	2.3	10.2	6.9

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
*2011年1月から2015年12月の5年間の当ファンドは2013年12月から2015年12月の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
*決算日に対応した数値とは異なります。
*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	2.9	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値	△2.5	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△7.9	△15.0
平均値	0.7	16.6	20.7	8.8	2.3	10.2	6.9

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
*2011年1月から2015年12月の5年間の当ファンドは2013年12月から2015年12月の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
*決算日に対応した数値とは異なります。
*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

投資リスク

各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
 日本国債・・・NOMURA-BPI国債
 先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 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・デバースファイド(円ベース)
 (注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。

なお、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

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・デバースファイド(円ベース)

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・デバースファイド(円ベース)は、JP Morgan Securities LLCが開発し、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、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・デバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、JP Morgan Securities LLCに帰属します。

本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、JP Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。JP Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, JP, Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

a．個人の受益者の場合

(イ) 収益分配金の取り扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません。）・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。また、特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

（略）

(ハ) 損益通算について

一部解約時、償還時に生じた損失（譲渡損）は、確定申告を行うことにより上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得の金額（申告分離課税を選択したものに限りま

す。）から差し引くこと（損益通算）ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。一部解約時、償還時に生じた差益（譲渡益）は、上場株式等の譲渡損と損益通算ができます。

また、特定口座（源泉徴収あり）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行うことが可能です（申告不要）。

なお、平成28年1月1日以降、上記の損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象範囲に特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等が追加されます。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合>

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などについての非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（略）

上記は平成27年6月末現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「（5）課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

a．個人の受益者の場合

(イ) 収益分配金の取り扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません。）・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

（略）

（八）損益通算について

一部解約時、償還時に生じた損失（譲渡損）は、確定申告を行うことにより上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）から差し引くこと（損益通算）ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。一部解約時、償還時に生じた差益（譲渡益）は、上場株式等の譲渡損と損益通算ができます。

また、特定口座（源泉徴収あり）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行うことが可能です（申告不要）。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合 >

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などについての非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（略）

上記は平成28年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「（5）課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	ケイマン諸島	11,553,046,486	95.27
親投資信託受益証券	日本	16,002,985	0.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		557,422,460	4.59
純資産総額		12,126,471,931	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	ケイマン諸島	6,623,915,661	93.87
親投資信託受益証券	日本	14,006,967	0.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		418,213,025	5.92

純資産総額	7,056,135,653	100.00
-------	---------------	--------

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考)日本短期公社債マザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	59,999,970	89.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,919,670	10.34
純資産総額		66,919,640	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

バンクローン・ファンド(ヘッジなし)

イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	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 (%)
1	ケイマン 諸島	投資証券	イートン・パンズ・インターナショナル(ケイマン・アイランズ)フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラス 3 \$シェアーズ	10,233,810.118	1,138.55	11,651,790,473	1,128.9095	11,553,046,486	95.27
2	日本	親投資信託 受益証券	日本短期公社債マザーファンド	15,905,959	1.0061	16,002,985	1.0061	16,002,985	0.13

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	95.27
親投資信託受益証券	0.13
合計	95.40

バンクローン・ファンド(ヘッジあり)

イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	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 (%)
1	ケイマン 諸島	投資証券	イトン・パンス・インターナ ショナル(ケイマン・アイラン ズ)フローティング・レート・イ ンカム・ポートフォリオ - クラ ス 3 \$シェアーズ	5,867,534.178	1,138.55	6,680,530,325	1,128.9095	6,623,915,661	93.87
2	日本	親投資信託 受益証券	日本短期公社債マザーファンド	13,922,043	1.0061	14,006,967	1.0061	14,006,967	0.19

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨て
ているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しておりま
す。

ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	93.87
親投資信託受益証券	0.19
合計	94.07

(参考)日本短期公社債マザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	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 (%)
1	日本	国債証券	第567回国庫 短期証券	30,000,000	100.00	30,000,000	100.00	30,000,000		2016.02.08	44.82
2	日本	国債証券	第564回国庫 短期証券	30,000,000	99.99	29,999,970	99.99	29,999,970		2016.01.25	44.82

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨て
ているため、合計と一致しない場合があります。

ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	89.65
合計	89.65

【投資不動産物件】

バンクローン・ファンド(ヘッジなし)

該当事項はありません。

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

該当事項はありません。

（参考）日本短期公社債マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

該当事項はありません。

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

該当事項はありません。

（参考）日本短期公社債マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（平成25年 6月10日）	1,905,908,557	1,910,035,253	1.1546	1.1571
第2特定期間末（平成25年12月10日）	4,883,443,514	4,903,640,808	1.2089	1.2139
第3特定期間末（平成26年 6月10日）	6,688,486,961	6,716,875,805	1.1780	1.1830
第4特定期間末（平成26年12月10日）	9,080,905,484	9,115,136,431	1.3264	1.3314
第5特定期間末（平成27年 6月10日）	10,770,225,477	10,809,578,996	1.3684	1.3734
第6特定期間末（平成27年12月10日）	12,162,639,639	12,210,653,642	1.2666	1.2716
平成26年12月末日	9,425,201,484		1.3314	
平成27年 1月末日	9,078,699,425		1.3040	
2月末日	9,357,794,839		1.3232	
3月末日	9,566,445,632		1.3318	
4月末日	9,718,371,655		1.3229	
5月末日	10,353,576,452		1.3674	
6月末日	11,224,597,708		1.3437	

7月末日	11,582,109,598		1.3541
8月末日	11,526,220,861		1.3085
9月末日	11,720,493,372		1.2825
10月末日	11,764,458,157		1.2855
11月末日	12,248,042,046		1.2874
12月末日	12,126,471,931		1.2467

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（平成25年 6月10日）	4,223,993,287	4,232,361,705	1.0095	1.0115
第2特定期間末（平成25年12月10日）	6,620,008,327	6,633,120,283	1.0098	1.0118
第3特定期間末（平成26年 6月10日）	9,213,937,476	9,232,283,058	1.0045	1.0065
第4特定期間末（平成26年12月10日）	9,155,510,609	9,174,043,130	0.9880	0.9900
第5特定期間末（平成27年 6月10日）	8,680,179,255	8,697,743,074	0.9884	0.9904
第6特定期間末（平成27年12月10日）	7,605,085,534	7,621,193,352	0.9443	0.9463
平成26年12月末日	8,947,460,420		0.9828	
平成27年 1月末日	8,748,908,251		0.9823	
2月末日	8,596,052,096		0.9901	
3月末日	8,572,434,774		0.9909	
4月末日	8,247,857,757		0.9943	
5月末日	8,719,458,973		0.9919	
6月末日	8,574,759,038		0.9855	
7月末日	8,627,687,609		0.9820	
8月末日	8,457,064,447		0.9723	
9月末日	8,218,969,104		0.9632	
10月末日	8,015,617,834		0.9596	
11月末日	7,888,059,808		0.9487	
12月末日	7,056,135,653		0.9351	

【分配の推移】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	平成24年12月17日～平成25年 6月10日	0.0085
第2特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	0.0250
第3特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	0.0300
第4特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	0.0300
第5特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	0.0300

第6特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	0.0300
--------	-------------------------	--------

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	平成24年12月17日～平成25年 6月10日	0.0065
第2特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	0.0120
第3特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	0.0120
第4特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	0.0120
第5特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	0.0120
第6特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	0.0120

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

【収益率の推移】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

期	計算期間	収益率（％）
第1特定期間	平成24年12月17日～平成25年 6月10日	16.3
第2特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	6.9
第3特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	0.1
第4特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	15.1
第5特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	5.4
第6特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	5.2

(注)収益率は各特定期間における騰落率を表示しており、当該特定期間中の分配金合計額を加算して計算しています。

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

期	計算期間	収益率（％）
第1特定期間	平成24年12月17日～平成25年 6月10日	1.6
第2特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	1.2
第3特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	0.7
第4特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	0.4
第5特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	1.3
第6特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	3.2

(注)収益率は各特定期間における騰落率を表示しており、当該特定期間中の分配金合計額を加算して計算しています。

（４）【設定及び解約の実績】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1特定期間	平成24年12月17日～平成25年 6月10日	1,732,911,899	82,233,318
第2特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	2,554,140,139	165,359,758
第3特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	2,435,293,106	796,983,080
第4特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	2,766,656,408	1,598,235,868
第5特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	2,783,412,886	1,758,898,577
第6特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	3,086,852,715	1,354,755,931

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1特定期間	平成24年12月17日～平成25年 6月10日	4,233,813,475	49,604,119
第2特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	4,109,933,069	1,738,164,227
第3特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	6,343,146,522	3,726,333,708
第4特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	2,014,736,688	1,921,266,964
第5特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	1,077,575,659	1,561,926,622
第6特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	657,845,825	1,385,846,205

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

運用実績

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

2015年12月30日現在

「ヘッジなし」

<基準価額・純資産の推移> (2012年12月17日～2015年12月30日)



<分配の推移>

2015年12月	50円
2015年11月	50円
2015年10月	50円
2015年9月	50円
2015年8月	50円
直近1年累計	600円
設定来累計	1,535円

<主要な資産の状況>

組入状況

ファンド名	国・地域	通貨	純資産比率
イトンバスインターナショナル(ケイマンアイランド)プロテクトレイトインカムボンドフォリオクラス38シェアーズ	ケイマン諸島	米ドル	95.27%
日本短期公社債マザーファンド	日本	日本円	0.13%
合計			95.40%

<年間収益率の推移>

暦年ベース



「ヘッジあり」

<基準価額・純資産の推移> (2012年12月17日～2015年12月30日)



<分配の推移>

2015年12月	20円
2015年11月	20円
2015年10月	20円
2015年9月	20円
2015年8月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	665円

<主要な資産の状況>

組入状況

ファンド名	国・地域	通貨	純資産比率
イトンバスインターナショナル(ケイマンアイランド)プロテクトレイトインカムボンドフォリオクラス38シェアーズ	ケイマン諸島	米ドル	93.87%
日本短期公社債マザーファンド	日本	日本円	0.19%
合計			94.07%

<年間収益率の推移>

暦年ベース



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。換金時の費用・税金などは考慮していません。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を各ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。

※分配は1万口当たり・税引前の金額です。分配の推移は、将来の分配の水準を示唆・保証するものではありません。分配が行われない場合もあります。

※年間収益率は税引前の分配金を単純に合算して計算しています。なお、各ファンドにはベンチマークがありません。

※年間収益率は、2012年については設定時から12月末までの収益率を記載しています。

・当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

・表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。

・最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認ください。

運用実績

イートン・バンス・インターナショナル(ケイマン・アイランズ)フローティング・レート・インカム・ポートフォリオの組入上位10銘柄
(2015年12月31日現在)

銘柄名	比率
Avago Technologies Cayman Ltd.	1.28%
Asurion LLC	1.16%
Intelsat Jackson Holdings S.A.	1.08%
Transdigm, Inc.	0.92%
Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	0.90%
1011778 B.C. Unlimited Liability Company	0.90%
First Data Corporation	0.88%
Albertsons, LLC	0.84%
MacDermid, Inc.	0.84%
US Foods, Inc.	0.82%

※比率は、イートン・バンス・インターナショナル(ケイマン・アイランズ)フローティング・レート・インカム・ポートフォリオの時価総額を100%とした場合の割合で、小数第3位を四捨五入しています。

第3【ファンドの経理状況】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）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、第6期特定期間（平成27年6月11日から平成27年12月10日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【バンクローン・ファンド（ヘッジなし）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
預金	68,226,346	-
コール・ローン	629,082,582	475,426,443
投資証券	10,185,506,343	11,737,770,852
親投資信託受益証券	16,001,394	16,002,985
派生商品評価勘定	55,260	-
未収利息	859	692
流動資産合計	10,898,872,784	12,229,200,972
資産合計	10,898,872,784	12,229,200,972
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,425	-
未払金	37,338,000	-
未払収益分配金	39,353,519	48,014,003
未払解約金	42,120,099	6,753,050
未払受託者報酬	270,917	325,323
未払委託者報酬	9,482,145	11,386,336
その他未払費用	63,202	82,621
流動負債合計	128,647,307	66,561,333
負債合計	128,647,307	66,561,333
純資産の部		
元本等		
元本	7,870,703,837	9,602,800,621
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,899,521,640	2,559,839,018

	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
(分配準備積立金)	1,330,298,775	1,190,446,051
元本等合計	10,770,225,477	12,162,639,639
純資産合計	10,770,225,477	12,162,639,639
負債純資産合計	10,898,872,784	12,229,200,972

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第6期特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
営業収益		
受取配当金	177,970,496	217,643,120
受取利息	93,077	141,947
有価証券売買等損益	13,278,409	513,598,872
為替差損益	400,732,726	261,566,313
営業収益合計	592,074,708	557,380,118
営業費用		
受託者報酬	1,542,814	1,886,940
委託者報酬	53,998,365	66,042,900
その他費用	508,250	644,854
営業費用合計	56,049,429	68,574,694
営業利益	536,025,279	625,954,812
経常利益	536,025,279	625,954,812
当期純利益	536,025,279	625,954,812
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	3,932,356	5,267,378
期首剰余金又は期首欠損金()	2,234,715,956	2,899,521,640
剰余金増加額又は欠損金減少額	918,520,319	995,212,453
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	918,520,319	995,212,453
剰余金減少額又は欠損金増加額	566,000,433	443,460,398
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	566,000,433	443,460,398
分配金	219,807,125	270,747,243
期末剰余金又は期末欠損金()	2,899,521,640	2,559,839,018

