

## 【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2月12日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 横山 邦男
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	三島 克哉
【電話番号】	03-5405-0228
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型） 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／3カ月決算型）
【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8月7日から平成28年8月9日まで) 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型） 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／3カ月決算型） 1兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年8月6日付をもって提出しました「三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり / 3 カ月決算型）」、「三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし / 3 カ月決算型）」について、平成28年2月12日に有価証券報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、ファンド情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

## 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。

## 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】

<更新後>

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三菱UFJ信託銀行株式会社」

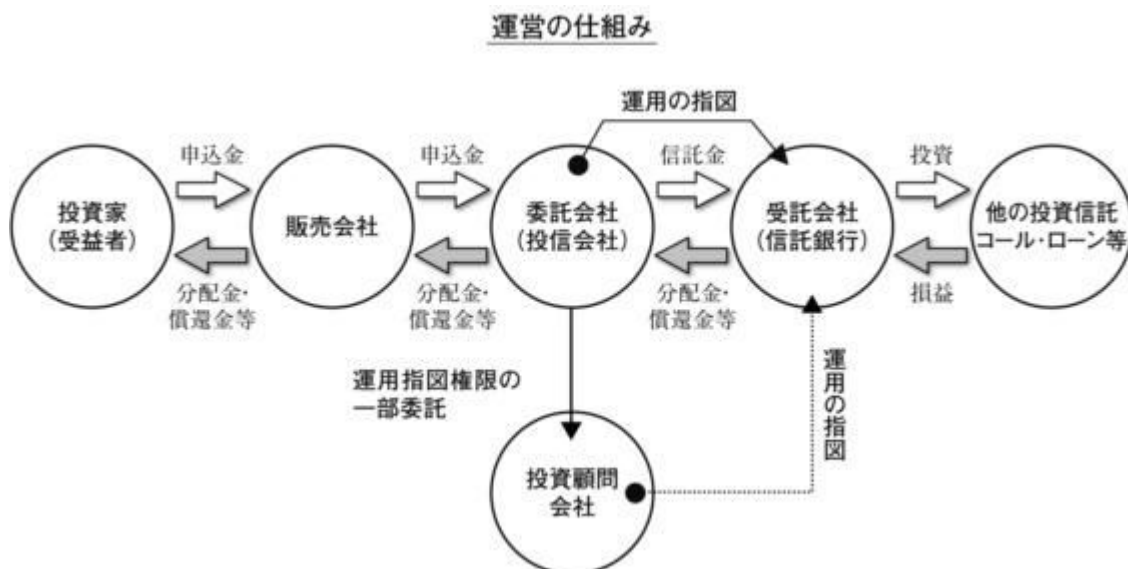
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

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

(ニ) 投資顧問会社（運用の委託先） 「ピムコジャパンリミテッド」

委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、当ファンドの運用指図に関する権限の一部の委託を受け、信託財産の運用を行います。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成27年11月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
平成11年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
平成11年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
平成12年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
平成14年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成25年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

## (八) 大株主の状況

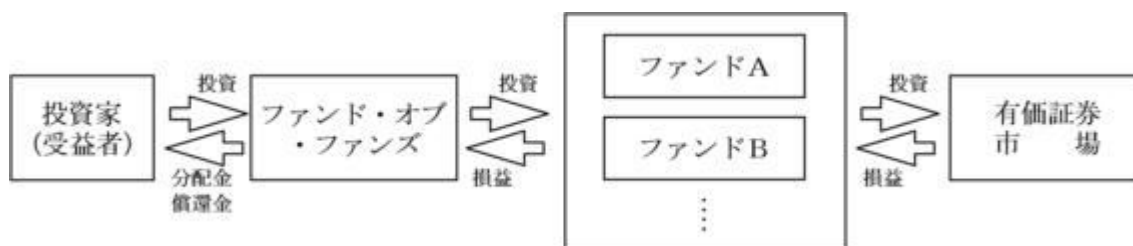
(平成27年11月30日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	7,056	40.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	4,851	27.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

## 八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

## 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

&lt;更新後&gt;

## イ 基本方針

当ファンドは、投資信託への投資を通じて、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり / 3カ月決算型）

(イ) 主として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)」および「マネー・マーケット・マザーファンド」への投資を通じて、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

(ロ) 「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)」を通じて、投資適格未満の銘柄

も含めた世界の幅広い債券等のうち、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資します。

- ・利回り水準、割安度、発行体の返済能力、期限前償還リスク等を総合的に分析して、比較的高水準かつ安定的な利子収入が期待できると判断される銘柄に投資します。
  - ・米国の債券等(国債、政府機関債、投資適格社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイイールド社債、貸付債権(バンクローン)等)、米国以外の先進国債券、新興国債券および債券関連派生商品等に分散投資します。
  - ・米ドル建て債券には、非米ドル建て債券を為替取引により米ドルにしたものも含まれます。
  - ・市場環境や経済見通しに応じて、上記債券等の種別配分を機動的に変更します。
  - ・米ドル以外の通貨の組入比率は、取得時において純資産総額の10%程度までとします。
  - ・原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円で為替変動リスクの低減を図ります。
  - ・実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
- (八)「マネー・マーケット・マザーファンド」を通じて、主として円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資します。
- (二)原則として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)」の投資比率を高位に保ちます。
- (ホ)運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。
- (ヘ)資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ト)主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。

a. ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)

投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。

b. マネー・マーケット・マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	円貨建ての短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	安定した収益の確保を目指します。

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

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

- (イ)主として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)」および「マネー・マーケット・マザーファンド」への投資を通じて、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- (ロ)「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)」を通じて、投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い債券等のうち、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資します。
- ・利回り水準、割安度、発行体の返済能力、期限前償還リスク等を総合的に分析して、比較的高水準かつ安定的な利子収入が期待できると判断される銘柄に投資します。
  - ・米国の債券等(国債、政府機関債、投資適格社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイイールド社債、貸付債権(バンクローン)等)、米国以外の先進国債券、新興国債券および債券関連派生商品等に分散投資します。
  - ・米ドル建て債券には、非米ドル建て債券を為替取引により米ドルにしたものも含まれます。
  - ・市場環境や経済見通しに応じて、上記債券等の種別配分を機動的に変更します。
  - ・米ドル以外の通貨の組入比率は、取得時において純資産総額の10%程度までとします。

- ・外貨建資産に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ハ) 「マネー・マーケット・マザーファンド」を通じて、主として円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資します。
- (ニ) 原則として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)」の投資比率を高位に保ちます。
- (ホ) 運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ト) 主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。

a . ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)

投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。

b . マネー・マーケット・マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	円貨建ての短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	安定した収益の確保を目指します。

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

## ファンドの特色

**1**

世界の幅広い債券等のうち、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

- ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。
- 米国の債券等（国債、政府機関債、投資適格社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイイールド社債、貸付債権（バンクローン）等）、米国以外の先進国債券、新興国債券および債券関連派生商品等に分散投資します。なお、投資適格未満の銘柄への投資も含まれます。
- 米ドル建て債券には、非米ドル建て債券を為替取引により米ドルにしたものも含まれます。
- 市場環境や経済見通しに応じて、上記債券等の種別配分を機動的に変更します。

**2**

債券運用において高い専門性を有するPIMCOグループのノウハウを活用します。

- 当ファンドの運用指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。

**3**

「為替ヘッジあり/3カ月決算型」と「為替ヘッジなし/3カ月決算型」の2つのファンドがあります。

- 「為替ヘッジあり/3カ月決算型」は、原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
- 「為替ヘッジなし/3カ月決算型」は、外貨建資産に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

**4**

年4回（原則として毎年2月、5月、8月、11月の12日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、収益分配方針に基づき分配を行います。

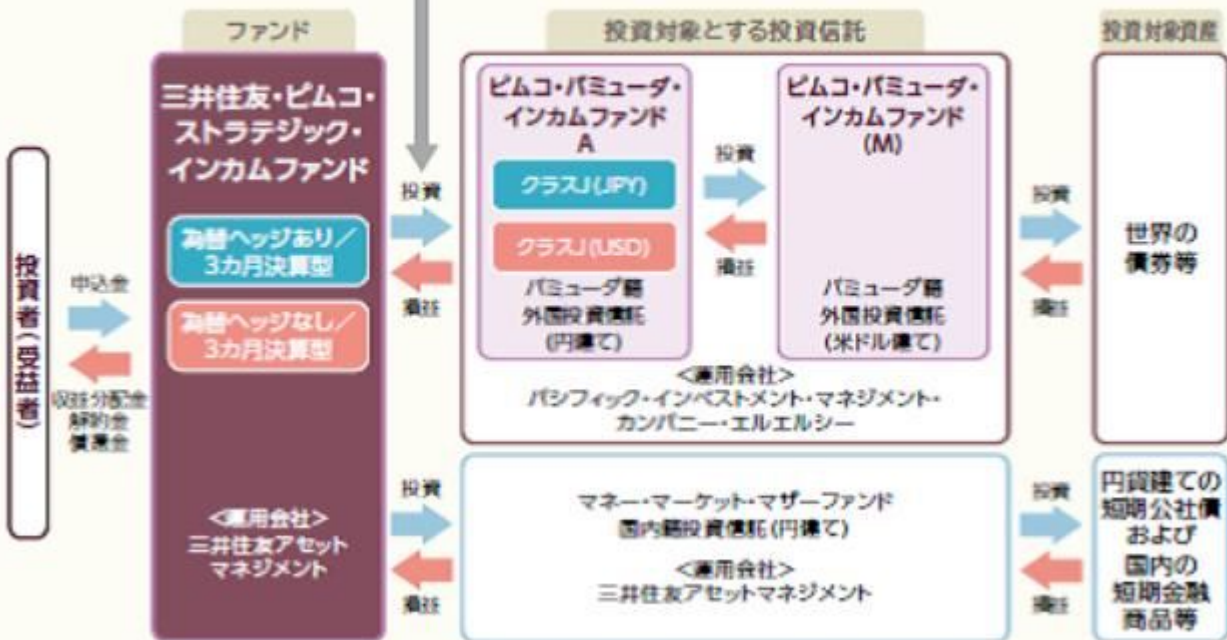
- 分配金額は、委託会社が収益分配方針に基づき、基準価額水準、市況動向等を考慮し決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

## ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

ビムコジャパンリミテッドに運用指図権限の一部を委託します。



※「ビムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY) / クラスJ(USD)」の組入比率を原則として、上位に保ちます。したがって、ファンドの実質的な主要投資対象は、世界の債券等となります。



## 投資する資産の種類と特徴

- 世界の幅広い債券から、比較的高水準かつ安定的なインカム収入が期待できると判断される銘柄に投資します。
- 単一の投資対象に偏ることなく、多様な投資対象に分散投資します。

### 主な固定金利資産

#### 米国政府関連債

- ・米国の政府や地方政府が発行する債券。
- ・信用力が強く安全性が高いため、相対的に利回りは低い。

#### 米国投資資格社債

- ・企業が発行する債券で、格付けがBBB格以上のもの。
- ・信用力が強く、安全性が高いため、相対的に利回りは低い。

#### ハイイールド社債

- ・企業が発行する債券で、格付けがBBB格以下のもの。
- ・信用力が低い分、高い利回りが期待できる。

#### 米国政府系モーゲージ証券

- ・政府系機関が発行する住宅ローンを担保とする証券。
- ・信用力は高い。
- ・短期金利変動リスクがあるため、他の高格付け債券より利回りが高くなる傾向がある。

#### 先進国債券

- ・先進国の政府や政府機関、企業が発行する債券。
- ・信用力が高い分、利回りは低くなる傾向がある。

#### 新興国債券

- ・新興国の政府や政府機関、企業が発行する債券。
- ・先進国の債券と比べて信用力が低い分、利回りは高くなる傾向がある。

### 主な変動金利資産

#### バンクローン

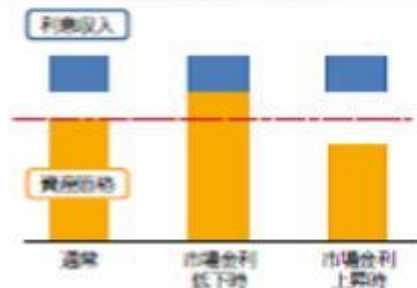
- ・銀行等が、主に格付けがBBB格以下の企業に対して行うローン。
- ・通常、優先担保が設定されており、社債等と比較して弁済順位が高い。
- ・変動金利で設定されることが多い。

#### 米国非政府系モーゲージ証券

- ・非政府系機関が発行する住宅ローンを担保とする証券。
- ・政府系と比べ信用力が低い分、利回りが高い。
- ・変動金利で設定されることが多い。

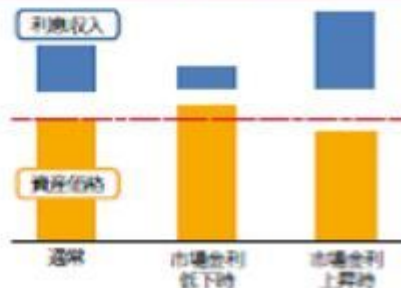
- 変動金利資産は、金利変動による資産価格の変動が相対的に小さく、金利上昇に抵抗があります。

### 固定金利資産の価格変動イメージ



固定金利資産は、利息は固定である一方で資産価格は金利変動に応じて相対的に大きく変動

### 変動金利資産の価格変動イメージ

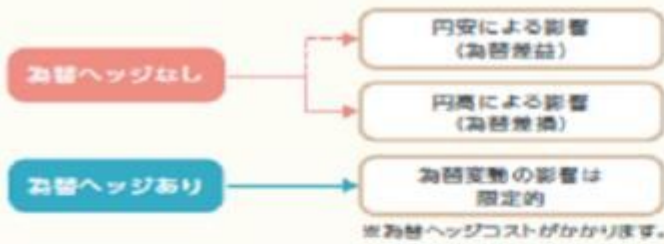


変動金利資産は、金利変動による資産価格の変動が相対的に小さい

※上記はイメージ図であり、実際とは異なる場合があります。また、すべての資産を記載しているものではありません。

## 為替ヘッジについて

## 〔対円での為替ヘッジの効果〕



■対円での為替ヘッジとは、通貨の先渡（フォワード）取引等を利用し、為替変動リスクを低減することです。

■「為替ヘッジあり/3カ月決算型」では、原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。

なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

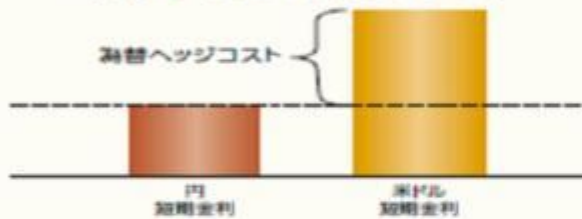
■外貨建資産に対して、対円での為替ヘッジを行う際、円の短期金利が外貨の短期金利を下回っている場合、その金利差相当分が為替ヘッジコストとなります。

■金利差が拡大すると、為替ヘッジコストは上昇し、金利差が縮小すると、為替ヘッジコストは低下します。

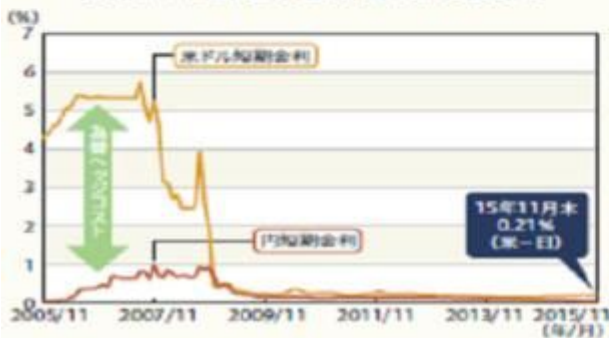
米ドル建て資産に対する為替ヘッジのケースでは、米国の金利上昇等により日米の短期金利差が拡大した場合、為替ヘッジコストが増加します。

〔注〕左記は、対円での為替ヘッジを行った場合の為替ヘッジコストについて理解を深めていただくためのイメージ図です。

## 〔為替ヘッジコストについて〕



## 〔米ドルと円の短期金利の推移〕



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

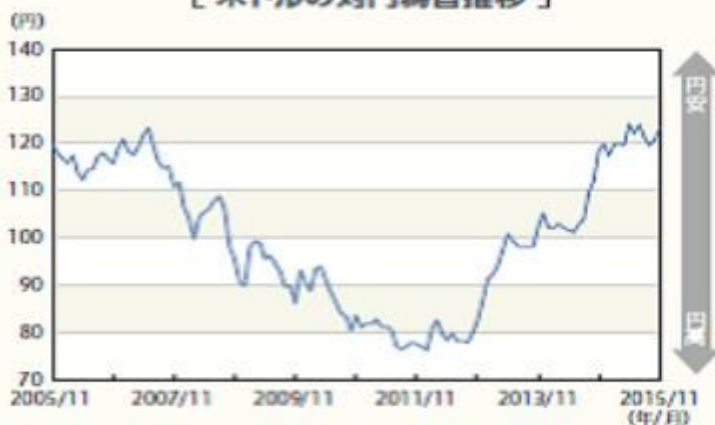
〔注1〕データは2005年11月末～2015年11月末。

〔注2〕米ドル短期金利、円短期金利は、各1ヵ月LIBORを使用。

〔出所〕FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

## 為替レートの推移

## 〔米ドルの対円為替推移〕



■「為替ヘッジなし/3カ月決算型」では、外貨建資産に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行わないため、為替変動の影響を受けます。