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第6期特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。
----------------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 7,870,703,837口	1. 特定期間末日における受益権の総数 9,602,800,621口
2. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3684円 (1万口当たり純資産額) (13,684円)	2. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2666円 (1万口当たり純資産額) (12,666円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第5期特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第6期特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
分配金の計算過程	<p>第23期（自 平成26年12月11日 至 平成27年 1月13日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,043,217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）、信託約款に定める収益調整金（1,017,996,035円）及び分配準備積立金（1,120,893,764円）より分配対象収益は2,155,933,016円（1万口当たり3,060.85円）であり、うち35,217,678円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第24期（自 平成27年 1月14日 至 平成27年 2月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（25,640,663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）、信託約款に定める収益調整金（1,109,259,689円）及び分配準備積立金（1,068,067,215円）より分配対象収益は2,202,967,567円（1万口当たり3,102.04円）であり、うち35,508,159円（1万口当たり50円）を分配しております。</p>	<p>第29期（自 平成27年 6月11日 至 平成27年 7月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（20,364,041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）、信託約款に定める収益調整金（1,563,969,668円）及び分配準備積立金（1,305,787,220円）より分配対象収益は2,890,120,929円（1万口当たり3,345.71円）であり、うち43,191,148円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第30期（自 平成27年 7月11日 至 平成27年 8月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（34,304,840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）、信託約款に定める収益調整金（1,786,824,902円）及び分配準備積立金（1,234,714,328円）より分配対象収益は3,055,844,070円（1万口当たり3,552.06円）であり、うち43,014,806円（1万口当たり50円）を分配しております。</p>

<p>第25期（自 平成27年 2月11日 至 平成27年 3月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（27,171,501円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（184,019,187円）、信託約款に定める収益調整金（1,240,716,754円）及び分配準備積立金（1,021,552,063円）より分配対象収益は2,473,459,505円（1万口当たり3,506.37円）であり、うち35,270,573円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第26期（自 平成27年 3月11日 至 平成27年 4月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,496,087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）、信託約款に定める収益調整金（1,348,337,111円）及び分配準備積立金（1,170,823,874円）より分配対象収益は2,542,657,072円（1万口当たり3,399.21円）であり、うち37,400,558円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第27期（自 平成27年 4月11日 至 平成27年 5月11日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（19,559,309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）、信託約款に定める収益調整金（1,315,645,185円）及び分配準備積立金（1,123,021,551円）より分配対象収益は2,458,226,045円（1万口当たり3,316.83円）であり、うち37,056,638円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第28期（自 平成27年 5月12日 至 平成27年 6月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（29,962,508円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（223,003,025円）、信託約款に定める収益調整金（1,590,473,766円）及び分配準備積立金（1,095,435,860円）より分配対象収益は2,938,875,159円（1万口当たり3,733.91円）であり、うち39,353,519円（1万口当たり50円）を分配しております。</p>	<p>第31期（自 平成27年 8月11日 至 平成27年 9月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,523,628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）、信託約款に定める収益調整金（1,695,197,859円）及び分配準備積立金（1,207,059,598円）より分配対象収益は2,930,781,085円（1万口当たり3,256.25円）であり、うち45,002,148円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第32期（自 平成27年 9月11日 至 平成27年10月13日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,399,795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）、信託約款に定める収益調整金（1,720,919,120円）及び分配準備積立金（1,199,116,296円）より分配対象収益は2,937,435,211円（1万口当たり3,225.42円）であり、うち45,535,466円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第33期（自 平成27年10月14日 至 平成27年11月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（37,022,383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）、信託約款に定める収益調整金（1,735,155,693円）及び分配準備積立金（1,185,601,999円）より分配対象収益は2,957,780,075円（1万口当たり3,215.68円）であり、うち45,989,672円（1万口当たり50円）を分配しております。</p> <p>第34期（自 平成27年11月11日 至 平成27年12月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（30,159,428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）、信託約款に定める収益調整金（1,860,551,109円）及び分配準備積立金（1,179,492,224円）より分配対象収益は3,070,202,761円（1万口当たり3,197.17円）であり、うち48,014,003円（1万口当たり50円）を分配しております。</p>
---	---

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第5期特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第6期特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
----	---	---

1.金融商品に対する取組方針	<p>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、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。</p> <p>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
---------------------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法 投資証券 「（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。 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 派生商品評価勘定 「（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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 投資証券 「（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。 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	第5期特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第6期特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
期首元本額	6,846,189,528円	7,870,703,837円

期中追加設定元本額	2,783,412,886円	3,086,852,715円
期中一部解約元本額	1,758,898,577円	1,354,755,931円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資証券	51,219,423	147,548,594
親投資信託受益証券	0	0
合計	51,219,423	147,548,594

3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項 (通貨関連)

種類	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在				第6期特定期間末 平成27年12月10日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
買建	193,088,300	-	193,124,135	35,835	-	-	-	-
米ドル	193,088,300	-	193,124,135	35,835	-	-	-	-
合計	193,088,300	-	193,124,135	35,835	-	-	-	-

時価の算定方法

為替予約取引

1) 期末日に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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡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。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超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売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2)期末日に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、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
日本円	親投資信託受益証券	日本短期公社債マザーファンド	15,905,959	16,002,985	
日本円建小計			15,905,959	16,002,985	
米ドル	投資証券	イートン・パンス・インターナショナル(ケイマン・アイランズ)フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラス 3 \$ シェアーズ	10,233,810.118	96,607,167.51	
米ドル建小計			10,233,810.118	96,607,167.51 (11,737,770,852)	
合計				11,753,773,837 (11,737,770,852)	

(注)親投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、口数及び証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 1銘柄	96.5%	99.9%

(注1) 組入投資証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

（注2）有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

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。

【バンクローン・ファンド（ヘッジあり）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
預金	24,828,100	-
コール・ローン	842,764,805	293,535,674
投資証券	8,157,143,660	7,219,524,240
親投資信託受益証券	14,005,575	14,006,967
派生商品評価勘定	61,432	112,256,360
未収利息	1,151	427
流動資産合計	9,038,804,723	7,639,323,668
資産合計	9,038,804,723	7,639,323,668
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	429,500	-
未払金	318,654,078	-
未払収益分配金	17,563,819	16,107,818
未払解約金	13,736,525	10,576,296
未払受託者報酬	227,459	208,364
未払委託者報酬	7,961,024	7,292,742
その他未払費用	53,063	52,914
流動負債合計	358,625,468	34,238,134
負債合計	358,625,468	34,238,134
純資産の部		
元本等		
元本	8,781,909,773	8,053,909,393
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	101,730,518	448,823,859
（分配準備積立金）	83,572,651	80,685,473
元本等合計	8,680,179,255	7,605,085,534
純資産合計	8,680,179,255	7,605,085,534
負債純資産合計	9,038,804,723	7,639,323,668

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期特定期間		第6期特定期間	
	自	平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	自	平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
営業収益				
受取配当金		154,051,270		149,185,084
受取利息		96,160		111,301
有価証券売買等損益		17,744,479		354,587,881
為替差損益		16,504,552		20,218,178
営業収益合計		155,387,357		225,509,674
営業費用				
受託者報酬		1,400,485		1,345,619
委託者報酬		49,016,874		47,096,528
その他費用		475,943		513,099
営業費用合計		50,893,302		48,955,246
営業利益		104,494,055		274,464,920
経常利益		104,494,055		274,464,920
当期純利益		104,494,055		274,464,920
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		570,961		4,415,367
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		110,750,127		101,730,518
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,219,883		37,829,163
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		18,219,883		37,829,163
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,509,161		12,832,983
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,509,161		12,832,983
分配金		104,756,129		102,039,968
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		101,730,518		448,823,859

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第6期特定期間	
	自	平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。	
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。	

（貸借対照表に関する注記）

第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 8,781,909,773口	1. 特定期間末日における受益権の総数 8,053,909,393口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 101,730,518円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 448,823,859円
3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9884円 (1万口当たり純資産額) (9,884円)	3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9443円 (1万口当たり純資産額) (9,443円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第5期特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第6期特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
分配金の計算過程	<p>第23期（自 平成26年12月11日 至 平成27年 1月13日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（14,882,481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）、信託約款に定める収益調整金（17,867,210円）及び分配準備積立金（71,361,550円）より分配対象収益は104,111,241円（1万口当たり114.79円）であり、うち18,138,494円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第24期（自 平成27年 1月14日 至 平成27年 2月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（20,221,509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）、信託約款に定める収益調整金（14,850,813円）及び分配準備積立金（68,762,538円）より分配対象収益は103,834,860円（1万口当たり117.70円）であり、うち17,640,705円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第25期（自 平成27年 2月11日 至 平成27年 3月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,291,837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）、信託約款に定める収益調整金（13,347,827円）及び分配準備積立金（72,513,139円）より分配対象収益は109,152,803円（1万口当たり124.22円）であり、うち17,572,075円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>	<p>第29期（自 平成27年 6月11日 至 平成27年 7月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（13,775,389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）、信託約款に定める収益調整金（15,140,323円）及び分配準備積立金（80,109,782円）より分配対象収益は109,025,494円（1万口当たり125.64円）であり、うち17,353,381円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第30期（自 平成27年 7月11日 至 平成27年 8月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,864,915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）、信託約款に定める収益調整金（14,644,001円）及び分配準備積立金（77,999,224円）より分配対象収益は110,508,140円（1万口当たり126.07円）であり、うち17,528,824円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第31期（自 平成27年 8月11日 至 平成27年 9月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,890,442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）、信託約款に定める収益調整金（12,710,127円）及び分配準備積立金（79,213,088円）より分配対象収益は110,813,657円（1万口当たり127.89円）であり、うち17,327,258円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>

<p>第26期（自 平成27年 3月11日 至 平成27年 4月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（21,120,460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）、信託約款に定める収益調整金（11,409,599円）及び分配準備積立金（78,508,558円）より分配対象収益は111,038,617円（1万口当たり128.70円）であり、うち17,252,599円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第27期（自 平成27年 4月11日 至 平成27年 5月11日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,356,489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）、信託約款に定める収益調整金（9,820,200円）及び分配準備積立金（80,360,546円）より分配対象収益は108,537,235円（1万口当たり130.83円）であり、うち16,588,437円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第28期（自 平成27年 5月12日 至 平成27年 6月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（16,559,617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）、信託約款に定める収益調整金（15,451,389円）及び分配準備積立金（81,942,280円）より分配対象収益は113,953,286円（1万口当たり129.74円）であり、うち17,563,819円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>	<p>第32期（自 平成27年 9月11日 至 平成27年10月13日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,176,445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）、信託約款に定める収益調整金（11,457,948円）及び分配準備積立金（80,366,230円）より分配対象収益は104,000,623円（1万口当たり122.20円）であり、うち17,019,170円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第33期（自 平成27年10月14日 至 平成27年11月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（19,192,835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）、信託約款に定める収益調整金（9,679,466円）及び分配準備積立金（75,688,766円）より分配対象収益は104,561,067円（1万口当たり125.17円）であり、うち16,703,517円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第34期（自 平成27年11月11日 至 平成27年12月10日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,250,067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）、信託約款に定める収益調整金（7,791,930円）及び分配準備積立金（76,932,442円）より分配対象収益は102,974,439円（1万口当たり127.83円）であり、うち16,107,818円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>
--	---

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第5期特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第6期特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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、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。</p> <p>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左

2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
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>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
---------------------------	---------------------------

<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>投資証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に</p> <p>近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま</p> <p>す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>
---	---

（関連当事者との取引に関する注記）

	<p>第5期特定期間</p> <p>自 平成26年12月11日</p> <p>至 平成27年 6月10日</p>	<p>第6期特定期間</p> <p>自 平成27年 6月11日</p> <p>至 平成27年12月10日</p>
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
期首元本額	9,266,260,736円	8,781,909,773円
期中追加設定元本額	1,077,575,659円	657,845,825円
期中一部解約元本額	1,561,926,622円	1,385,846,205円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在	第6期特定期間末 平成27年12月10日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資証券	33,024,872	91,773,613
親投資信託受益証券	0	0
合計	33,024,872	91,773,613

3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項 (通貨関連)

種類	第5期特定期間末 平成27年 6月10日現在				第6期特定期間末 平成27年12月10日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	124,452,463	-	124,513,895	61,432	-	-	-	-
米ドル	124,452,463	-	124,513,895	61,432	-	-	-	-
売建	8,186,859,774	-	8,187,289,274	429,500	7,251,673,796	-	7,139,417,436	112,256,360
米ドル	8,186,859,774	-	8,187,289,274	429,500	7,251,673,796	-	7,139,417,436	112,256,360
合計	8,311,312,237	-	8,311,803,169	368,068	7,251,673,796	-	7,139,417,436	112,256,360

時価の算定方法

為替予約取引

1) 期末日に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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡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。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超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売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 期末日に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、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
日本円	親投資信託受益証券	日本短期公社債マザーファンド	13,922,043	14,006,967	
日本円建小計			13,922,043	14,006,967	
米ドル	投資証券	イートン・パンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラス 3 \$ シェアーズ	6,294,486.505	59,419,952.60	
米ドル建小計			6,294,486.505	59,419,952.60 (7,219,524,240)	
合計				7,233,531,207 (7,219,524,240)	

(注) 親投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、口数及び証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 1銘柄	94.9%	99.8%

(注1) 組入投資証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

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 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

（参考）

「バンクローン・ファンド（ヘッジなし）」及び「バンクローン・ファンド（ヘッジあり）」は、「イトン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラスI3 \$シェアーズ」投資証券及び「日本短期公社債マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、すべて「イトン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラスI3 \$シェアーズ」の投資証券であり、「親投資信託受益証券」は、すべて「日本短期公社債マザーファンド」の受益証券であります。

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

「イトン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラスI3 \$シェアーズ」は、「イトン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ」の個別クラスとなっております。

「イトン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ」は、ケイマンの法律に基づき設立された米ドル建外国投資法人であります。同ファンドの平成27年4月30日現在の財務書類は、米国で一般的に認められている監査規則に準拠して作成されておりますが、独立監査人の監査を受けておりません。

同ファンドの投資有価証券明細表、資産・負債計算書、損益計算書及び純資産変動計算書は、同ファンドの投資顧問会社兼管理事務代行会社であるイトン・バンス・マネジメントから入手した財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものであります。