■米ドルの対円為替は、2007年後半以降円高傾向で推移してきましたが、2012年10月以降円高が修正される動きとなっています。

〔注〕データは2005年11月末～2015年11月末。

〔出所〕Bloombergのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

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

## 投資対象とする外国投資信託の運用会社について

## 〔パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー (PIMCO) の概要〕

設立等	債券専門の運用会社として1971年に設立 米国最大級の債券ファンドを運用
運用チーム	外国投資信託の運用は、インカム運用 チームが担当
拠 点	米国をはじめ東京、シドニー、シンガポール、 ロンドン、ミュンヘン、香港、リオデジャ ネイロ等に拠点を設けグローバルにビジ ネスを展開 拠点数は世界に13カ所
従業員数	約2,390名(うち運用担当者 約260名)
運用資産残高	約1.47兆米ドル(約176兆円、2015年9月 末現在、関係会社受託分を含む)

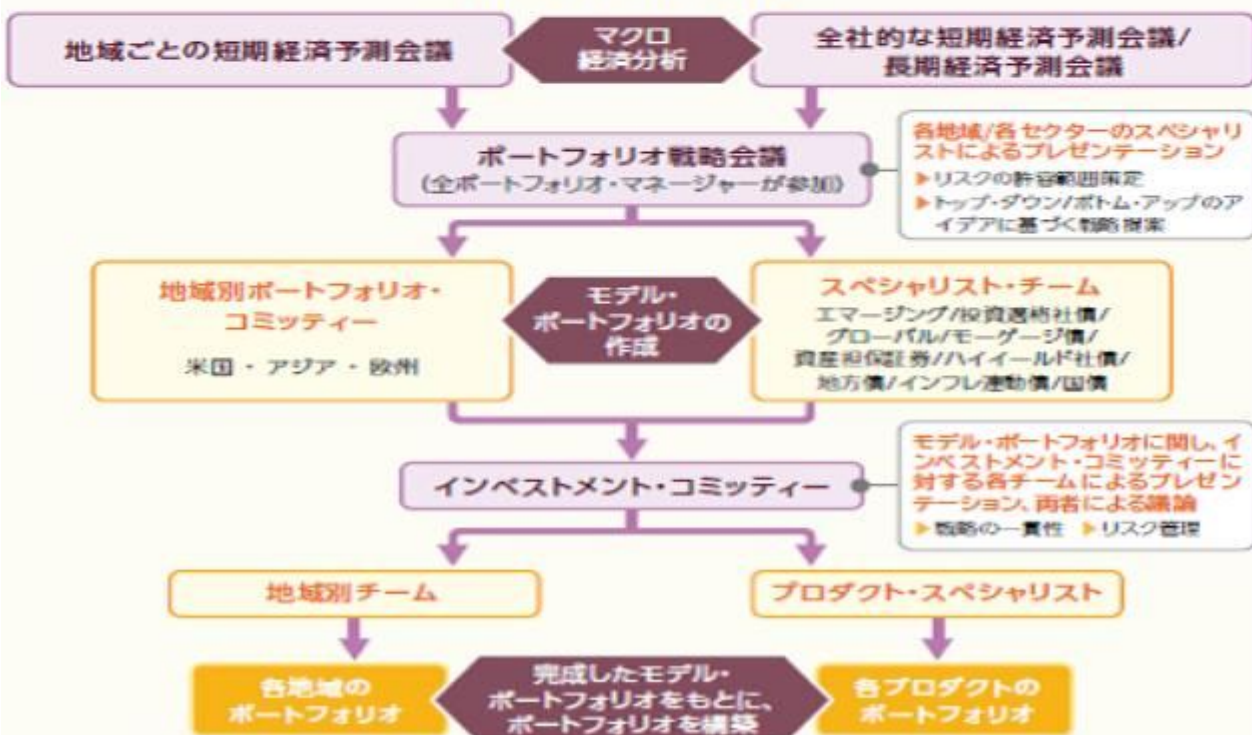
(注)1米ドル=119.765円で換算

## 〔ビムコジャパンリミテッドの概要〕

設立等	PIMCOのグローバル拠点の1つとして 1997年に設立 投資運用業等を含み、国内の証券投資 信託、年金基金、機関投資家等に対し 運用サービスを提供
従業員数	約90名
運用資産残高	約815億米ドル (約9.8兆円、2015年9月末現在)

(注)1米ドル=119.765円で換算

## 〔PIMCOの運用プロセス〕



(出所)ビムコジャパンリミテッドのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

(注)上記の運用プロセスは2015年11月末時点のものであり、将来変更される場合があります。

## 3【投資リスク】

&lt;更新後&gt;

## イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

(イ) 債券市場リスク

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

(ロ) 信用リスク

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

(ハ) 派生商品リスク

各種派生商品(先物取引、オプション取引、各種スワップ取引等)の活用は、当該派生商品価格が、その基礎となる資産、利率、指数等の変動以上の値動きをすることがあるため、ファンドの基準価額が大きく下落する要因ともなります。

(ニ) 為替変動リスク

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

「為替ヘッジあり/3カ月決算型」については、投資する外国投資信託において、原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。したがって、当該外国投資信託に組み入れられている米ドル建て資産については、為替の変動による影響は限定的と考えられます(ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。)。なお、当該外国投資信託に組み入れられている米ドル建て以外の資産については、米ドルに対する当該資産通貨の為替変動の影響を受けます。

(ホ) カントリーリスク

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

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) 換金制限等に関する留意点

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

(チ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

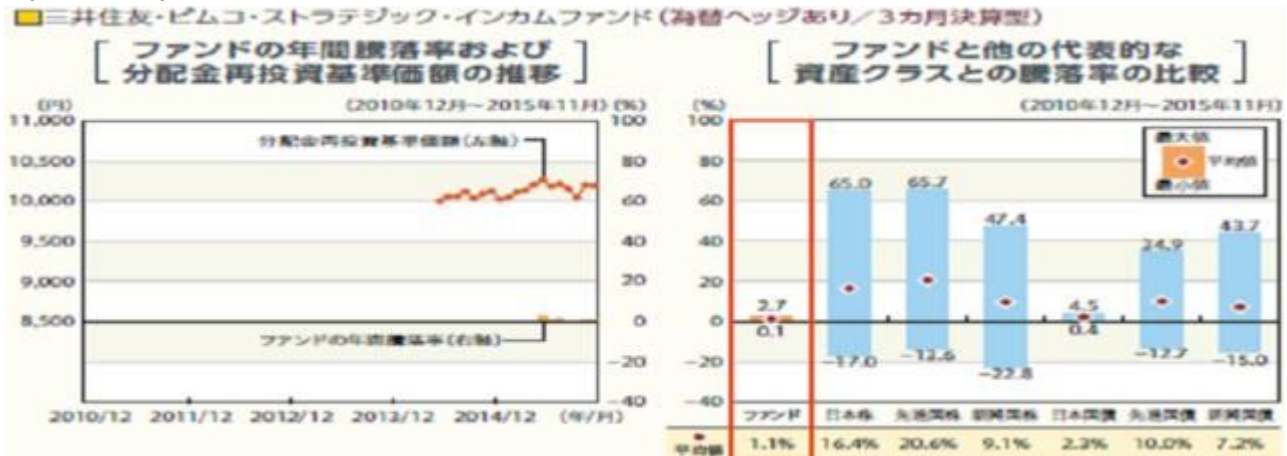
#### ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

#### [参考情報] パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーのリスク管理体制

実効性のある管理を行うためには、異なる機能を有するセクションが相互牽制を働かせ、多面的なリスク管理、モニタリングを行うことが不可欠であると考えています。すべてのポートフォリオとすべての取引はポートフォリオ・マネジメント、アカウント・マネジメント、コンプライアンス/リーガルの3つの独立した部門が互いに牽制しあう形で監視することによりシステムの信頼性を保っています。

#### （参考情報）投資リスクの定量的比較



## ■三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3か月決算型)



※左グラフは2010年12月～2015年11月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの設定日が2014年5月30日のため、左グラフの分配金再投資基準価額は2014年5月末以前のデータを、左右グラフのファンドの騰落率については各月末の直近1年間の騰落率であるため、ファンド設定1年後の2015年5月末以前のデータを表示しています。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※右グラフは、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あり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## ＜各資産クラスの指数＞

日本株→TOPIX(値当込み)

先進国株→MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)

新興国株→MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)

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・ダイバーシファイド(円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

【TOPIX(値当込み)】は、株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。

【MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)】は、MSCI Incが開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。

【MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)】は、MSCI Incが開発した指数で、新興国の株式を対象としています。

【NOMURA-BPI(国債)】は、野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募定期付利国債を対象としています。

【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が開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。

【JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)】は、J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

<更新後>

	純資産総額に年1.8144%（税抜き1.68%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。	
	信託報酬は、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。	
	信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率	
	信託報酬の実質的配分は以下の通りです。	
	＜信託報酬の配分（税抜き）＞	
	支払先	料率
	委託会社	年0.95%
		役務の内容
		ファンド運用の指図等の対価

ファンド	販売会社	年0.70%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
	上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。委託会社の報酬には、当ファンドの運用に関する権限の一部の委託を受ける投資顧問会社の報酬（年0.648%（税抜き0.6%））が含まれております。		
投資対象とする投資信託	ありません。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年1.8144%（税抜き1.68%）程度		

### （５）【課税上の取扱い】

#### <更新後>

#### イ 個別元本について

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

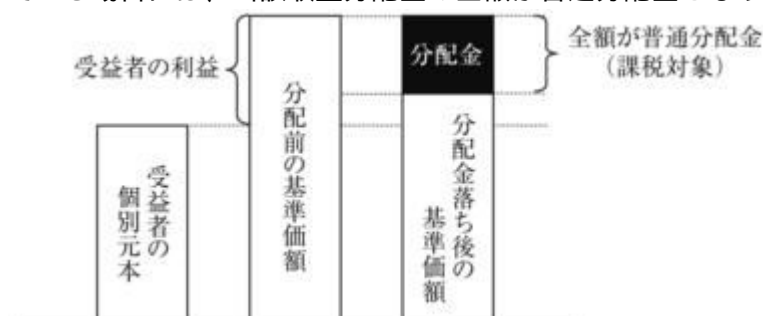
#### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

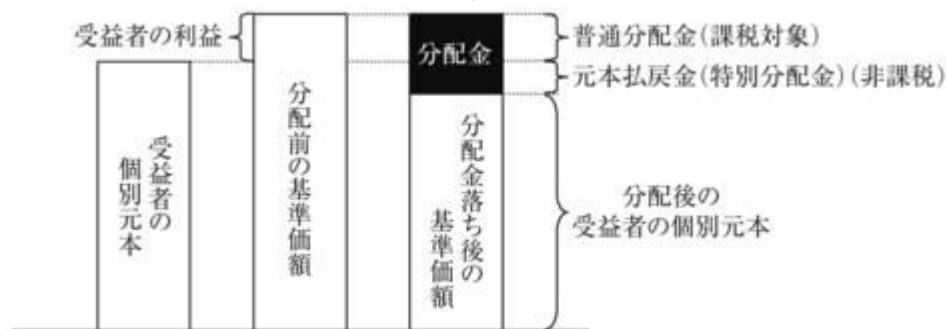
#### ハ 収益分配金の課税について

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

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



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

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

#### ・一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。また、0歳から19歳の方を対象とした「ジュニアNISA」において、平成28年4月1日より年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合  
外貨建資産への直接投資は行いません。



非株式割合に関する制限はありません(約款規定なし)。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成27年11月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

<更新後>

### (1)【投資状況】

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	バミューダ	1,342,961,354	96.34
親投資信託受益証券	日本	10,007	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		51,010,799	3.66
合計(純資産総額)		1,393,982,160	100.00

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

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	バミューダ	17,396,900,540	96.02
親投資信託受益証券	日本	10,007	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		720,187,414	3.98
合計(純資産総額)		18,117,097,961	100.00

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)

#### イ 主要投資銘柄

平成27年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
------	----	-----	----	-------------	-------------	------------------	------------	-----------------

バミューダ	投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)	134,323	10,000	1,343,230,000	9,998	1,342,961,354	96.34
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	9,972	1.0035	10,006	1.0036	10,007	0.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	96.34
親投資信託受益証券	0.00
合計	96.34

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

#### イ 主要投資銘柄

平成27年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
バミューダ	投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)	1,440,260	12,093.24	17,417,411,316	12,079	17,396,900,540	96.02
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	9,972	1.0035	10,006	1.0036	10,007	0.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	96.02
親投資信託受益証券	0.00
合計	96.02

#### 【投資不動産物件】

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)

該当事項はありません。

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

## 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり / 3 カ月決算型）

該当事項はありません。

## 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし / 3 カ月決算型）

該当事項はありません。

## （ 3 ） 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり / 3 カ月決算型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
特定1期 (平成26年11月12日)	1,014,187,287	1,025,336,961	10,006	10,116
特定2期 (平成27年 5月12日)	1,013,426,521	1,022,537,979	10,010	10,100
特定3期 (平成27年11月12日)	1,409,423,129	1,436,463,200	9,826	10,006
平成26年11月末日	1,028,023,016		10,020	
12月末日	1,031,652,154		9,912	
平成27年 1月末日	1,034,439,131		9,939	
2月末日	1,015,621,372		10,003	
3月末日	1,010,110,482		10,028	
4月末日	1,025,292,983		10,098	
5月末日	1,009,991,960		10,064	
6月末日	1,470,327,834		9,983	
7月末日	1,614,435,194		10,015	
8月末日	1,524,237,182		9,866	
9月末日	1,443,177,916		9,759	
10月末日	1,424,186,970		9,915	
11月末日	1,393,982,160		9,816	

## 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし / 3 カ月決算型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
特定1期 (平成26年11月12日)	22,335,091,537	23,564,878,245	10,897	11,497
特定2期 (平成27年 5月12日)	17,159,899,806	19,380,842,229	10,208	11,388

特定3期 (平成27年11月12日)	18,075,585,180	18,964,174,740	9,982	10,472
平成26年11月末日	22,899,125,442		11,078	
12月末日	23,327,722,565		11,236	
平成27年 1月末日	22,936,593,457		11,040	
2月末日	22,050,766,527		10,619	
3月末日	22,279,483,506		10,707	
4月末日	19,814,810,768		10,698	
5月末日	17,851,687,195		10,627	
6月末日	19,667,391,516		10,420	
7月末日	20,087,586,808		10,598	
8月末日	18,236,013,792		9,871	
9月末日	17,737,258,092		9,687	
10月末日	17,956,986,877		9,934	
11月末日	18,117,097,961		9,962	

## 【分配の推移】

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
特定1期	平成26年 5月30日～平成26年11月12日	110
特定2期	平成26年11月13日～平成27年 5月12日	90
特定3期	平成27年 5月13日～平成27年11月12日	180

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
特定1期	平成26年 5月30日～平成26年11月12日	600
特定2期	平成26年11月13日～平成27年 5月12日	1,180
特定3期	平成27年 5月13日～平成27年11月12日	490

## 【収益率の推移】

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)

	収益率(%)
特定1期	1.2
特定2期	0.9
特定3期	0.0

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

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

	収益率(%)
特定1期	15.0
特定2期	4.5
特定3期	2.6

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

(4)【設定及び解約の実績】

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
特定1期	1,013,606,776	0
特定2期	73,910,238	75,132,693
特定3期	731,325,404	309,365,059

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
特定1期	20,579,877,021	83,431,879
特定2期	1,998,805,794	5,684,264,386
特定3期	10,256,808,077	8,959,139,536

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

参考情報

基準日: 2015年11月30日

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

## 基準価額・純資産の推移

■三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)



決算期	分配金
2015年11月	90円
2015年8月	90円
2015年5月	90円
2015年2月	0円
2014年11月	110円
設定来累計	380円

※分配金は1万円当たり税引前です。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

■三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)



決算期	分配金
2015年11月	90円
2015年8月	400円
2015年5月	580円
2015年2月	600円
2014年11月	600円
設定来累計	2,270円

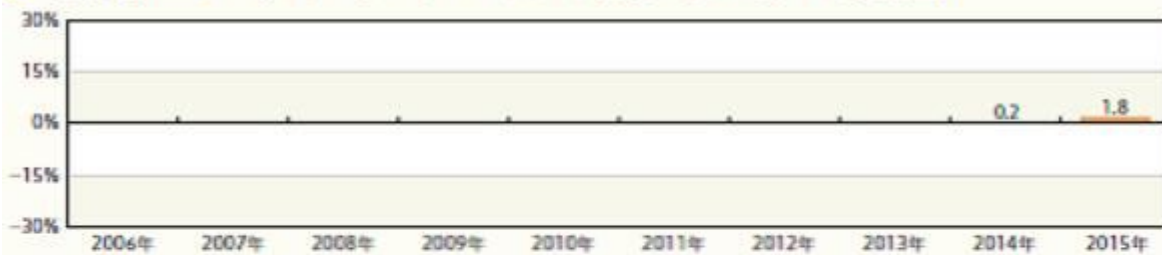
※分配金は1万円当たり税引前です。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

※分配金再投資基準価額、基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

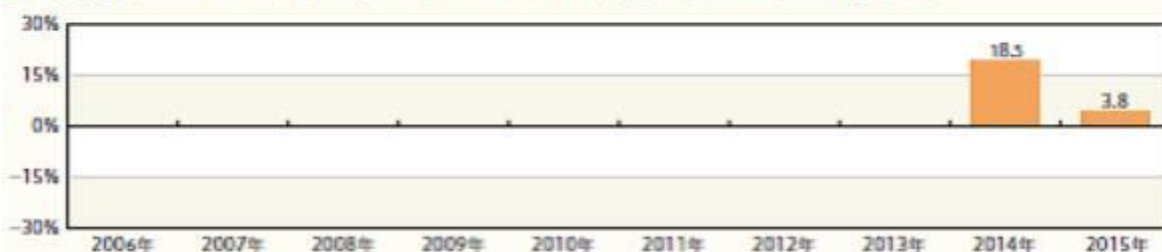
※分配金再投資基準価額は、上記期間における分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算した価額です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