(1) 投資有価証券明細表（無監査）

2015年4月30日現在（米ドル表示）

シニア変動利付有価証券 - 94.3%（1）

債務者	細目	額面（千 米ドル）	時価（米ド ル）
航空および軍需 - 2.1%			
DAE Aviation Holdings, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing November 2, 2018	1,452	1,460,606
Ducommun Incorporated	Term Loan, 4.75%, Maturing June 28, 2017	126	126,789
IAP Worldwide Services, Inc.	Revolving Loan, Maturing July 18, 2018 (2)	133	132,540
IAP Worldwide Services, Inc.	Term Loan - Second Lien, 8.00%, Maturing July 18, 2019 (3)	182	145,615
Silver II US Holdings, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing December 13, 2019	2,916	2,845,682
Standard Aero Limited	Term Loan, 5.00%, Maturing November 2, 2018	657	661,011
Transdigm, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing February 28, 2020	6,165	6,187,979
			11,560,222
航空輸送 - 0.3%			
Virgin America, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing April 4, 2019	1,725	1,577,512
			1,577,512

自動車 - 2.9%

自動車 - 2.9%			
Affinia Group			
Intermediate Holdings, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing April 27, 2020	1,037	1,039,122
Chrysler Group, LLC	Term Loan, 3.50%, Maturing May 24, 2017	3,673	3,684,225
Dayco Products, LLC	Term Loan, 5.25%, Maturing December 12, 2019	866	870,581
Federal-Mogul Holdings Corporation	Term Loan, 4.75%, Maturing April 15, 2021	3,474	3,473,316
Goodyear Tire & Rubber Company (The)	Term Loan - Second Lien, 4.75%, Maturing April 30, 2019	1,854	1,877,344
INA Beteiligungsgesellschaft GmbH	Term Loan, 4.25%, Maturing May 15, 2020	775	782,586
MPG Holdco I, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing October 20, 2021	1,990	2,000,064
TI Group Automotive Systems, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing July 2, 2021	695	696,921
Tower Automotive Holdings USA, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing April 23, 2020	902	905,788
Visteon Corporation	Term Loan, 3.50%, Maturing April 9, 2021	968	968,746
			16,298,693

飲料およびタバコ - 0.1%

Flavors Holdings, Inc.	Term Loan, 6.75%, Maturing April 3, 2020	585	567,450
			567,450

債務者	細目	額面（千 米ドル）	時価（米ド ル）
-----	----	--------------	-------------

ブローカー、ディーラーおよび投資会社 - 0.0%（4）

Astro AB Borrower, Inc.	Term Loan, Maturing April 30, 2022（2）	200	202,750
			202,750

建設およびデベロッパー - 1.7%

CPG International, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing September 30, 2020	468	465,828
Gates Global, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 5, 2021	1,219	1,221,596
Headwaters, Incorporated	Term Loan, 4.50%, Maturing March 24, 2022	125	125,937
Ply Gem Industries, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing February 1, 2021	990	990,000
Quikrete Holdings, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing September 28, 2020	1,678	1,684,980
RE/MAX International, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 31, 2020	1,443	1,439,970
Realogy Corporation	Term Loan, 3.75%, Maturing March 5, 2020	3,232	3,247,682
WireCo WorldGroup, Inc.	Term Loan, 6.00%, Maturing February 15, 2017	207	207,941
			9,383,934

ビジネス機器およびサービス - 9.0%

Acosta Holdco, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing September 26, 2021	2,711	2,745,267
---------------------	---	-------	-----------

Altisource Solutions S.a.r.l.	Term Loan, 4.50%, Maturing December 9, 2020	1,059	915,839
AVSC Holding Corp.	Term Loan, 4.50%, Maturing January 24, 2021	371	373,106
Brock Holdings III, Inc.	Term Loan, 6.00%, Maturing March 16, 2017	544	535,719
CCC Information Services, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing December 20, 2019	880	883,451
Ceridian, LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing September 15, 2020	469	468,733
ClientLogic Corporation	Term Loan, 7.53%, Maturing January 30, 2017	1,210	1,204,286
Corporate Capital Trust, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing May 15, 2019	817	817,240
Crossmark Holdings, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing December 20, 2019	1,326	1,233,618
Education Management, LLC	Term Loan, 5.50%, Maturing July 2, 2020	415	374,538
Education Management, LLC	Term Loan, 8.50%, (2.00% Cash, 6.50% PIK) Maturing July 2, 2020	704	565,391
EIG Investors Corp.	Term Loan, 5.00%, Maturing November 9, 2019	4,522	4,482,365
Emdeon Business Services, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing November 2, 2018	4,059	4,079,622

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
-----	----	--------------	-------------

ビジネス機器およびサービス - 9.0% (続き)

Expert Global Solutions, Inc.	Term Loan, 8.50%, Maturing April 3, 2018	398	399,184
Extreme Reach, Inc.	Term Loan, 6.75%, Maturing February 7, 2020	629	635,541
Garda World Security Corporation	Term Loan, 4.00%, Maturing November 6, 2020	347	346,891
Garda World Security Corporation	Term Loan, 4.00%, Maturing November 6, 2020	1,355	1,356,030
IG Investment Holdings, LLC	Term Loan, 6.00%, Maturing October 29, 2021	815	816,869
IMS Health Incorporated	Term Loan, 3.50%, Maturing March 17, 2021	2,904	2,910,054
Information Resources, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing September 30, 2020	960	966,073
ION Trading Technologies S.a.r.l.	Term Loan, 4.25%, Maturing June 10, 2021	971	970,588
KAR Auction Services, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing March 11, 2021	1,213	1,217,534
Kronos Incorporated	Term Loan, 4.50%, Maturing October 30, 2019	2,014	2,031,381
MCS AMS Sub-Holdings, LLC	Term Loan, 7.00%, Maturing October 15, 2019	430	420,396
Monitronics International, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing March 23, 2018	426	427,119
Monitronics International, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing April 2, 2022	550	553,438
National CineMedia, LLC	Term Loan, 2.94%, Maturing November 26, 2019	175	173,469

PGX Holdings, Inc. Quintiles	Term Loan, 6.25%, Maturing September 29, 2020	444	448,541
Transnational Corp. RCS Capital Corporation	Term Loan, 3.75%, Maturing June 8, 2018	4,329	4,345,194
ServiceMaster Company	Term Loan, 6.50%, Maturing April 29, 2019	890	880,297
SunGard Data Systems, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 1, 2021	1,940	1,948,124
TNS, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing March 8, 2020	4,380	4,413,781
TransUnion, LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing February 14, 2020	425	427,893
Travelport Finance (Luxembourg) S.a.r.l.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 9, 2021	3,663	3,683,604
WASH Multifamily Laundry Systems, LLC	Term Loan, 5.75%, Maturing September 2, 2021	973	983,884
		985	986,771
			50,021,831

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
ケーブルおよび衛星放送 - 0.8%			
Bragg Communications Incorporated	Term Loan, 3.50%, Maturing February 28, 2018	536	536,383
Crown Media Holdings, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing July 14, 2018	678	675,081
MCC Iowa, LLC	Term Loan, 3.25%, Maturing January 29, 2021	590	588,026
MCC Iowa, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing June 30, 2021	720	722,486
Sterling Entertainment Enterprises, LLC	Term Loan, 2.94%, Maturing December 28, 2017	456	441,180
Virgin Media Bristol, LLC	Term Loan, 3.50%, Maturing June 7, 2020	1,282	1,284,779
			4,247,935

化学およびプラスチック - 4.7%

Allnex (Luxembourg) & Cy S.C.A.	Term Loan, 4.50%, Maturing October 3, 2019	485	487,766
Allnex USA, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing October 3, 2019	252	253,078
Aruba Investments, Inc.	Term Loan, 5.25%, Maturing February 2, 2022	200	202,120
Axalta Coating Systems US Holdings, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing February 1, 2020	2,740	2,750,794
AZ Chem US, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing June 12, 2021	529	532,913
ColourOz Investment 1, GmbH	Term Loan, 4.75%, Maturing September 7, 2021	131	131,789
ColourOz Investment 1, GmbH	Term Loan, 4.75%, Maturing September 7, 2021	790	797,215
ECO Services Operations, LLC	Term Loan, 4.75%, Maturing December 4, 2021	299	302,243
Emerald Performance Materials, LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing August 1, 2021	423	425,870
Gemini HDPE, LLC	Term Loan, 4.75%, Maturing August 7, 2021	372	374,982

Huntsman International, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing August 12, 2021	1,596	1,605,975
Ineos US Finance, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing May 4, 2018	4,599	4,613,138
Ineos US Finance, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing March 31, 2022	425	428,036
Kronos Worldwide, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing February 18, 2020	272	274,675
MacDermid, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing June 7, 2020	1,889	1,910,067
MacDermid, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing June 7, 2020	399	403,560
Minerals Technologies, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing May 7, 2021	1,648	1,657,535
Omnova Solutions, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing May 31, 2018	718	719,247
Orion Engineered Carbons GmbH	Term Loan, 5.00%, Maturing July 25, 2021	448	452,787
OXEA Finance, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing January 15, 2020	419	411,037

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
-----	----	--------------	-------------

化学およびプラスチック - 4.7% (続き)

Solenis International L.P.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 31, 2021	249	249,644
Sonneborn Refined Products B.V.	Term Loan, 5.50%, Maturing December 10, 2020	52	52,827
Sonneborn, LLC	Term Loan, 5.50%, Maturing December 10, 2020	297	299,353
Tata Chemicals North America, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing August 7, 2020	884	884,803
Trinseo Materials Operating S.C.A.	Term Loan, Maturing October 13, 2021 (2)	200	201,125
Tronox Pigments (Netherlands) B.V.	Term Loan, 4.25%, Maturing March 19, 2020	3,408	3,423,794
Univar, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing June 30, 2017	2,012	2,022,776
			25,869,149

複合 - 0.2%

RGIS Services, LLC	Term Loan, 5.50%, Maturing October 18, 2017	1,514	1,427,176
			1,427,176

コンテナおよびガラス製品 - 1.5%

Berry Plastics Holding Corporation	Term Loan, 3.50%, Maturing February 8, 2020	2,845	2,850,576
Hillex Poly Co., LLC	Term Loan, 6.00%, Maturing December 5, 2021	1,122	1,137,618
Libbey Glass, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing April 9, 2021	372	373,467
Pelican Products, Inc.	Term Loan, 5.25%, Maturing April 10, 2020	608	608,442
Reynolds Group Holdings, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing December 1, 2018	2,295	2,319,599
TricorBraun, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing May 3, 2018	792	791,901
			8,081,603

化粧品/トイレタリー - 0.9%

Prestige Brands, Inc.	Term Loan, 4.13%, Maturing January 31, 2019	501	503,681
Prestige Brands, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing September 3, 2021	474	477,167
Revlon Consumer Products Corporation	Term Loan, 4.00%, Maturing October 8, 2019	1,867	1,876,379

Sun Products Corporation (The)		Term Loan, 5.50%, Maturing March 23, 2020	2,208	2,133,731
			4,990,958	
債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)	
ドラッグ - 2.9%				
Alkermes, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing September 18, 2019	2,126	2,133,470	
AMAG Pharmaceuticals, Inc.	Term Loan, 7.25%, Maturing November 12, 2020	439	443,137	
Concordia Healthcare Corp.	Term Loan, 4.75%, Maturing March 30, 2022	150	151,375	
DPx Holdings B.V.	Term Loan, 4.25%, Maturing March 11, 2021	2,754	2,761,646	
Endo Luxembourg Finance Company I S.a.r.l.	Term Loan, 3.25%, Maturing March 1, 2021	347	347,222	
Horizon Pharma Holdings USA, Inc.	Term Loan, Maturing April 22, 2021 (2)	150	151,266	
Mallinckrodt International Finance S.A.	Term Loan, 3.50%, Maturing March 19, 2021	920	923,333	
Par Pharmaceutical Companies, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing September 30, 2019	2,118	2,122,784	
Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing February 13, 2019	2,654	2,666,607	
Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing December 11, 2019	2,135	2,144,234	
Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 1, 2022	2,275	2,293,628	
			16,138,702	
環境サービスおよび機器 - 0.5%				
ADS Waste Holdings, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing October 9, 2019	2,337	2,335,602	
EnergySolutions, LLC	Term Loan, 6.75%, Maturing May 29, 2020	657	660,056	
			2,995,658	
電子機器 / 電器 - 10.4%				
Answers Corporation	Term Loan, 6.25%, Maturing October 3, 2021	873	838,991	
Applied Systems, Inc.	Term Loan, 4.27%, Maturing January 25, 2021	720	723,781	
Avago Technologies Cayman Ltd.	Term Loan, 3.75%, Maturing May 6, 2021	4,944	4,973,409	
Blue Coat Systems, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing May 31, 2019	1,474	1,476,335	
Blue Coat Systems, Inc.	Term Loan - Second Lien, 9.50%, Maturing June 28, 2020	1,375	1,405,937	