■三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)



■三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。

※2014年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2014年5月30日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2015年のファンドの収益率は、年初から2015年11月30日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第3【ファンドの経理状況】

&lt;更新後&gt;

- 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 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。
- 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、特定3期（平成27年5月13日から平成27年11月12日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり / 3ヵ月決算型）】

## (1)【貸借対照表】

	(単位：円)	
	特定2期 (平成27年5月12日現在)	特定3期 (平成27年11月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,801,875	88,903,426
投資信託受益証券	995,250,122	1,343,230,000
親投資信託受益証券	10,006	10,006
未収利息	9	24
流動資産合計	1,030,062,012	1,432,143,456
資産合計	1,030,062,012	1,432,143,456
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	9,111,458	12,909,101
未払解約金	3,017,100	3,121,335
未払受託者報酬	80,243	119,108
未払委託者報酬	4,413,341	6,550,962
その他未払費用	13,349	19,821
流動負債合計	16,635,491	22,720,327
負債合計	16,635,491	22,720,327
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,012,384,321	1,434,344,666
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,042,200	24,921,537
元本等合計	1,013,426,521	1,409,423,129
純資産合計	1,013,426,521	1,409,423,129
負債純資産合計	1,030,062,012	1,432,143,456

## (2)【損益及び剰余金計算書】

	特定2期		特定3期	
	自	平成26年11月13日 至 平成27年 5月12日	自	平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		31,791,955		46,080,579
受取利息		1,813		2,551
有価証券売買等損益		13,216,162		34,086,369
営業収益合計		18,577,606		11,996,761
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		163,626		227,564
委託者報酬		8,999,266		12,516,082
その他費用		27,214		37,870
営業費用合計		9,190,106		12,781,516
営業利益又は営業損失（ ）		9,387,500		784,755
経常利益又は経常損失（ ）		9,387,500		784,755
当期純利益又は当期純損失（ ）		9,387,500		784,755
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		162,107		767,182
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		580,511		1,042,200
剰余金増加額又は欠損金減少額		480,823		1,957,839
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		214,431		1,957,839
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		266,392		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		133,069		863,932
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		23,569		71,194
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		109,500		792,738
分配金		9,111,458		27,040,071
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,042,200		24,921,537

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	特定3期	
	自	平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準	



	受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
--	--

## (貸借対照表に関する注記)

項目	特定2期 (平成27年 5月12日現在)		特定3期 (平成27年11月12日現在)	
	1. 当特定期間の末日における受益権の総数	1,012,384,321口		1,434,344,666口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損		元本の欠損 24,921,537円	
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.0010円 10,010円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	0.9826円 9,826円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	特定2期 自平成26年11月13日 至平成27年 5月12日		特定3期 自平成27年 5月13日 至平成27年11月12日	
	1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 3,272,376円		委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 4,570,723円
2. 分配金の計算過程	<p>(自平成26年11月13日 至平成27年 2月12日)</p> <p>第3計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,504,111円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,854,905円)、および分配準備積立金(3,633,588円)より、分配対象収益は18,992,604円(1万口当たり186.73円)ですが、分配を行っておりません。</p> <p>(自平成27年 2月13日 至平成27年 5月12日)</p> <p>第4計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,170,779円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(4,339,048円)、および分配準備積立金(14,716,917円)より、分配対象収益は31,226,744円(1万口当たり308.42円)であり、うち9,111,458円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p>		<p>(自平成27年 5月13日 至平成27年 8月12日)</p> <p>第5計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,423,270円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(20,558,626円)、および分配準備積立金(16,309,913円)より、分配対象収益は52,291,809円(1万口当たり333.03円)であり、うち14,130,970円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成27年 8月13日 至平成27年11月12日)</p> <p>第6計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,064,393円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(19,314,344円)、および分配準備積立金(15,602,410円)より、分配対象収益は51,981,147円(1万口当たり362.38円)であり、うち12,909,101円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p>	

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	<p style="text-align: center;">特定3期</p> <p style="text-align: center;">自 平成27年 5月13日</p> <p style="text-align: center;">至 平成27年11月12日</p>
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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当特定期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	特定3期 (平成27年11月12日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

特定2期（自 平成26年11月13日 至 平成27年 5月12日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	6,807,562円
親投資信託受益証券	1円
合計	6,807,563円

特定3期（自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	13,297,977円
親投資信託受益証券	- 円
合計	13,297,977円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	特定2期 （平成27年 5月12日現在）	特定3期 （平成27年11月12日現在）
期首元本額	1,013,606,776円	1,012,384,321円
期中追加設定元本額	73,910,238円	731,325,404円
期中一部解約元本額	75,132,693円	309,365,059円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)	134,323	1,343,230,000	
投資信託受益証券合計		134,323	1,343,230,000	
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	9,972	10,006	
親投資信託受益証券合計		9,972	10,006	
合計			1,343,240,006	

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。

【三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし / 3カ月決算型）】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	特定2期 (平成27年 5月12日現在)	特定3期 (平成27年11月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,063,411,254	1,617,873,379
投資信託受益証券	16,892,819,712	16,717,411,572
親投資信託受益証券	10,006	10,006
未収利息	565	443
流動資産合計	18,956,241,537	18,335,295,400
資産合計	18,956,241,537	18,335,295,400
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	975,037,219	162,977,895
未払解約金	727,066,814	14,824,687
未払受託者報酬	1,677,823	1,458,298
未払委託者報酬	92,280,267	80,206,324
その他未払費用	279,608	243,016
流動負債合計	1,796,341,731	259,710,220
負債合計	1,796,341,731	259,710,220
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	16,810,986,550	18,108,655,091
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	348,913,256	33,069,911
元本等合計	17,159,899,806	18,075,585,180
純資産合計	17,159,899,806	18,075,585,180
負債純資産合計	18,956,241,537	18,335,295,400

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	特定2期 自 平成26年11月13日 至 平成27年 5月12日	特定3期 自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	673,733,176	586,802,658
受取利息	36,111	41,240
有価証券売買等損益	507,946,335	16,804,743
営業収益合計	1,181,715,622	603,648,641
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	3,550,944	2,954,689
委託者報酬	195,301,993	162,507,800
その他費用	591,768	492,380
営業費用合計	199,444,705	165,954,869
営業利益又は営業損失 ( )	982,270,917	437,693,772
経常利益又は経常損失 ( )	982,270,917	437,693,772
当期純利益又は当期純損失 ( )	982,270,917	437,693,772
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )	58,862,179	78,568,620
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	1,838,646,395	348,913,256
剰余金増加額又は欠損金減少額	172,239,191	383,773,570
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	172,239,191	383,773,570
剰余金減少額又は欠損金増加額	364,438,645	236,292,329

	特定2期 自 平成26年11月13日 至 平成27年 5月12日	特定3期 自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	364,438,645	216,829,057
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	19,463,272
分配金	2,220,942,423	888,589,560
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	348,913,256	33,069,911

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	特定3期 自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	特定2期 (平成27年 5月12日現在)	特定3期 (平成27年11月12日現在)
1. 当特定期間の末日における受益権の総数	16,810,986,550口	18,108,655,091口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	元本の欠損 33,069,911円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0208円 (10,000口当たりの純資産額 10,208円)	1口当たり純資産額 0.9982円 (10,000口当たりの純資産額 9,982円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	特定2期	特定3期
	自 平成26年11月13日 至 平成27年 5月12日	自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 70,926,944円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 59,271,828円
2. 分配金の計算過程	（自 平成26年11月13日 至 平成27年 2月12日） 第3計算期間末における費用控除後の配当等収益（310,837,739円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（343,826,152円）、収益調整金（565,604,892円）、および分配準備積立金（1,310,803,078円）より、分配対象収益は2,531,071,861円（1万口当たり1,218.90円）であり、うち1,245,905,204円（1万口当たり600円）を分配金額としております。 （自 平成27年 2月13日 至 平成27年 5月12日） 第4計算期間末における費用控除後の配当等収益（204,848,909円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（63,895,938円）、収益調整金（480,200,519円）、および分配準備積立金（575,005,109円）より、分配対象収益は1,323,950,475円（1万口当たり787.54円）であり、うち975,037,219円（1万口当たり580円）を分配金額としております。	（自 平成27年 5月13日 至 平成27年 8月12日） 第5計算期間末における費用控除後の配当等収益（228,703,733円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（303,803,921円）、収益調整金（562,008,184円）、および分配準備積立金（1,054,712円）より、分配対象収益は1,095,570,550円（1万口当たり603.94円）であり、うち725,611,665円（1万口当たり400円）を分配金額としております。 （自 平成27年 8月13日 至 平成27年11月12日） 第6計算期間末における費用控除後の配当等収益（209,721,697円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（6,641,748円）、および分配準備積立金（207,170円）より、分配対象収益は216,570,615円（1万口当たり119.58円）であり、うち162,977,895円（1万口当たり90円）を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	特定3期
	自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1)金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当特定期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	<p>特定3期 (平成27年11月12日現在)</p>
-----	---------------------------------