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
電子機器 / 電器 - 10.4% (続き)			
Campaign Monitor			
Finance Pty Limited	Term Loan, 6.25%, Maturing March 18, 2021	644	642,696
Carros Finance			
Luxembourg S.a.r.l.	Term Loan, 4.50%, Maturing September 30, 2021	274	277,387
Cinedigm Digital			
Funding I, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing February 28, 2018	203	204,131
CompuCom Systems, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing May 11, 2020	1,853	1,740,306
Dell, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing April 29, 2020	5,946	5,976,672
Eagle Parent, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing May 16, 2018	3,202	3,220,434
Entegris, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing April 30, 2021	355	355,863
Excelitas Technologies			
Corp.	Term Loan, 6.00%, Maturing October 31, 2020	1,579	1,590,617
Eze Castle Software,			
Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 6, 2020	293	294,093
Freescale			
Semiconductor, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing February 28, 2020	877	881,529
Go Daddy Operating			
Company, LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing May 13, 2021	2,257	2,275,586
Hyland Software, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing February 19, 2021	887	893,098
Infor (US), Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing June 3, 2020	4,236	4,232,110
Lattice Semiconductor			
Corporation	Term Loan, 5.25%, Maturing March 10, 2021	350	353,063
M/A-COM Technology			
Solutions Holdings,			
Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing May 7, 2021	447	451,091
MA FinanceCo., LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing November 20, 2019	850	852,833
MA FinanceCo., LLC	Term Loan, 5.25%, Maturing November 19, 2021	750	754,486
Magic Newco, LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing December 12, 2018	2,700	2,717,729
MH Sub I, LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing July 8, 2021	695	699,499
Microsemi Corporation	Term Loan, 3.25%, Maturing February 19, 2020	537	539,706
Orbotech, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing August 6, 2020	373	373,349
Renaissance Learning,			
Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing April 9, 2021	619	614,109
Rocket Software, Inc.	Term Loan, 5.75%, Maturing February 8, 2018	726	730,248
RP Crown Parent, LLC	Term Loan, 6.00%, Maturing December 21, 2018	3,613	3,524,815
SGS Cayman L.P.	Term Loan, 6.00%, Maturing April 23, 2021	155	156,454
Shield Finance Co.			
S.a.r.l.	Term Loan, 5.00%, Maturing January 29, 2021	594	598,950
Sirius Computer			
Solutions, Inc.	Term Loan, 7.00%, Maturing December 7, 2018	547	553,825
SkillSoft Corporation	Term Loan, 5.75%, Maturing April 28, 2021	1,886	1,880,868
Smart Technologies ULC	Term Loan, 10.50%, Maturing January 31, 2018	422	423,670
Sophia L.P.	Term Loan, 4.00%, Maturing July 19, 2018	1,684	1,692,196
SunEdison			
Semiconductor B.V.	Term Loan, 6.50%, Maturing May 27, 2019	695	696,487
SurveyMonkey.com, LLC	Term Loan, 5.50%, Maturing February 5, 2019	240	242,563

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
電子機器 / 電器 - 10.4% (続き)			
Sutherland Global			
Services, Inc.	Term Loan, 6.00%, Maturing April 23, 2021	666	672,117
Sybil Software, LLC	Term Loan, 4.75%, Maturing March 20, 2020	784	791,098
Vantiv, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing June 13, 2021	616	619,836
Vertafore, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing October 3, 2019	4,115	4,134,358
Wall Street Systems			
Delaware, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing April 30, 2021	817	818,799
Websense, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing June 25, 2020	614	615,513
		57,510,637	

金融仲介 - 4.2%			
Armor Holding II, LLC	Term Loan, 5.75%, Maturing June 26, 2020	433	431,964
Citco Funding, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing June 29, 2018	1,575	1,584,119
Clipper Acquisitions			
Corp.	Term Loan, 3.00%, Maturing February 6, 2020	1,173	1,168,751
First Data Corporation	Term Loan, 3.68%, Maturing March 24, 2017	1,000	1,003,125
First Data Corporation	Term Loan, 3.68%, Maturing March 24, 2018	2,879	2,889,095
First Data Corporation	Term Loan, 3.68%, Maturing September 24, 2018	1,775	1,780,362
Grosvenor Capital			
Management Holdings,			
LLP	Term Loan, 3.75%, Maturing January 4, 2021	1,528	1,526,241
Guggenheim Partners,			
LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing July 22, 2020	3,500	3,523,788
Hamilton Lane			
Advisors, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing February 28, 2018	190	190,902
Harbourvest Partners,			
LLC	Term Loan, 3.25%, Maturing February 4, 2021	491	490,645
Medley, LLC	Term Loan, 6.50%, Maturing June 15, 2019	410	410,227
MIP Delaware, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing March 9, 2020	1,085	1,091,369
Moneygram			
International, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing March 27, 2020	718	677,033
NXT Capital, Inc.	Term Loan, 6.25%, Maturing September 4, 2018	99	99,490
NXT Capital, Inc.	Term Loan, 6.25%, Maturing September 4, 2018	566	569,207
Ocwen Financial			
Corporation	Term Loan, 5.00%, Maturing February 15, 2018	2,143	2,126,050
Starwood Property			
Trust, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing April 17, 2020	787	786,217
Walter Investment			
Management Corp.	Term Loan, 4.75%, Maturing December 19, 2020	3,099	2,977,361
		23,325,946	

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
食料品 - 3.0%			
AdvancePierre Foods,			
Inc.	Term Loan, 5.75%, Maturing July 10, 2017	2,979	3,006,231

American Seafoods Group, LLC	Term Loan, 6.50%, Maturing March 18, 2018	816	784,185
Blue Buffalo Company Ltd.	Term Loan, 3.75%, Maturing August 8, 2019	1,905	1,910,008
Charger OpCo B.V.	Term Loan, 3.50%, Maturing July 23, 2021	1,750	1,750,000
Del Monte Foods, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing February 18, 2021	1,111	1,068,352
Diamond Foods, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing August 20, 2018	1,654	1,660,265
Dole Food Company, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing November 1, 2018	3,029	3,054,094
High Liner Foods Incorporated	Term Loan, 4.25%, Maturing April 24, 2021	792	793,980
JBS USA Holdings, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing September 18, 2020	1,207	1,214,920
Onex Wizard US Acquisition, Inc.	Term Loan, 5.25%, Maturing March 13, 2022	825	834,926
Post Holdings, Inc.	Term Loan, Maturing June 2, 2021 (2)	350	351,781
			16,428,742

食料サービス - 3.0%

1011778 B.C. Unlimited Liability Company			
Liability Company	Term Loan, 4.50%, Maturing December 12, 2021	5,129	5,197,547
ARG IH Corporation	Term Loan, 4.75%, Maturing November 15, 2020	217	218,945
Centerplate, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing November 26, 2019	1,274	1,267,506
Landry's, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 24, 2018	1,463	1,471,394
NPC International, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing December 28, 2018	1,036	1,034,268
P.F. Chang's China Bistro, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 2, 2019	564	554,523
Seminole Hard Rock Entertainment, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing May 14, 2020	172	171,973
US Foods, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing March 31, 2019	4,815	4,838,557
Weight Watchers International, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 2, 2020	3,626	1,939,910
			16,694,623

食料/ドラッグ小売 - 2.0%

Albertson's Holdings, LLC			
LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing August 25, 2019	1,825	1,841,783
Albertson's, LLC	Term Loan, 5.38%, Maturing March 21, 2019	3,150	3,178,841
General Nutrition Centers, Inc.			
Centers, Inc.	Term Loan, 3.25%, Maturing March 4, 2019	2,644	2,638,090
New Albertson's, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing June 27, 2021	846	850,639
Rite Aid Corporation	Term Loan - Second Lien, 5.75%, Maturing August 21, 2020	200	201,958
Supervalu, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing March 21, 2019	2,356	2,369,194
			11,080,505

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
-----	----	--------------	-------------

ヘルスケア - 8.2%

Acadia Healthcare Company, Inc.			
Company, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing February 11, 2022	175	176,799
Akorn, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing April 16, 2021	920	923,826

Alere, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing June 30, 2017	1,007	1,014,771
Alliance Healthcare Services, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing June 3, 2019	2,693	2,687,562
Amneal Pharmaceuticals, LLC	Term Loan, 4.51%, Maturing November 1, 2019	150	150,938
Amneal Pharmaceuticals, LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing November 1, 2019	442	445,455
Ardent Medical Services, Inc.	Term Loan, 6.75%, Maturing July 2, 2018	3,261	3,276,211
Aspen Dental Management, Inc.	Term Loan, Maturing April 10, 2022 (2)	200	201,375
ATI Holdings, Inc.	Term Loan, 5.25%, Maturing December 20, 2019	1,157	1,165,584
Auris Luxembourg III S.a.r.l.	Term Loan, 5.50%, Maturing January 17, 2022	75	75,891
BioScrip, Inc.	Term Loan, 6.50%, Maturing July 31, 2020	376	374,653
BioScrip, Inc.	Term Loan, 6.50%, Maturing July 31, 2020	627	624,422
CareCore National, LLC	Term Loan, 5.50%, Maturing March 5, 2021	348	352,159
CeramTec Acquisition Corporation	Term Loan, 4.25%, Maturing August 30, 2020	94	94,172
CHG Healthcare Services, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing November 19, 2019	1,712	1,723,145
Community Health Systems, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing January 27, 2021	2,120	2,134,835
Convatec, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing December 22, 2016	139	139,926
CPI Buyer, LLC	Term Loan, 5.50%, Maturing August 18, 2021	821	822,928
DJO Finance, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing September 15, 2017	1,293	1,298,636
Envision Healthcare Corporation	Term Loan, 4.00%, Maturing May 25, 2018	3,420	3,443,164
Faenza Acquisition GmbH	Term Loan, 4.25%, Maturing August 30, 2020	277	278,734
Faenza Acquisition GmbH	Term Loan, 4.25%, Maturing August 30, 2020	934	940,196
Iasis Healthcare, LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing May 3, 2018	978	982,876
Impax Laboratories, Inc.	Term Loan, 5.50%, Maturing December 2, 2020	600	607,500
Indivior Finance S.a.r.l.	Term Loan, 7.00%, Maturing December 19, 2019	642	612,991
inVentiv Health, Inc.	Term Loan, 7.75%, Maturing May 15, 2018	1,056	1,061,765
inVentiv Health, Inc.	Term Loan, 7.75%, Maturing May 15, 2018	1,350	1,350,655
Kinetic Concepts, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing May 4, 2018	2,289	2,308,159

額面(千 時価(米ド
米ドル) ル)

債務者

細目

ヘルスケア - 8.2% (続き)

MedAssets, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing December 13, 2019	131	131,248
Millennium Laboratories, Inc.	Term Loan, 5.25%, Maturing April 16, 2021	1,911	1,580,990
MMM Holdings, Inc.	Term Loan, 9.75%, Maturing December 12, 2017	410	344,547
MSO of Puerto Rico, Inc.	Term Loan, 9.75%, Maturing December 12, 2017	298	250,487

National Mentor Holdings, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing January 31, 2021	470	472,748
Onex Carestream Finance L.P.	Term Loan, 5.00%, Maturing June 7, 2019	1,742	1,760,771
Opal Acquisition, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing November 27, 2020	1,407	1,410,957
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing June 30, 2021	1,213	1,212,350
Pharmaceutical Product Development, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing December 5, 2018	1,089	1,095,916
PRA Holdings, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing September 23, 2020	802	808,765
Radnet Management, Inc.	Term Loan, Maturing October 10, 2018 (2)	809	812,961
RegionalCare Hospital Partners, Inc.	Term Loan, 6.00%, Maturing April 19, 2019	671	673,407
Sage Products Holdings III, LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing December 13, 2019	1,541	1,563,313
Select Medical Corporation	Term Loan, 3.75%, Maturing June 1, 2018	700	702,196
Steward Health Care System, LLC	Term Loan, 6.75%, Maturing April 12, 2020	688	686,460
Tecomet, Inc.	Term Loan, 5.75%, Maturing December 5, 2021	848	841,516
Truven Health Analytics, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing June 6, 2019	536	538,303
U.S.Renal Care, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 3, 2019	1,528	1,538,178
			45,694,441

家財 - 0.3%

Interline Brands, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing March 17, 2021	1,683	1,686,682
			1,686,682

工業機器 - 3.4%

Alliance Laundry Systems, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing December 10, 2018	543	546,291
Apex Tool Group, LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing January 31, 2020	2,713	2,716,332
CPM Holdings, Inc.	Term Loan, Maturing April 11, 2022 (2)	175	177,187
Delachaux S.A.	Term Loan, 5.25%, Maturing October 28, 2021	450	453,094
Doosan Infracore International, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing May 28, 2021	893	903,846

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
-----	----	--------------	-------------

工業機器 - 3.4% (続き)

Filtration Group Corporation	Term Loan, 4.25%, Maturing November 21, 2020	247	248,932
Gardner Denver, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 30, 2020	1,404	1,372,658
Husky Injection Molding Systems Ltd.	Term Loan, 4.25%, Maturing June 30, 2021	1,226	1,234,465
Milacron, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing March 28, 2020	2,831	2,831,363
NN, Inc.	Term Loan, 6.00%, Maturing August 27, 2021	535	539,276
Paladin Brands Holding, Inc.	Term Loan, 6.76%, Maturing August 16, 2019	509	511,514

Rexnord, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing August 21, 2020	1,938	1,947,460
Signode Industrial Group US, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing May 1, 2021	1,075	1,077,241
STS Operating, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing February 12, 2021	272	271,910
Tank Holding Corp.	Term Loan, 5.25%, Maturing March 16, 2022	2,579	2,604,182
Unifrax Corporation	Term Loan, 4.25%, Maturing November 28, 2018	1,309	1,309,161
Virtuoso US, LLC	Term Loan, 4.75%, Maturing February 11, 2021	371	373,415
			19,118,327

保険 - 3.0%

Alliant Holdings I, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing December 20, 2019	701	704,149
AmWINS Group, LLC	Term Loan, 5.25%, Maturing September 6, 2019	954	963,920
Asurion, LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing May 24, 2019	4,985	5,023,977
Asurion, LLC	Term Loan - Second Lien, 8.50%, Maturing March 3, 2021	925	938,875
CGSC of Delaware Holding Corporation	Term Loan, 5.00%, Maturing April 16, 2020	1,501	1,427,612
CNO Financial Group, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing September 28, 2018	1,412	1,414,436
Cunningham Lindsey U.S., Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing December 10, 2019	915	903,507
Hub International Limited	Term Loan, 4.00%, Maturing October 2, 2020	2,514	2,509,420
USI, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing December 27, 2019	2,547	2,554,677
			16,440,573