1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

特定2期（自 平成26年11月13日 至 平成27年 5月12日）

種 類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	67,954,476円
親投資信託受益証券	1円
合計	67,954,477円

特定3期（自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日）

種 類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	380,575,821円
親投資信託受益証券	- 円
合計	380,575,821円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	特定2期 （平成27年 5月12日現在）	特定3期 （平成27年11月12日現在）
期首元本額	20,496,445,142円	16,810,986,550円
期中追加設定元本額	1,998,805,794円	10,256,808,077円
期中一部解約元本額	5,684,264,386円	8,959,139,536円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)	1,382,404	16,717,411,572	
投資信託受益証券合計		1,382,404	16,717,411,572	
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	9,972	10,006	
親投資信託受益証券合計		9,972	10,006	
合計			16,717,421,578	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）は、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)」および「マネー・マーケット・マザーファンド」を、三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／3カ月決算型）は、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)」および「マネー・マーケット・マザーファンド」をそれぞれ主要投資対象としており、各貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はすべて該当ファンドの受益証券であり、「親投資信託受益証券」はすべて該当マザーファンドの受益証券です。

「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)」および「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)」は、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA」の各シェアクラスであり、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA」の主要投資対象は、「ピムコ・バミューダ・インカムファンド(M)」です。

以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## ピムコ・バミューダ・インカムファンドA

ピムコ・バミューダ・インカムファンドAは、バミューダ籍の外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

### 資産・負債計算書(2014年10月31日現在)

(単位：千米ドル、ただし一口当たりを除く)

#### 資産：

投資有価証券(時価)	14,916
関連ファンドに対する投資	895,589
金融デリバティブ商品	
OTC	8,906
カウンターパーティー預け金	260
投資有価証券売却による未収入金	3
関連ファンドに対する投資売却による未収入金	4,022
ファンド証券売却による未収入金	5,828
未収利息および未収配当金	6
	929,530

#### 負債：

金融デリバティブ商品	
OTC	16,735
投資有価証券購入による未払金	1,790
関連ファンドに対する投資による未払金	5,017
未払利息	2
カウンターパーティー預り金	170
ファンド証券買戻しによる未払金	4,905
	28,619

#### 純資産

900,911

### 投資明細表(2014年10月31日現在)

種類	銘柄	額面金額		時価	
		通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
投資有価証券	短期証券	定期性預金	ANZ National Bank		
1.7%	1.7%	1.6%	0.030% 期日 11/03/2014	USD	2,388
			Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.		
			0.030% 期日 11/03/2014		749
			Brown Brothers Harriman & Co.		
			0.030% 期日 11/03/2014		5
			Citibank N.A.		
			0.030% 期日 11/03/2014		3,498
			DBS Bank Ltd.		
			0.030% 期日 11/03/2014		5,067
			DnB NORBank ASA		
			0.030% 期日 11/03/2014		2,631
			Wells Fargo Bank		
			0.030% 期日 11/03/2014		77
					14,415
		米国短期国債	0.038% 期日 04/02/2015		191
		0.1%	0.049% 期日 01/22/2015		310
					501

短期証券合計	14,916
投資有価証券合計	14,916

関連ファンドに対する投資 99.4%

PIMCO Bermuda Income Fund (M)

895,589

(取得原価 USD 884,847)

(受益権口数 84,729,352)

関連ファンドに対する投資合計

895,589

## ピムコ・バミューダ・インカムファンド(M)

ピムコ・バミューダ・インカムファンド(M)は、バミューダ籍の外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

### 資産・負債計算書(2014年10月31日現在)

(単位：千米ドル、ただし一口当たりを除く)

#### 資産：

投資有価証券(時価)	944,654
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	711
OTC取引	13,332
現金	3
カウンターパーティー預け金	801
外国通貨(時価)	131
投資有価証券売却による未収入金	9,210
ファンド証券売却による未収入金	6,338
未収利息および未収配当金	5,452
	<u>980,632</u>

#### 負債：

リバースレポ契約未払金	125
空売り未払金	4,500
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	242
OTC取引	8,570
投資有価証券購入による未払金	28,291
未払利息	2
カウンターパーティー預り金	3,950
ファンド証券買戻しによる未払金	4,022
	<u>49,702</u>

#### 純資産

930,930

### 投資明細表(2014年10月31日現在)

業種	銘柄	額面金額		時価	
		通貨 (単位：千)	通貨 (単位：千)	通貨 (単位：千)	通貨 (単位：千)
投資有価証券	銀行貸付債				
	権証券				
101.5%	7.8%	AB Acquisitions	EUR	5,000	USD 6,272
		3.488% 期日 07/10/2017			
		Advantage Sales & Marketing, Inc.	USD	3	3
		3.250% 期日 07/23/2021			
		4.250% 期日 07/23/2021		163	161
		Albertson's LLC			
		4.000% 期日 08/25/2019		546	546
		4.500% 期日 08/25/2021		2,236	2,239

Amaya Holdings BV	5.000% 期日 08/01/2021	400	397
AWAS Aviation Capital Ltd.	4.870% 期日 10/02/2021	1,000	1,003
BMC Software Finance, Inc.	5.000% 期日 09/10/2020	299	296
Burger King Worldwide, Inc.	4.500% 期日 10/27/2021	1,090	1,091
Charter Communications Operating LLC	4.250% 期日 09/12/2021	568	573
Chrysler Group LLC	3.250% 期日 12/31/2018	1,097	1,089
Clear Channel Communication, Inc.	6.904% 期日 01/30/2019	11,248	10,655
CPG International	4.750% 期日 09/30/2020	100	99
CSC Holdings LLC	2.654% 期日 04/17/2020	1,061	1,040
DaVita HealthCare Partners, Inc.	3.500% 期日 06/24/2021	200	198
Delta 2 (Lux) S.a.r.l	4.750% 期日 07/30/2021	300	300
Energy Future Intermediate Holding Co. LLC	4.250% 期日 06/19/2016	25,588	25,568
ESH Hospitality, Inc.	5.000% 期日 06/24/2019	1,500	1,509
Expro Finservices S.a.r.l	5.750% 期日 09/02/2021	200	196
Gates Global LLC	4.250% 期日 07/05/2021	1,000	990
HCA, Inc.	2.983% 期日 05/01/2018	6,284	6,262
Hilton Worldwide, Inc.	3.500% 期日 10/26/2020	2,019	2,002
Mallinckrodt International Finance S.A.	3.500% 期日 03/19/2021	300	298
MGM Resorts International	3.500% 期日 12/20/2019	2,542	2,516
MPH Acquisition Holdings LLC	4.000% 期日 03/31/2021	567	560
Numericable U.S. LLC	4.500% 期日 05/21/2020	592	594
Ortho-Clinical Diagnostics Holdings Luxembourg S.A R.L	4.750% 期日 06/30/2021	299	296
Seadrill Operating LP	4.000% 期日 02/21/2021	149	142
Seventy Seven Operating LLC	3.750% 期日 06/25/2021	2,473	2,424
Styrolution Group GmbH	6.500% 期日 11/07/2019	800	784
Trans Union LLC	4.000% 期日 04/09/2021	995	982
Univision Communications, Inc.	4.000% 期日 03/01/2020	1,959	1,942

銀行貸付債権証券合計

(原価：73,529米ドル)

73,027

社債券等	銀行および金融					
32.8%	13.2%	AerCap Ireland Capital Ltd.	2.750% 期日 05/15/2017	USD	35	35
		AGFC Capital Trust	6.000% 期日 01/15/2067		2,200	1,864
		Ally Financial, Inc.	2.750% 期日 01/30/2017		430	432
			3.125% 期日 01/15/2016		200	203
			3.500% 期日 07/18/2016		150	153
			3.500% 期日 01/27/2019		300	303
			4.625% 期日 06/26/2015		5,120	5,238
			5.500% 期日 02/15/2017		185	197
			6.250% 期日 12/01/2017		2,190	2,393
		Banco Santander S.A.	6.250% 期日 09/11/2021	EUR	4,500	5,469
		Barclays Bank PLC	6.500% 期日 09/15/2019		700	859
			7.625% 期日 11/21/2022	USD	1,200	1,309
			14.000% 期日 06/15/2019	GBP	500	1,044
		Blackstone CQP Holdco LP	2.324% 期日 03/19/2019	USD	4,800	4,820
		Caixa Economica Federal	4.250% 期日 05/13/2019		160	162
		Cantor Commercial Real Estate Co. LP	7.750% 期日 02/15/2018		5,000	5,325
		CIT Group, Inc.	4.250% 期日 08/15/2017		40	41
			4.750% 期日 02/15/2015		3,200	3,230
			5.000% 期日 05/15/2017		1,000	1,050
			5.250% 期日 03/15/2018		10	11
			5.500% 期日 02/15/2019		1,000	1,070
		Cooperatieve Centrale Raiffeisen- Boerenleenbank BA	8.375% 期日 07/26/2016		3,100	3,333
			8.400% 期日 06/29/2017		600	662
		Credit Agricole S.A.	6.500% 期日 06/23/2021	EUR	300	384
			6.625% 期日 09/23/2019	USD	400	390
			7.875% 期日 01/23/2024		800	828
		Credit Suisse	0.535% 期日 03/11/2016		2,700	2,699
		Credit Suisse AG	6.500% 期日 08/08/2023		3,000	3,315
		Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd.	5.100% 期日 10/28/2024		200	206
		Eksporthfinans ASA	2.000% 期日 09/15/2015		1,303	1,306
			2.375% 期日 05/25/2016		500	501
			5.500% 期日 05/25/2016		800	841
		ERB Hellas PLC	4.250% 期日 06/26/2018	EUR	3,600	4,021
		General Motors Financial Co., Inc.	2.750% 期日 05/15/2016	USD	200	203
			6.750% 期日 06/01/2018		900	1,025
		HBOS PLC	0.933% 期日 09/30/2016		200	200
			0.967% 期日 09/01/2016	EUR	400	500

	HSBC Holdings PLC			
	5.250% 期日 09/16/2022		1,800	2,286
	International Lease Finance Corp.			
	4.875% 期日 04/01/2015	USD	300	304
	6.750% 期日 09/01/2016		500	532
	8.625% 期日 09/15/2015		100	105
	8.750% 期日 03/15/2017		1,100	1,240
	Jefferies Finance LLC			
	6.875% 期日 04/15/2022		1,000	972
	Jefferies LoanCore LLC			
	6.875% 期日 06/01/2020	USD	2,400 USD	2,346
	LBG Capital No.2 PLC			
	15.000% 期日 12/21/2019	EUR	1,400	2,593
	15.000% 期日 12/21/2019	GBP	1,500	3,360
	Lloyds Banking Group PLC			
	7.625% 期日 06/27/2023		500	810
	Navient Corp.			
	3.875% 期日 09/10/2015	USD	500	506
	6.000% 期日 01/25/2017		200	211
	6.250% 期日 01/25/2016		1,300	1,355
	8.450% 期日 06/15/2018		770	882
	Novo Banco S.A.			
	2.625% 期日 05/08/2017	EUR	3,100	3,523
	3.875% 期日 01/21/2015		50	62
	5.000% 期日 04/04/2019		18	21
	5.000% 期日 04/23/2019		4,458	5,263
	5.000% 期日 05/14/2019		79	93
	5.000% 期日 05/21/2019		200	233
	5.875% 期日 11/09/2015		800	977
	Royal Bank of Scotland PLC			
	6.934% 期日 04/09/2018		100	143
	9.500% 期日 03/16/2022	USD	1,800	2,061
	13.125% 期日 03/19/2022	AUD	3,700	3,821
	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
	3.352% 期日 11/15/2019	EUR	4,500	5,303
	5.717% 期日 06/16/2021	USD	1,300	1,273
	6.125% 期日 02/07/2022		5,600	5,621
	Springleaf Finance Corp.			
	5.400% 期日 12/01/2015		1,175	1,216
	6.900% 期日 12/15/2017		4,690	5,124
	Towergate Finance PLC			
	8.500% 期日 02/15/2018	GBP	2,900	3,967
	UBS AG			
	5.125% 期日 05/15/2024	USD	5,500	5,528
	7.625% 期日 08/17/2022		1,000	1,182
	Virgin Media Secured Finance PLC			
	5.500% 期日 01/15/2021	GBP	1,400	2,344
	Vnesheconombank Via VEB Finance PLC			
	5.450% 期日 11/22/2017	USD	100	100
	6.902% 期日 07/09/2020		1,600	1,640
				122,619
産業	AECOM Technology Corp.			
14.8%	5.750% 期日 10/15/2022		186	196
	5.875% 期日 10/15/2024		186	197
	Aeropuertos Dominicanos Siglo S.A.			
	9.750% 期日 11/13/2019		200	192
	Algeco Scotsman Global Finance PLC			

8.500% 期日 10/15/2018		1,000	1,045
Alliance Data Systems Corp.			
5.250% 期日 12/01/2017		1,245	1,289
5.375% 期日 08/01/2022		100	102
Altice S.A.			
7.250% 期日 05/15/2022	EUR	300	389
Ardagh Packaging Finance PLC			
4.250% 期日 01/15/2022		2,700	3,308
Armored Autogroup, Inc.			
9.250% 期日 11/01/2018	USD	1,000	1,020
Boxer Parent Co., Inc.			
9.000% 期日 10/15/2019		120	108
Building Materials Corporation of America			
7.500% 期日 03/15/2020		6,947	7,373
Caesars Entertainment Operating Co., Inc.			
8.500% 期日 02/15/2020		835	630
9.000% 期日 02/15/2020		866	658
California Resources Corp.			
5.000% 期日 01/15/2020		3,900	3,968
5.500% 期日 09/15/2021	USD	3,900	3,983
Cemex SAB de C.V.			
4.750% 期日 01/11/2022	EUR	267	335
5.233% 期日 09/30/2015	USD	3,000	3,072
CNPC HK Overseas Capital Ltd.			
3.125% 期日 04/28/2016		210	215
Constellation Brands, Inc.			
8.375% 期日 12/15/2014		7,300	7,362
DISH DBS Corp.			
7.125% 期日 02/01/2016		700	746
7.750% 期日 05/31/2015		800	830
DR Horton, Inc.			
5.625% 期日 01/15/2016		1,100	1,151
Gulfport Energy Corp.			
7.750% 期日 11/01/2020		3,610	3,700
HCA, Inc.			
3.750% 期日 03/15/2019		1,045	1,050
6.375% 期日 01/15/2015		100	101
6.500% 期日 02/15/2016		500	529
7.190% 期日 11/15/2015		100	105
7.250% 期日 09/15/2020		500	531
Hellenic Railways Organization S.A.			
4.500% 期日 12/06/2016	JPY	26,000	220
Hema Bondco BV			
5.334% 期日 06/15/2019	EUR	100	108
iHeartCommunications, Inc.			
9.000% 期日 03/01/2021	USD	789	792
9.000% 期日 09/15/2022		600	604
IHS, Inc.			
5.000% 期日 11/01/2022		100	102
Intrepid Aviation Group Holdings LLC			
6.875% 期日 02/15/2019		2,326	2,314
Masonite International Corp.			
8.250% 期日 04/15/2021		400	430
MGM Resorts International			
7.500% 期日 06/01/2016		2,000	2,155
Nara Cable Funding Ltd.			
8.875% 期日 12/01/2018	EUR	3,400	4,474



Numericable Group S.A.				
4.875%	期日 05/15/2019	USD	2,210	2,213
5.375%	期日 05/15/2022	EUR	200	261
5.625%	期日 05/15/2024		4,220	5,492
Perstorp Holding AB				
8.750%	期日 05/15/2017	USD	3,400	3,468
9.000%	期日 05/15/2017	EUR	4,400	5,678
Pertamina Persero PT				
6.450%	期日 05/30/2044	USD	200	214
Petrobras International Finance Co. S.A.				
7.875%	期日 03/15/2019		2,000	2,303
QVC, Inc.				
4.450%	期日 02/15/2025		100	98
5.450%	期日 08/15/2034		100	97
Russian Railways via RZD Capital PLC				
3.374%	期日 05/20/2021	EUR	300	354
5.700%	期日 04/05/2022	USD	800	798
5.739%	期日 04/03/2017		800	828
7.487%	期日 03/25/2031	GBP	6,300	10,432
Schaeffler Holding Finance BV				
5.750%	期日 11/15/2021	EUR	184	239
6.875%	期日 08/15/2018		2,500	3,297
Spanish Broadcasting System, Inc.				
12.500%	期日 04/15/2017	USD	900	970
Spirit Issuer PLC				
3.265%	期日 12/28/2031	GBP	760	1,149
6.582%	期日 12/28/2027		300	499
Tata Motors Ltd.				
4.625%	期日 04/30/2020	USD	610	623
Telenet Finance Luxembourg S.C.A.				
6.375%	期日 11/15/2020	EUR	5,000 USD	6,656
Tenet Healthcare Corp.				
4.500%	期日 04/01/2021	USD	800	805
TES Finance PLC				
6.750%	期日 07/15/2020	GBP	300	446
Tesoro Logistics LP				
5.500%	期日 10/15/2019	USD	50	52
6.250%	期日 10/15/2022		120	125
Times Square Hotel Trust				
8.528%	期日 08/01/2026		2,439	3,094
T-Mobile USA, Inc.				
6.000%	期日 03/01/2023		1,000	1,033
6.375%	期日 03/01/2025		1,900	1,957
Trinseo Materials Operating S.C.A.				
8.750%	期日 02/01/2019		1,783	1,890
Unique Pub Finance Co. PLC				
6.542%	期日 03/30/2021	GBP	893	1,510
Unitymedia KabelBW GmbH				
9.500%	期日 03/15/2021	EUR	4,000	5,644
9.625%	期日 12/01/2019		700	926
Universal Health Services, Inc.				
3.750%	期日 08/01/2019	USD	100	101
Univision Communications, Inc.				
5.125%	期日 05/15/2023		20	21
6.750%	期日 09/15/2022		30	33
7.875%	期日 11/01/2020		70	76
UPCB Finance Ltd.				