レジャー用品 / 活動 / 映画 - 3.4%

AMC Entertainment, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing April 30, 2020	4,444	4,464,833
Bombardier Recreational Products, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing January 30, 2019	2,508	2,525,242

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
-----	----	--------------	-------------

レジャー用品 / 活動 / 映画 - 3.4% (続き)

Dave & Buster's, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 25, 2020	122	122,636
Emerald Expositions Holding, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing June 17, 2020	707	715,241
Fender Musical Instruments Corporation	Term Loan, 5.75%, Maturing April 3, 2019	187	187,583
Kasima, LLC	Term Loan, 3.25%, Maturing May 17, 2021	503	502,941
Live Nation Entertainment, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing August 17, 2020	2,354	2,364,289
Nord Anglia Education Finance, LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing March 31, 2021	744	746,236
Sabre, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing February 19, 2019	556	559,582
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	Term Loan, 3.00%, Maturing May 14, 2020	1,349	1,325,799

Sonifi Solutions, Inc.	Term Loan, 6.75%, (1.00% Cash, 5.75% PIK), Maturing March 28, 2018 (3)	633	40,518
SRAM, LLC	Term Loan, 4.02%, Maturing April 10, 2020	1,568	1,570,679
Town Sports International, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing November 15, 2020	970	835,262
WMG Acquisition Corp.	Term Loan, 3.75%, Maturing July 1, 2020	1,490	1,483,698
Zuffa, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing February 25, 2020	1,411	1,397,248
			18,841,787

宿泊およびカジノ - 3.2%

Amaya Holdings B.V.	Term Loan, 5.00%, Maturing August 1, 2021	2,214	2,224,254
Boyd Gaming Corporation	Term Loan, 4.00%, Maturing August 14, 2020	1,272	1,281,822
Caesars Entertainment Operating Company	Term Loan, 0.00%, Maturing March 1, 2017 (5)	1,132	1,046,311
Four Seasons Holdings, Inc.	Term Loan, 3.50%, Maturing June 27, 2020	539	541,209
Golden Nugget, Inc.	Term Loan, 5.50%, Maturing November 21, 2019	411	414,527
Golden Nugget, Inc.	Term Loan, 5.50%, Maturing November 21, 2019	958	967,231
Hilton Worldwide Finance, LLC	Term Loan, 3.50%, Maturing October 26, 2020	4,651	4,673,650
MGM Resorts International	Term Loan, 3.50%, Maturing December 20, 2019	2,644	2,649,120
RHP Hotel Properties L.P.	Term Loan, 3.75%, Maturing January 15, 2021	521	525,134
Scientific Games International, Inc.	Term Loan, 6.00%, Maturing October 18, 2020	2,197	2,221,906
Scientific Games International, Inc.	Term Loan, 6.00%, Maturing October 1, 2021	698	706,154
Tropicana Entertainment, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing November 27, 2020	320	321,325
			17,572,643

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
非鉄金属/鉱物 - 1.6%			
Alpha Natural Resources, LLC	Term Loan, 3.50%, Maturing May 22, 2020	2,450	1,715,000
Arch Coal, Inc.	Term Loan, 6.25%, Maturing May 16, 2018	3,419	2,561,396
Dynacast International, LLC	Term Loan, 5.25%, Maturing January 28, 2022	400	405,875
Fairmount Minerals Ltd.	Term Loan, 4.50%, Maturing September 5, 2019	1,527	1,460,336
Murray Energy Corporation	Term Loan, 7.00%, Maturing April 7, 2017	175	176,604
Murray Energy Corporation	Term Loan, 7.50%, Maturing March 19, 2021	1,150	1,141,375
Oxbow Carbon, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing July 19, 2019	342	339,336
Walter Energy, Inc.	Term Loan, 7.25%, Maturing April 2, 2018	1,735	1,106,366
			8,906,288

石油およびガス - 4.5%

Ameriforge Group, Inc. Bronco Midstream Funding, LLC	Term Loan, 5.00%, Maturing December 19, 2019	3,191	2,804,438
CITGO Holding, Inc. CITGO Petroleum Corporation	Term Loan, 5.00%, Maturing August 15, 2020	2,875	2,803,219
Crestwood Holdings, LLC	Term Loan, 9.50%, Maturing May 12, 2018	1,297	1,310,123
Drillships Ocean Ventures, Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing July 29, 2021	796	799,732
Energy Transfer Equity L.P.	Term Loan, 7.00%, Maturing June 19, 2019	361	352,338
Energy Transfer Equity L.P.	Term Loan, 5.50%, Maturing July 25, 2021	844	735,360
Fieldwood Energy, LLC	Term Loan, 3.25%, Maturing December 2, 2019	1,450	1,446,504
Fieldwood Energy, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing December 2, 2019	275	276,719
Floatel International Ltd.	Term Loan, 3.88%, Maturing September 28, 2018	813	794,829
MEG Energy Corp.	Term Loan - Second Lien, 8.38%, Maturing September 30, 2020	525	410,812
Obsidian Holdings, LLC Paragon Offshore Finance Company	Term Loan, 6.00%, Maturing June 27, 2020	866	654,019
Samson Investment Company	Term Loan, 3.75%, Maturing March 31, 2020	3,523	3,487,810
Seadrill Partners Finco, LLC	Term Loan, 6.75%, Maturing November 2, 2015	107	106,650
Seventy Seven Operating, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing July 18, 2021	672	509,176
	Term Loan - Second Lien, 5.00%, Maturing September 25, 2018	2,275	1,103,375
	Term Loan, 4.00%, Maturing February 21, 2021	3,285	2,697,484
	Term Loan, 3.75%, Maturing June 25, 2021	422	399,667

額面（千 時価（米ド
米ドル） ル）

債務者

細目

石油およびガス - 4.5%（続き）

Sheridan Investment Partners II L.P.	Term Loan, 4.25%, Maturing December 16, 2020	30	27,305
Sheridan Investment Partners II L.P.	Term Loan, 4.25%, Maturing December 16, 2020	80	73,214
Sheridan Investment Partners II L.P.	Term Loan, 4.25%, Maturing December 16, 2020	576	526,314
Sheridan Production Partners I, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing October 1, 2019	150	145,057
Sheridan Production Partners I, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing October 1, 2019	246	237,484
Sheridan Production Partners I, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing October 1, 2019	1,857	1,792,224
Southcross Holdings Borrower L.P.	Term Loan, 6.00%, Maturing August 4, 2021	323	317,724
Tallgrass Operations, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing November 13, 2018	62	61,371
Tervita Corporation	Term Loan, 6.25%, Maturing May 15, 2018	943	899,236

24,772,184

出版 - 2.2%

Ascend Learning, LLC	Term Loan, 6.00%, Maturing July 31, 2019	1,136	1,145,562
Getty Images, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing October 18, 2019	3,461	3,013,338
Interactive Data Corporation	Term Loan, 4.75%, Maturing May 2, 2021	1,414	1,425,583
Laureate Education, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing June 15, 2018	2,468	2,400,505
McGraw-Hill Global Education Holdings, LLC	Term Loan, 5.75%, Maturing March 22, 2019	398	401,557
Merrill Communications, LLC	Term Loan, 5.75%, Maturing March 8, 2018	346	349,210
Multi Packaging Solutions, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing September 30, 2020	272	271,966
Penton Media, Inc.	Term Loan, 5.50%, Maturing October 3, 2019	447	451,255
ProQuest, LLC	Term Loan, 5.25%, Maturing October 24, 2021	549	552,740
Springer Science+Business Media Deutschland GmbH	Term Loan, 4.75%, Maturing August 14, 2020	1,825	1,834,708
Springer Science+Business Media Deutschland GmbH	Term Loan, Maturing August 14, 2020 (2)	200	201,188
Targa Resources Corp.	Term Loan, 5.75%, Maturing February 25, 2022	253	256,263
			12,303,875

債務者	細目	額面 (千 米ドル)	時価 (米ド ル)
ラジオおよびテレビ - 2.3%			
ALM Media Holdings, Inc.	Term Loan, 5.50%, Maturing July 31, 2020	346	337,641
AP NMT Acquisition B.V.	Term Loan, 6.75%, Maturing August 13, 2021	348	347,706
Block Communications, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing November 7, 2021	174	175,812
Clear Channel Communications, Inc.	Term Loan, 7.68%, Maturing July 30, 2019	1,500	1,459,453
Cumulus Media Holdings, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing December 23, 2020	3,026	2,988,630
Entercom Radio, LLC	Term Loan, 4.00%, Maturing November 23, 2018	1,355	1,361,198
Gray Television, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing June 10, 2021	200	201,298
Media General, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing July 31, 2020	1,098	1,107,472
Mission Broadcasting, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing October 1, 2020	369	370,237
Nexstar Broadcasting, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing October 1, 2020	419	419,855
TWCC Holding Corp.	Term Loan, 3.50%, Maturing February 13, 2017	1,901	1,887,347
TWCC Holding Corp.	Term Loan - Second Lien, 7.00%, Maturing June 26, 2020	500	473,750
Univision Communications, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing March 1, 2020	1,433	1,434,788
			12,565,187

小売（食料およびドラッグを除く） - 5.6%

99 Cents Only Stores	Term Loan, 4.50%, Maturing January 11, 2019	4,005	4,015,806
Bass Pro Group, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing November 20, 2019	1,127	1,135,101
CDW, LLC	Term Loan, 3.25%, Maturing April 29, 2020	956	955,988
David's Bridal, Inc.	Term Loan, 5.25%, Maturing October 11, 2019	1,075	1,036,584
Dollar Tree, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing March 9, 2022	1,875	1,901,801
Evergreen Acqco 1 L.P.	Term Loan, 5.00%, Maturing July 9, 2019	732	721,456
Harbor Freight Tools USA, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing July 26, 2019	810	816,912
Jo-Ann Stores, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing March 16, 2018	2,263	2,262,941
Men's Wearhouse, Inc. (The)	Term Loan, 4.50%, Maturing June 18, 2021	821	830,776
Michaels Stores, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing January 28, 2020	1,533	1,540,276
Michaels Stores, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing January 28, 2020	794	799,459
Neiman Marcus Group, Inc. (The)	Term Loan, 4.25%, Maturing October 25, 2020	2,958	2,969,528
Party City Holdings, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing July 27, 2019	1,908	1,915,259
Petco Animal Supplies, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing November 24, 2017	877	881,613
PetSmart, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing March 11, 2022	3,075	3,116,897

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
-----	----	--------------	-------------

小売(食料およびドラッグを除く) - 5.6%(続き)

PFS Holding Corporation	Term Loan, 4.50%, Maturing January 31, 2021	693	623,700
Pier 1 Imports (U.S.), Inc.	Term Loan, 4.50%, Maturing April 30, 2021	471	470,259
Rent-A-Center, Inc.	Term Loan, 3.75%, Maturing March 19, 2021	446	441,045
Spin Holdco, Inc.	Term Loan, 4.25%, Maturing November 14, 2019	2,636	2,644,498
Toys 'R' Us Property Company I, LLC	Term Loan, 6.00%, Maturing August 21, 2019	1,601	1,514,591
Wilton Brands, LLC	Term Loan, 7.50%, Maturing August 30, 2018	531	510,166
			31,104,656

鉄鋼 - 1.6%

FMG Resources (August 2006) Pty. Ltd.	Term Loan, 3.75%, Maturing June 30, 2019	5,693	5,156,502
JMC Steel Group, Inc.	Term Loan, 4.75%, Maturing April 1, 2017	2,268	2,267,296
Neenah Foundry Company	Term Loan, 6.75%, Maturing April 26, 2017	1,492	1,477,507
Patriot Coal Corporation	Term Loan, 9.00%, Maturing December 15, 2018 (3)	420	230,450
			9,131,755

陸上輸送 - 0.4%

Stena International S.a.r.l.	Term Loan, 4.00%, Maturing March 3, 2021	1,386	1,270,356
Swift Transportation Co., LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing June 9, 2021	941	946,085
			2,216,441

通信 - 2.9%

CWC Cayman Finance Limited	Term Loan, 5.50%, Maturing April 28, 2017	300	300,938
Intelsat Jackson Holdings S.A.	Term Loan, 3.75%, Maturing June 30, 2019	6,600	6,606,600
IPC Systems, Inc.	Term Loan, 5.50%, Maturing August 6, 2021	1,100	1,102,407
Mitel US Holdings, Inc.	Term Loan, 5.00%, Maturing March 31, 2022	475	479,354
Syniverse Holdings, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 23, 2019	624	606,340
Syniverse Holdings, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 23, 2019	2,472	2,402,747
Telesat Canada	Term Loan, 3.50%, Maturing March 28, 2019	2,339	2,346,071
Ziggo Financing Partnership	Term Loan, 3.50%, Maturing January 15, 2022	477	477,655
Ziggo Financing Partnership	Term Loan, 3.50%, Maturing January 15, 2022	740	741,218
Ziggo Financing Partnership	Term Loan, 3.50%, Maturing January 15, 2022	784	785,571
			15,848,901

債務者	細目	額面(千 米ドル)	時価(米ド ル)
公益 - 1.5%			
Calpine Construction Finance Company L.P.	Term Loan, 3.00%, Maturing May 3, 2020	663	660,783
Calpine Construction Finance Company L.P.	Term Loan, 3.25%, Maturing January 31, 2022	764	762,745
Calpine Corporation	Term Loan, 4.00%, Maturing April 1, 2018	505	508,826
Calpine Corporation	Term Loan, 4.00%, Maturing October 30, 2020	296	297,986
Dynegy Holdings, Inc.	Term Loan, 4.00%, Maturing April 23, 2020	1,347	1,354,551
EFS Cogen Holdings I, LLC	Term Loan, 3.75%, Maturing December 17, 2020	447	449,454
Electrical Components International, Inc.	Term Loan, 5.75%, Maturing May 28, 2021	323	325,114
Energy Future Intermediate Holding Co., LLC	DIP Loan, 4.25%, Maturing June 19, 2016	1,375	1,384,739
La Frontera Generation, LLC	Term Loan, 4.50%, Maturing September 30, 2020	362	363,825
Lonestar Generation, LLC	Term Loan, 5.25%, Maturing February 20, 2021	423	421,545
Longview Power, LLC	Term Loan, 7.00%, Maturing April 13, 2021	175	177,406
PowerTeam Services, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing May 6, 2020	9	9,350
PowerTeam Services, LLC	Term Loan, 4.25%, Maturing May 6, 2020	175	174,594
TPF II Power, LLC	Term Loan, 5.50%, Maturing October 2, 2021	1,047	1,066,687
WTG Holdings III Corp.	Term Loan, 4.75%, Maturing January 15, 2021	346	348,433
			8,306,038

シニア変動利付有価証券合計
(認識された原価: 531,849,073米ドル) 522,913,804

普通株式 - 0.3%

銘柄名	数量	時価(米ドル)
-----	----	---------

航空および軍需 - 0.0% (4)

IAP Worldwide Services, LLC (3) (6) (7)	24	25,861	
		25,861	
自動車 - 0.1%			
Dayco Products, LLC (7)	9,586	357,078	
		357,078	
ビジネス機器およびサービス - 0.0% (4)			
Education Management Corp. (3) (6) (7)	4,977,534	134,393	
		134,393	
	銘柄名	数量	時価(米ドル)
食料サービス - 0.0% (4)			
Buffets Restaurants Holdings, Inc. (3) (6) (7)	18,253	7,484	
		7,484	
出版 - 0.2%			
MediaNews Group, Inc. (3) (6) (7)	33,396	1,285,732	
		1,285,732	
普通株式合計 (認識された原価: 1,065,435米ドル)			
		1,810,548	
転換優先株式 - 0.1%			
	銘柄名	数量	時価(米ドル)
ビジネス機器およびサービス - 0.1%			
Education Management Corp., Series A-1, 7.50% (6) (7)	5,538	363,662	
転換優先株式合計 (認識された原価: 390,853米ドル)			
		363,662	
短期投資証券 - 4.0%			
	細目	数量(千米ドル)	時価(米ドル)
Eaton Vance Cash Reserves Fund, LLC, 0.17% (8)		22,099	22,098,762
短期投資証券合計 (認識された原価: 22,098,762米ドル)			
			22,098,762
投資合計 - 98.7% (認識された原価: 555,404,123米ドル)			
			547,186,776
純投資 - 98.7% (認識された原価: 555,404,123米ドル)			
			547,186,776
負債控除後その他の資産 - 1.3%			
			7,148,997
純資産 - 100.0%			
			554,335,773

投資有価証券明細表のそれぞれの投資カテゴリーに表示されているパーセンテージは純資産を基にしています。

DIP - 占有債務継続者 (Debtor In Possession) のことであり、一般的にDIPローンとは破産法を申請した企業が一時的な運転資金融資として発行するローンのことです。

PIK - ペイメント・イン・カインド (Payment In Kind) 債のことであり、利払いが現金ではなく、既存の債務に対して発生する追加的債務の形式で行われる債務のことです。

は新光投信にて追記

- (1) シニア変動利付商品 (シニアローン) は、余剰のキャッシュフローから繰上返済が要求されることや、債務者に自身の選択で返済を認めることがあります。債務者が返済する程度は、契約上の要求もしくは債務者の選択によるものであり、正確に予測することはできません。結果として、実際の残存期間は記載された規定の満期より短くなる場合があります。ただし、シニアローンの予想平均残存期間は概ね2年から4年程度となっています。規定の利率は、シニアローンファシリティの契約全ての加重平均利率を表し、存在する場合は、一時借入ローン契約に係る契約費用を含みます。一般的にシニアローンの利率は、日次、月次、四半期毎、あるいは半期毎に、基礎となる貸出利率にプレミアムを加算することにより再算定されます。これらの基礎となる貸出金利は、第一にロンドン・インターバンク・オファード・レート (LIBOR) であり、第二に、単一もしくは多数の主要な米国銀行によって提示されるプライム・レート (Prime Rate) や譲渡性預金証書 (CD) のレート、もしくは営利を目的とした貸し手により使用されるその他の基礎となる貸出利率です。
- (2) 当該シニアローンは、2015年4月30日以降に、受渡しされ利率が決定される予定です。
- (3) 開示を目的とした公正価値測定では、当該証券はレベル3に分類されます。レベル3とは米国会計基準における3段階の公正価値評価法による価格で、市場での価格は観察不可能だが、市場関係者による最善の情報を仮定とした価格に相当します。
- (4) 合計は、0.05%未満です。
- (5) 現在、発行体は利息支払いに関してデフォルト状態にあります。
- (6) 無利息証券です。
- (7) 当該証券は、シニアローンの再構築に関連して取得されており、転売時に制限を受けることがあります。
- (8) イートン・パンスのポートフォリオが利用可能な関連投資会社であり、高格付けの米ドル建てマネー・マーケット投資証券に投資を行うファンドです。表示の利回りは、2015年4月30日時点の7日間の年率換算利回りです。

(2) 資産・負債計算書 (無監査)

(米ドル表示)

資産	2015年4月30日現在
関連当事者以外に係る投資 - 評価額 (認識された原価: 533,305,361米ドル)	525,088,014
関連当事者に係る投資 - 評価額 (認識された原価: 22,098,762米ドル)	22,098,762
現金	2,549,680
未収利息	1,845,247
関連当事者に係る投資における未収利息	2,836
売却済投資に係る未収金	3,513,675
売却済ファンド投資証券に係る未収金	2,427,605
前払費用	75,256
資産合計	557,601,075

負債

購入済投資に係る未払金	1,775,790
償還済ファンド投資証券に係る未払金	83,674
未払分配金	1,018,015
関連当事者に係る未払金:	

投資顧問会社報酬	233,405
未払費用	154,418
負債合計	3,265,302
純資産	554,335,773

純資産の源泉

資本：	
参加型投資証券 - 発行済投資証券1口当たり額面1米ドル	55,888,810
追加の払込資本	507,830,260
累積実現損失純額	(1,569,609)
累積未分配投資収益純額	403,659
未実現損失純額	(8,217,347)
合計	554,335,773

クラスI3 \$ シェアーズ

純資産	150,548,989
参加型投資証券発行済口数	15,124,533
1口当たり純資産価額、発行価格および償還価格 (純資産 ÷ 参加型投資証券発行済口数)	9.95

(3) 損益計算書(無監査)

(米ドル表示)

投資収益	2015年4月30日に終了する6ヵ月間
利息およびその他の収益	13,643,855
関連当事者に係る投資から割り当てられる収益	11,001
関連当事者に係る投資から割り当てられる費用	(1,179)
投資収益合計	13,653,677

費用

投資顧問会社報酬	1,536,107
保管銀行報酬	111,157
名義書換および分配支払代理人報酬	108,262
法的および会計サービス	61,757
印刷費用および送料	8,785
雑費	85,852
費用合計	1,911,920
控除 -	
保管銀行報酬の減額	39
費用減額合計	39

純費用	1,911,881
-----	-----------

純投資収益	11,741,796
-------	------------

実現および未実現利益(損失)

実現純利益(損失) -	
投資取引	(3,282,225)
関連当事者に係る投資から割り当てられる投資取引	18
実現純損失	(3,282,207)
未実現利益(損失)変動額 -	
投資	3,033,590
未実現利益(損失)純変動額	3,033,590

実現および未実現損失純額	(248,617)
--------------	-------------

営業による純資産の純増加額	11,493,179
---------------	------------

(4)純資産変動計算書
(米ドル表示)

2015年4月30日に終了する6ヵ月間

純資産の増加(減少)	(無監査)
------------	-------

営業によるもの -

純投資収益	11,741,796
-------	------------

投資取引による実現純損失	(3,282,207)
--------------	---------------

投資による未実現利益(損失)純変動額	3,033,590
--------------------	-----------

営業による純資産の純増加額	11,493,179
---------------	------------

投資証券保有者への分配額合計	(11,809,494)
----------------	----------------

参加型投資証券取引による純資産の純減少額	(138,477,208)
----------------------	-----------------

純資産の純減少額	(138,793,523)
----------	-----------------

純資産額

期首時点	693,129,296
------	-------------

期末時点	554,335,773
------	-------------

純資産に含まれる累積未分配投資収益純額

期末時点	403,659
------	---------

日本短期公社債マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	平成27年 6月10日現在	平成27年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,117,362	5,919,146
国債証券	69,999,790	59,999,922
未収利息	8	8
流動資産合計	76,117,160	65,919,076
資産合計	76,117,160	65,919,076
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,600,318	-
流動負債合計	1,600,318	-
負債合計	1,600,318	-
純資産の部		
元本等		
元本	74,070,713	65,522,499
剰余金		
剰余金又は欠損金()	446,129	396,577
元本等合計	74,516,842	65,919,076
純資産合計	74,516,842	65,919,076
負債純資産合計	76,117,160	65,919,076

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用いたしません。）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 6月10日現在		平成27年12月10日現在	
1. 計算日における受益権の総数	74,070,713口	1. 計算日における受益権の総数	65,522,499口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額		2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0060円	1口当たり純資産額	1.0061円
(1万口当たり純資産額)	(10,060円)	(1万口当たり純資産額)	(10,061円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10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、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。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左

3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成27年 6月10日現在	平成27年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法 国債証券 「（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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成27年 6月10日現在	平成27年12月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	60,859,299円	74,070,713円
期中追加設定元本額	35,685,889円	5,367,795円
期中一部解約元本額	22,474,475円	13,916,009円
同期末における元本の内訳		
みずほ・ブラックロック グローバル農業関連株ファンド	20,178,493円	10,239,123円
新光豪ドル・ボンド・オープン（目標払出し型）Aコース	1,494,173円	1,494,173円
新光豪ドル・ボンド・オープン（目標払出し型）Bコース	1,494,173円	1,494,173円
短期ハイイールド債券ファンド（ヘッジあり）	995,620円	995,620円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	15,905,959円	15,905,959円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）	13,922,043円	13,922,043円
新光バンクローン・ファンド・ネオ（円ヘッジ型）	5,069,672円	5,069,672円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし/年1回決算型）	1,093,509円	1,093,509円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり/年1回決算型）	99,473円	99,473円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3,976,144円	3,976,144円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	994,036円	994,036円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	497,018円	497,018円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号	695,826円	695,826円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号	99,404円	99,404円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	397,615円	397,615円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	99,404円	99,404円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	99,404円	99,404円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	- 円	994,036円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	- 円	397,615円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	- 円	497,018円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	- 円	497,018円

バンクローン・ファンド・ネオ（円ヘッジ型） 2014-07	994,234円	- 円
バンクローン・ファンド・ネオ（円ヘッジ型） 2014-08	994,135円	- 円
バンクローン・ファンド・ネオ（円ヘッジ型） 2014-09	1,988,270円	- 円
新光バンクローン・ファンド（円ヘッジ型）2 015-05	2,982,108円	2,982,108円
新光バンクローン・ファンド（円ヘッジ型）2 015-09	- 円	2,982,108円
合計	74,070,713円	65,522,499円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成27年 6月10日現在	平成27年12月10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	70	12
合計	70	12

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第557回国庫短期証券	30,000,000	29,999,952	
	第564回国庫短期証券	30,000,000	29,999,970	
合計		60,000,000	59,999,922	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

（平成27年12月30日現在）

資産総額	12,167,957,597円
負債総額	41,485,666円
純資産総額（ - ）	12,126,471,931円
発行済口数	9,726,851,864口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2467円
（1万口当たり純資産額）	（12,467円）

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

資産総額	7,097,569,224円
負債総額	41,433,571円
純資産総額（ - ）	7,056,135,653円
発行済口数	7,545,764,096口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9351円
（1万口当たり純資産額）	（9,351円）

（参考）日本短期公社債マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産総額	66,919,640円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	66,919,640円
発行済口数	66,516,436口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0061円
（1万口当たり純資産額）	（10,061円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

a．資本金の額（平成27年12月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株
直近5カ年における主な資本金の額の増減	該当事項はありません。

b．委託会社の機構

(イ) 株主総会において、15名以内の取締役が選任されます。

取締役の選任は、発行済株式総数のうち議決権のある株式数の3分の1以上に当たる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、就任後1年内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。

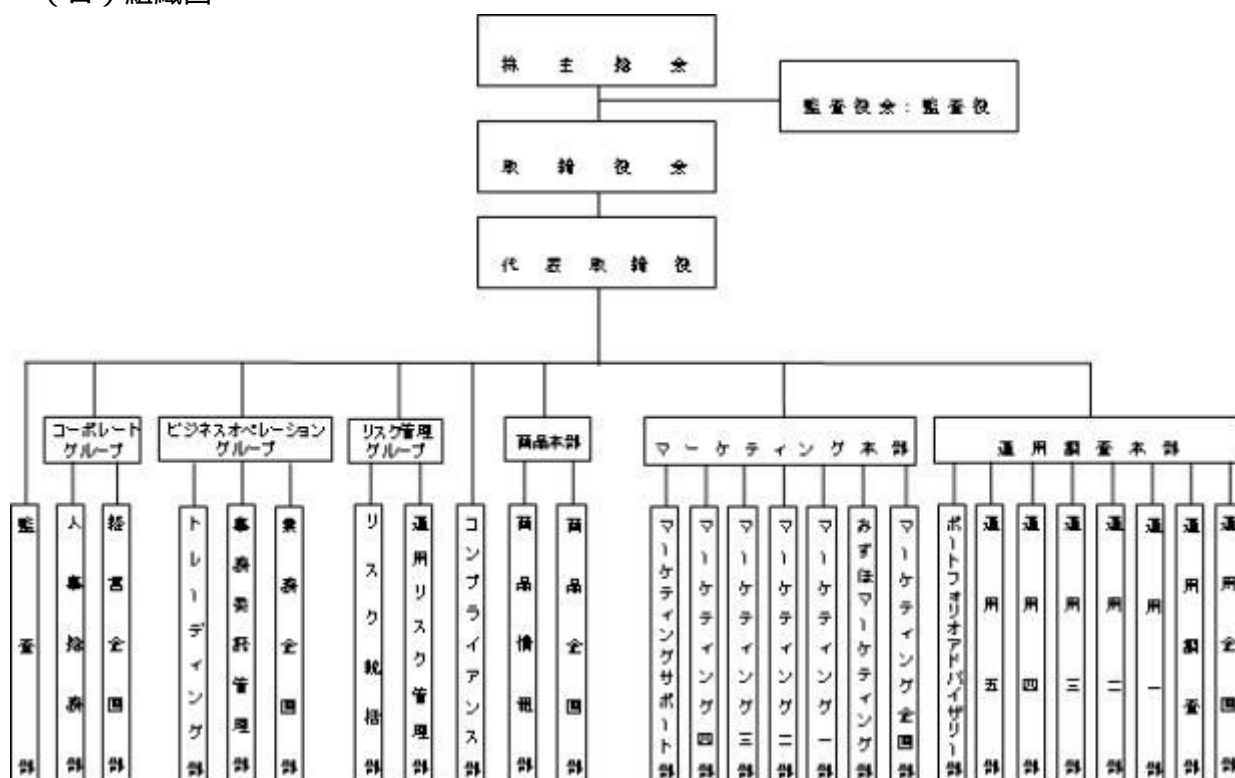
取締役会の決議により、取締役の中から取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

取締役会の決議をもって代表取締役3名以内を決定します。

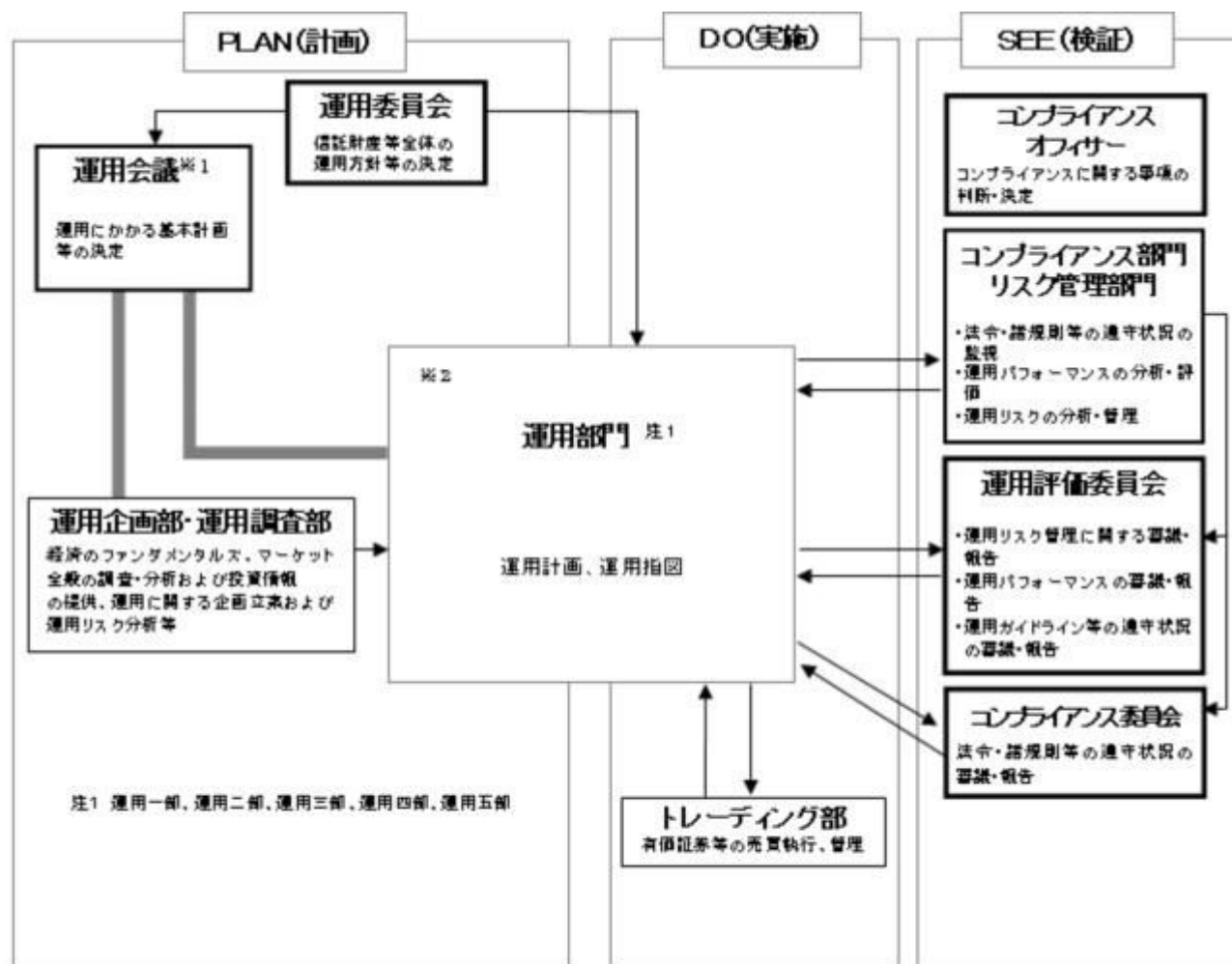
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

取締役会は、法令または定款に定めある事項のほか、当会社の重要な業務執行に関する事項を決定します。

(ロ) 組織図



(八) 投資運用の意思決定機構



実線の矢印は情報の流れを示します。

※1 運用会議は運用企画部・運用調査部、運用部門(運用一部～五部)で構成されます。

※2 運用部門において、運用計画および運用指回の承認は各々の上位職者が行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。
(平成27年12月30日現在)

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	332	4,334,906
株式投資信託（合計）	304	3,539,661
単位型	62	226,442
追加型	242	3,313,218
公社債投資信託（合計）	28	795,245
単位型	1	2,488
追加型	27	792,756

3【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）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。

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条および第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8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第55期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

1．財務諸表

(1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,492,111	13,427,042
有価証券	3,291,156	3,200,000
貯蔵品	5,188	5,117
立替金	15,778	23,184
前払金	38,614	64,821
前払費用	16,530	18,242
未収入金	-	872
未収委託者報酬	2,654,090	3,187,770
未収運用受託報酬	117,049	99,054
未収収益	6,509	6,338
繰延税金資産	283,616	372,215
流動資産合計	19,920,646	20,404,659
固定資産		
有形固定資産		

建物(純額)	2	12,380	2	12,687
構築物(純額)	2	1,650	2	1,444
器具・備品(純額)	2	99,960	2	86,688
リース資産(純額)	2	340		-
有形固定資産合計		114,332		100,820
無形固定資産				
電話加入権		91		91
ソフトウェア		74,851		85,517
ソフトウェア仮勘定		11,885		669
無形固定資産合計		86,827		86,278
投資その他の資産				
投資有価証券		3,213,218		5,101,854
関係会社株式		77,100		77,100
長期差入保証金		124,152		124,246
長期繰延税金資産		63,925		-
前払年金費用		374,562		396,211
その他		6,632		6,632
投資その他の資産合計		3,859,590		5,706,044
固定資産合計		4,060,749		5,893,143
資産合計		23,981,396		26,297,802

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		21,303		17,893
リース債務		810		345
未払金				
未払収益分配金		177		160
未払償還金		10,100		5,083
未払手数料	1	1,296,830	1	1,558,682
その他未払金		513,148		952,018
未払金合計		1,820,257		2,515,945
未払費用		548,430		722,806
未払法人税等		1,462,380		1,222,883
賞与引当金		362,800		451,000
役員賞与引当金		44,200		66,000
外国税支払損失引当金		-		184,111
訴訟損失引当金		-		30,000
流動負債合計		4,260,181		5,210,985
固定負債				
繰延税金負債		-		89,752
長期リース債務		345		-

退職給付引当金	172,959	155,806
役員退職慰労引当金	31,708	39,333
執行役員退職慰労引当金	102,083	63,916
固定負債合計	307,096	348,809
負債合計	4,567,278	5,559,794
純資産の部		
株主資本		
資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	2,889,165	3,981,245
利益剰余金合計	12,149,658	13,241,738
自己株式	72,415	72,415
株主資本合計	19,363,242	20,455,322
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	50,874	282,685
評価・換算差額等合計	50,874	282,685
純資産合計	19,414,117	20,738,008
負債純資産合計	23,981,396	26,297,802

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)		(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		29,107,010		35,876,795
運用受託報酬		261,777		238,412
営業収益合計		29,368,787		36,115,207
営業費用				
支払手数料	1	15,428,327	1	18,252,669
広告宣伝費		336,593		456,430
公告費		2,919		548
調査費				
調査費		339,210		623,792
委託調査費		4,188,805		5,966,340
図書費		4,862		5,254

調査費合計	4,532,878	6,595,388
委託計算費	1,151,067	1,352,318
営業雑経費		
通信費	37,016	32,335
印刷費	160,606	103,093
協会費	14,992	18,150
諸会費	3,153	3,300
その他	27,521	41,594
営業雑経費合計	243,290	198,475
営業費用合計	21,695,077	26,855,830
一般管理費		
給料		
役員報酬	89,886	96,445
給料・手当	1,326,658	1,368,552
賞与	332,688	336,076
給料合計	1,749,233	1,801,073
交際費	9,349	11,426
寄付金	3,066	3,198
旅費交通費	78,321	100,386
租税公課	65,510	68,508
不動産賃借料	205,792	206,753
賞与引当金繰入	362,800	451,000
役員賞与引当金繰入	44,200	66,000
役員退職慰労引当金繰入	39,756	24,930
退職給付費用	182,850	191,900
減価償却費	63,615	70,676
諸経費	585,445	573,824
一般管理費合計	3,389,942	3,569,678
営業利益	4,283,768	5,689,698

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	143,049	163,006
有価証券利息	6,052	3,853
受取利息	14,495	10,741
時効成立分配金・償還金	4,450	5,080
雑益	20,588	487
営業外収益合計	188,635	183,170
営業外費用		
支払利息	59	26

時効成立後支払分配金・償還金	1,557	3,083
雑損	8,673	3,261
営業外費用合計	10,290	6,371
経常利益	4,462,113	5,866,496
特別利益		
投資有価証券売却益	158,386	68,179
特別利益合計	158,386	68,179
特別損失		
固定資産除却損	3,210	3,177
ゴルフ会員権売却損	2,795	-
投資有価証券売却損	42,388	54,613
投資有価証券評価損	10,974	10,952
外国税支払損失引当金繰入額	-	184,111
訴訟損失引当金繰入額	-	30,000
その他特別損失	-	22,227
特別損失合計	59,368	305,082
税引前当期純利益	4,561,131	5,629,593
法人税、住民税及び事業税	1,905,519	2,111,379
法人税等調整額	113,958	66,999
法人税等合計	1,791,560	2,044,380
当期純利益	2,769,571	3,585,212

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月 1日 至 平成26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	
		資本 準備金	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	4,524,300	2,761,700	360,493	10,000,000	1,559,003
当期変動額					
別途積立金取崩				1,100,000	1,100,000
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					2,769,571
自己株式の取得					
自己株式の処分					
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	1,100,000	1,330,161

当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
-------	-----------	-----------	---------	-----------	-----------

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	利益剰余金合計				
当期首残高	11,919,497	72,415	19,133,081	106,625	19,239,706
当期変動額					
別途積立金取崩			-		-
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	2,769,571		2,769,571		2,769,571
自己株式の取得			-		-
自己株式の処分			-		-
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				55,750	55,750
当期変動額合計	230,161	-	230,161	55,750	174,410
当期末残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117

当事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27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		
		資本準備金	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	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による 累積的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した 当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
別途積立金取崩					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
自己株式の取得					
自己株式の処分					
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	利益剰余金合計				
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
別途積立金取崩			-		-
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
自己株式の取得			-		-
自己株式の処分			-		-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期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、総平均法により算定）

時価のないもの

総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（リース資産を除く）

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

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り償却しております。

（3）リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

（2）役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

（3）外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

（4）訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

（5）退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

（6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（会計方針の変更）

（退職給付に関する会計基準等の適用）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲

げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の算定方法を退職給付の支払見込期間ごとに設定された複数の割引率を使用する方法に変更しました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の前払年金費用が69,164千円増加、退職給付引当金が2,738千円減少し、利益剰余金が46,276千円増加しております。なお、当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払手数料	760,018千円	777,631千円

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額（減損損失累計額を含む）の額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	599,157千円	573,602千円

（損益計算書関係）

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
支払手数料	8,738,779千円	9,189,399千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31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	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	-	1,823,250

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

3. 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25年12月19日 臨時株主総会	普通 株式	2,539,409	1,400	平成25年11月15日	平成25年12月20日
-----------------------	----------	-----------	-------	-------------	-------------

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31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	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	-	1,823,250

2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

3．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26年12月24日 臨時株主総会	普通 株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

(リース取引関係)

ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

(1)リース資産の内容

有形固定資産

主として、投信システム設備としてのサーバー、ネットワーク機器他（器具備品）であります。

(2)リース資産の減価償却方法

重要な会計方針の「2．固定資産の減価償却の方法（3）リース資産」に記載のとおりであります。

(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、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常の取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行っております。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主に其他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管

理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,492,111	13,492,111	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	6,305,322	6,305,322	-
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	2,654,090	-

当事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

(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

(1) 現金及び預金

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。

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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

(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	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注) 3 . 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,491,981	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有 価証券 その他有価証券	3,291,156	380,080	1,261,941	269,692
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	-	-	-

当事業年度（平成27年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有 価証券 その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

(有価証券関係)

1 . 関連会社株式

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2 . その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)

貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,920,996	1,709,935	211,061
	小計	1,920,996	1,709,935	211,061
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	4,384,326	4,516,340	132,014
	小計	4,384,326	4,516,340	132,014
合計		6,305,322	6,226,275	79,047

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）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。

当事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）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. 売却したその他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)

(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	1,209,919	158,386	42,388
合計	1,209,919	158,386	42,388

当事業年度（平成27年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,974千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について10,952千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,281,738	1,424,739
会計方針の変更による累積的影響額	-	71,902
会計方針の変更を反映した期首残高	1,281,738	1,352,836
勤務費用	80,449	90,967
利息費用	19,226	9,476
数理計算上の差異の発生額	91,561	31,927
退職給付の支払額	48,235	73,269

過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,424,739	1,348,083

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
年金資産の期首残高	1,018,974	1,157,054
期待運用収益	20,379	23,141
数理計算上の差異の発生額	70,810	108,961
事業主からの拠出額	78,919	78,464
退職給付の支払額	32,029	38,450
年金資産の期末残高	1,157,054	1,329,170

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

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,187,071	1,111,797
年金資産	1,157,054	1,329,170
	30,017	217,373
非積立型制度の退職給付債務	237,668	236,285
未積立退職給付債務	267,685	18,912
未認識数理計算上の差異	496,048	270,020
未認識過去勤務費用	26,759	10,703
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	201,603	240,404
退職給付引当金	172,959	155,806
前払年金費用	374,562	396,211
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	201,603	240,404

(4) 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	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用(注1)	110,782	119,135
利息費用	19,226	9,476
期待運用収益	20,379	23,141
数理計算上の差異の費用処理額	72,344	85,138
過去勤務費用の費用処理額	16,055	16,055
確定給付制度に係る退職給付費用	165,917	174,553

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額（前事業年度30,333千円、当事業年度28,168千円）については「(1)勤務費

用」に含めて記載しております。

(5)年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	41.3%	39.4%
債券	25.6%	27.3%
共同運用資産	18.3%	21.0%
生命保険一般勘定	11.2%	10.6%
現金及び預金	3.3%	1.4%
合計	100%	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.0720% ~ 1.625%
長期期待運用収益率	2.0%	2.0%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

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16,933千円 当事業年度17,347千円であります。

(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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
--	-----------------------	-----------------------

繰延税金資産		
賞与引当金	145,054千円	170,920千円
減価償却超過額	1,076	896
退職給付引当金	98,025	70,882
役員退職慰労引当金	11,300	12,688
投資有価証券評価損	12,705	15,033
非上場株式評価損	28,430	25,733
未払事業税	103,536	90,342
外国税支払損失引当金	-	60,867
訴訟損失引当金	-	9,918
その他	109,079	87,621
繰延税金資産小計	509,208	544,905
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	509,208	544,905
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	28,172	134,624
前払年金費用	133,494	127,817
繰延税金負債合計	161,666	262,442
繰延税金資産の純額	347,542	282,463

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	283,616千円	372,215千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	63,925	-
固定負債 - 長期繰延税金負債	-	89,752

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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については、繰延税金資産及び繰延税金負債を計算する法定実効税率の変更等を行っております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が19,637千円減少し、その他有価証券評価差額金が14,105千円、法人税等調整額が33,742千円、それぞれ増加しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）及び

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）及び

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、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は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、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

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31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

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

関連当事者情報

1．関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金又は出 資金（千円）	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)

親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,738,779	未払手数料	760,018
-----	-----------	---------	-------------	---------	-----------------------------	-----------------------------	--------------------------------	-----------	-------	---------

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	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(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	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(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロバティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,003	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払 ハウジングサービス料支払	105,424 16,824	その他未払金 その他未払金	8,030 1,472

							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,230
							IT関連業務支援	4,145	その他未払金	1,648

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	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（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

(注) 1. 上記(ア)～(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	10,703円18銭	11,433円05銭
1株当たり当期純利益金額	1,526円89銭	1,976円56銭

（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。

（注）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25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益金額（千円）	2,769,571	3,585,212
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）	2,769,571	3,585,212
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

2．中間財務諸表

（1）中間貸借対照表

（単位：千円）

当中間会計期間 （平成27年9月30日）	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	15,954,811
有価証券	3,640,120
貯蔵品	6,357
未収委託者報酬	3,690,798
未収運用受託報酬	99,281
繰延税金資産	348,837
その他	242,660
流動資産合計	23,982,867
固定資産	
有形固定資産	
建物（純額）	11,617
構築物（純額）	1,354
器具・備品（純額）	76,976
有形固定資産合計	1 89,948

無形固定資産	
ソフトウェア	76,808
ソフトウェア仮勘定	12,744
その他	91
無形固定資産合計	89,644
投資その他の資産	
投資有価証券	2,763,859
長期繰延税金資産	989
前払年金費用	387,565
その他	129,929
投資その他の資産合計	3,282,343
固定資産合計	3,461,936
資産合計	27,444,803

(単位：千円)

当中間会計期間

(平成27年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金

未払収益分配金	155
未払償還金	4,607
未払手数料	1,754,278
その他未払金	308,151
未払金合計	2,067,192

未払法人税等 946,118

未払消費税等 2 221,381

賞与引当金 449,925

役員賞与引当金 22,000

外国税支払損失引当金 139,578

訴訟損失引当金 30,000

その他 758,645

流動負債合計 4,634,840

固定負債

退職給付引当金 153,718

役員退職慰労引当金 37,333

執行役員退職慰労引当金 69,916

固定負債合計 260,968

負債合計

4,895,808

純資産の部

株主資本

資本金 4,524,300

資本剰余金

資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
別途積立金	8,900,000
繰越利益剰余金	6,076,707
利益剰余金合計	15,337,200
自己株式	72,415
株主資本合計	22,550,784
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,790
評価・換算差額等合計	1,790
純資産合計	22,548,994
負債純資産合計	27,444,803

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間
	(自 平成27年4月 1日
	至 平成27年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	19,786,569
運用受託報酬	127,876
営業収益合計	19,914,445
営業費用及び一般管理費	1 17,105,543
営業利益	2,808,902
営業外収益	
受取配当金	41,711
有価証券利息	1,754
受取利息	5,320
時効成立分配金・償還金	502
その他	157
営業外収益合計	49,446
営業外費用	
支払利息	3
その他	244
営業外費用合計	247
経常利益	2,858,102
特別利益	
投資有価証券売却益	222,173
外国税支払損失引当金戻入益	44,533
特別利益合計	266,706
特別損失	

固定資産除却損	69
投資有価証券売却損	5,811
特別損失合計	5,880
税引前中間純利益	3,118,928
法人税、住民税及び事業税	954,698
法人税等調整額	68,767
法人税等合計	1,023,466
中間純利益	2,095,462

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本準備金	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	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245
当中間期変動額					
中間純利益					2,095,462
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	-	-	-	-	2,095,462
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	6,076,707

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	利益剰余金合計				
当期首残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当中間期変動額					
中間純利益	2,095,462		2,095,462		2,095,462
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				284,475	284,475
当中間期変動額合計	2,095,462	-	2,095,462	284,475	1,810,986
当中間期末残高	15,337,200	72,415	22,550,784	1,790	22,548,994

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

関連会社株式

総平均法による原価法

 その他有価証券

時価のあるもの

 当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、総平均法により算定）

時価のないもの

総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。但し、平成10年4月1日以後に取得した建物（建物附属設備を除く）については、定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

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り償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

(4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(5) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日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、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

(6) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

す。

(7) 執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 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、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

(追加情報)

当社は、平成27年9月30日開催の取締役会において、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及びDIAMアセットマネジメント株式会社との間で、統合に向けた具体的な準備を開始するべく、グループ資産運用機能の統合に係る「統合基本合意書」の締結を決議いたしました。

(中間貸借対照表関係)

1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額（減損損失累計額を含む）の額

	当中間会計期間 (平成27年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	501,932千円

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、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
有形固定資産	24,732千円
無形固定資産	13,716千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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(株)	1,823,250	-	-	1,823,250

2．自己株式に関する事項

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（株）	9,386	-	-	9,386

3．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

(金融商品関係)

金融商品の時価等に関する事項

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、含まれておりません（（注）2．参照）。

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	15,954,811	15,954,811	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	6,127,827	6,127,827	-
(3) 未収委託者報酬	3,690,798	3,690,798	-
(4) 未払手数料	1,754,278	1,754,278	-

(注) 1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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。

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 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

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成27年9月30日）

1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）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

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,639,419	1,392,104	247,314
	小計	1,639,419	1,392,104	247,314
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	4,488,408	4,739,020	250,612
	小計	4,488,408	4,739,020	250,612
合計		6,127,827	6,131,125	3,297

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額199,051千円）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）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、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は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、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

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。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに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 (平成27年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	12,431円46銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	22,548,994
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	22,548,994
普通株式の発行済株式数(株)	1,823,250
普通株式の自己株式数(株)	9,386
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	1,155円24銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	2,095,462
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	2,095,462
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

(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)

当社は、将来の事業展開や市況変動に備えるために適正な内部留保を維持しつつ、利益配分については株主の皆様へ安定的かつ可能な範囲で高水準の配当を実施していくことを基本的な考え方としており、平成27年11月17日開催の取締役会において、次のとおり剰余金の処分を決議しました。

株主配当に関する決議事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	3,446,341千円
1株当たり配当額	1,900円
基準日	平成27年12月 8日
効力発生日	平成27年12月 17日

5【その他】

<更新後>

a．定款の変更

委託者の定款につき、下記の変更を行いました。

- ・ 剰余金の配当等の決定機関を法令に別段の定めがある場合を除き、株主総会の定めによらず、取締役会の決議によって定めることとしました。（平成27年6月19日実施）
- ・ 当社株式に関して、株券を発行する定めを廃止し、株券不発行としました。また、単元株（100株単位）について廃止しました。（平成28年1月25日実施）

b．訴訟事件その他の重要事項

委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

なお、「委託会社等の経理状況 中間財務諸表」の注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、平成27年11月17日開催の取締役会において期中配当を行うことを決議しました。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) みずほ信託銀行株式会社（「受託者」）

a．資本金の額

平成27年3月末現在、247,369百万円

b．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

（資本金の額は平成27年3月末現在）

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
八幡証券株式会社	2,000	同上

六和証券株式会社	204	同上
U B S 証券株式会社	46,450	同上
中銀証券株式会社	2,000	同上
ふくおか証券株式会社	2,198	同上
大山日ノ丸証券株式会社	215	同上
いよぎん証券株式会社	3,000	同上
木村証券株式会社	500	同上
百五証券株式会社	3,000	同上
リテラ・クリア証券株式会社	3,794	同上
エース証券株式会社	8,831	同上
三豊証券株式会社	300	同上
明和証券株式会社	511	同上
株式会社大垣共立銀行	36,166	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	同上
株式会社親和銀行	36,878	同上
株式会社熊本銀行	33,847	同上
株式会社千葉興業銀行	57,941	同上
株式会社北陸銀行 ^(注)	140,409	同上
株式会社但馬銀行	5,481	同上
株式会社東京スター銀行	26,000	同上
株式会社中京銀行	31,844	同上
株式会社三重銀行	15,295	同上
株式会社東邦銀行 ^(注)	23,519	同上

(注) 株式会社北陸銀行および株式会社東邦銀行は、バンクローン・ファンド（ヘッジなし）のみの取り扱いとなります。

<訂正後>

(1) みずほ信託銀行株式会社（「受託者」）

a. 資本金の額

平成27年3月末現在、247,369百万円

b. 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

（資本金の額は平成27年3月末現在）

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
藍澤証券株式会社 ^(注1)	8,000	同上

六和証券株式会社	204	同上
U B S 証券株式会社	46,450	同上
中銀証券株式会社	2,000	同上
ふくおか証券株式会社	2,198	同上
大山日ノ丸証券株式会社	215	同上
いよぎん証券株式会社	3,000	同上
木村証券株式会社	500	同上
百五証券株式会社	3,000	同上
リテラ・クリア証券株式会社	3,794	同上
エース証券株式会社	8,831	同上
三豊証券株式会社	300	同上
明和証券株式会社	511	同上
高木証券株式会社	11,069	同上
株式会社大垣共立銀行	36,166	銀行法に基づき、銀行業を営んでいません。
株式会社福岡銀行	82,329	同上
株式会社親和銀行	36,878	同上
株式会社熊本銀行	33,847	同上
株式会社千葉興業銀行	57,941	同上
株式会社北陸銀行 ^(注2)	140,409	同上
株式会社但馬銀行	5,481	同上
株式会社東京スター銀行	26,000	同上
株式会社中京銀行	31,844	同上
株式会社三重銀行	15,295	同上
株式会社東邦銀行 ^(注2)	23,519	同上

(注1) 藍澤証券株式会社におきましては、募集・販売の取り扱いは行っておりません。

(注2) 株式会社北陸銀行および株式会社東邦銀行は、バンクローン・ファンド(ヘッジなし)のみの取り扱いとなります。

独立監査人の監査報告書

平成28年2月2日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 伊藤 志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 福村 寛

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」に掲げられているバンクローン・ファンド（ヘッジなし）の平成27年6月11日から平成27年12月10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、バンクローン・ファンド（ヘッジなし）の平成27年12月10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

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

以 上

- () 1 . 上記は、当社が、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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成28年2月2日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 伊藤 志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 福村 寛

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」に掲げられているバンクローン・ファンド（ヘッジあり）の平成27年6月11日から平成27年12月10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、バンクローン・ファンド（ヘッジあり）の平成27年12月10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

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

以 上

- () 1 . 上記は、当社が、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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成27年6月12日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第55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、新光投信株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

() 1. 上記は、当社が、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。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月1日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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、新光投信株式会社の平成27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27年4月1日から平成27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27年9月30日開催の取締役会において、「統合基本合意書」の締結について決議している。

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

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