	6.375% 期日 07/01/2020	EUR	7,350	9,704
	USG Corp.			
	9.750% 期日 01/15/2018	USD	3,370	3,901
	Valeant Pharmaceuticals International			
	6.875% 期日 12/01/2018		3,300	3,428
	W.R. Grace & Co.-Conn			
	5.125% 期日 10/01/2021		200	209
	5.625% 期日 10/01/2024		75	79
	Whiting Petroleum Corp.			
	5.000% 期日 03/15/2019		500	520
	Wind Acquisition Finance S.A.			
	4.000% 期日 07/15/2020	EUR	400	496
	4.082% 期日 07/15/2020		100	124
	WPX Energy, Inc.			
	5.250% 期日 09/15/2024	USD	378	369
				137,596
公共事業	AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.			
4.8%	8.700% 期日 08/07/2018		200	223
	Dynegy Finance, Inc.			
	6.750% 期日 11/01/2019		1,305	1,352
	7.375% 期日 11/01/2022		1,240	1,313
	7.625% 期日 11/01/2024		205	218
	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
	4.375% 期日 09/19/2022		3,950	3,510
	6.000% 期日 11/27/2023		5,100	4,960
	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.			
	4.950% 期日 05/23/2016		300	306
	4.950% 期日 02/06/2028		800	712
	5.092% 期日 11/29/2015		400	407
	5.999% 期日 01/23/2021		1,622	1,659
	6.510% 期日 03/07/2022		2,000	2,098
	6.605% 期日 02/13/2018	EUR	100	135
	7.288% 期日 08/16/2037	USD	937	1,005
	8.125% 期日 02/04/2015	EUR	100	127
	8.146% 期日 04/11/2018	USD	100	111
	8.625% 期日 04/28/2034		2,622	3,096
	9.250% 期日 04/23/2019		7,000	8,121
	Illinois Power Generating Co.			
	6.300% 期日 04/01/2020		35	32
	7.000% 期日 04/15/2018	USD	5,000	4,800
	NGPL PipeCo LLC			
	7.768% 期日 12/15/2037		881	916
	Novatek OAO via Novatek Finance Ltd.			
	4.422% 期日 12/13/2022		1,000	888
	Petrobras Global Finance BV			
	1.852% 期日 05/20/2016		5,000	5,013
	Rosneft Oil Co. via Rosneft International			
	Finance Ltd.			
	4.199% 期日 03/06/2022		200	176
	Sprint Communications, Inc.			
	6.000% 期日 12/01/2016		1,500	1,591
	9.125% 期日 03/01/2017		1,400	1,586
	Sprint Corp.			
	7.125% 期日 06/15/2024		400	413
	Targa Resources Partners LP			
	4.125% 期日 11/15/2019		180	183
	Verizon Communications, Inc.			

	3.500% 期日 11/01/2024		192	189
	4.400% 期日 11/01/2034		192	188
				45,328
		社債券等合計		
		(原価：312,803米ドル)		305,543
米国政府機 関債	Freddie Mac			
0.0%	6.397% 期日 06/15/2042		151	34
		米国政府機関債合計		
		(原価：38米ドル)		34
米国財務省 証券	Treasury Inflation Protected Securities			
2.9%	2.375% 期日 01/15/2025		22,335	26,520
		米国財務省証券合計		
		(原価：26,577米ドル)		26,520
モーゲージ 証券	ABFC Trust			
36.4%	0.887% 期日 06/25/2035		5,000	3,690
	Accredited Mortgage Loan Trust			
	0.412% 期日 09/25/2036		12,600	10,587
	ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
	0.307% 期日 08/25/2036		7,618	6,541
	Aggregator of Loans Backed by Assets PLC			
	2.813% 期日 12/16/2042	GBP	2,016	3,285
	Alternative Loan Trust			
	2.386% 期日 09/25/2034	USD	4,537	4,378
	2.459% 期日 08/25/2035		2,002	1,761
	5.500% 期日 08/25/2035		246	237
	5.500% 期日 02/25/2036		56	51
	6.000% 期日 07/25/2037		147	143
	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset- Backed Pass-Through Certificates			
	0.835% 期日 09/25/2033		104	99
	1.226% 期日 09/25/2032		1,142	1,046
	1.907% 期日 10/25/2034		9,000	6,420
	Argent Securities, Inc.			
	2.855% 期日 09/25/2033		2,992	2,888
	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
	0.902% 期日 03/25/2035		3,924	3,791
	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust			
	0.954% 期日 06/15/2028		5,000	4,991
	Banc of America Alternative Loan Trust			
	5.860% 期日 04/25/2022		822	834
	Banc of America Commercial Mortgage Trust			
	0.352% 期日 09/10/2045		5,167	5,166
	Banc of America Funding Ltd.			
	0.377% 期日 11/03/2041		4,766	4,717
	Banc of America Mortgage Trust			
	5.500% 期日 11/25/2035		160	160
	BCAP LLC Trust			
	0.312% 期日 03/26/2037	USD	3,630	3,548
	0.354% 期日 07/26/2036		1,861	1,777
	0.672% 期日 11/26/2035		2,027	1,991
	0.895% 期日 01/26/2036		2,796	2,761
	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			

2.607% 期日 11/25/2034		65	63
3.012% 期日 11/25/2034		36	37
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
0.392% 期日 02/25/2037		15,668	12,602
0.585% 期日 12/25/2035		9,109	8,229
0.655% 期日 12/25/2035		6,400	5,799
0.855% 期日 11/25/2035		5,910	4,974
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
0.412% 期日 10/25/2036		10,873	10,343
Centex Home Equity Loan Trust			
0.582% 期日 03/25/2035		5,514	4,463
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
0.512% 期日 03/25/2035		1,786	1,616
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
0.095% 期日 03/10/2047		25,400	511
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
0.462% 期日 12/25/2035		18,812	17,520
0.552% 期日 05/25/2035		53	53
2.354% 期日 08/25/2036		9,000	7,362
Commercial Mortgage Trust			
0.151% 期日 04/10/2047		33,000	497
Countrywide Asset-Backed Certificates			
0.322% 期日 06/25/2047		12,159	10,862
0.652% 期日 08/26/2033		44	38
1.757% 期日 01/25/2034		2,447	2,294
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2.431% 期日 11/25/2034		43	41
2.470% 期日 06/25/2034		6	6
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
0.305% 期日 03/27/2036		2,967	2,906
1.686% 期日 04/15/2027		60,000	1,498
5.691% 期日 10/26/2036		895	707
Deco 10 - Pan Europe 4 PLC			
0.285% 期日 10/27/2019	EUR	8,689	10,603
Deco 7-Pan Europe 2 PLC			
0.485% 期日 01/27/2018		222	277
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
0.408% 期日 11/27/2036	USD	8,706	7,327
Deutsche Mortgage Securities, Inc. REMIC Trust			
3.817% 期日 06/28/2047		577	577
Eurosail-UK PLC			
1.333% 期日 09/13/2045	GBP	610	942
First Franklin Mortgage Loan Trust			
0.302% 期日 07/25/2036	USD	3,654	3,479
GE Business Loan Trust			
0.583% 期日 04/15/2031		512	495
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
0.432% 期日 11/25/2045		161	107
GSAA Home Equity Trust			
6.500% 期日 11/25/2037		40	33
GSAMP Trust			
0.312% 期日 05/25/2046		2,973	2,557
HarborView Mortgage Loan Trust			
0.397% 期日 12/19/2036		922	659

Hercules Eclipse PLC				
0.797% 期日 10/25/2018	GBP	4,573		7,181
Home Equity Asset Trust				
0.462% 期日 07/25/2036	USD	1,320		1,292
Jefferies Resecuritization Trust				
6.005% 期日 06/25/2047	USD	1,922	USD	1,914
JP Morgan Alternative Loan Trust				
2.636% 期日 03/25/2036		1,348		1,081
5.730% 期日 03/25/2036		3,408		3,057
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
4.936% 期日 08/15/2042		8,869		9,021
5.757% 期日 12/12/2034		78		83
JP Morgan Mortgage Acquisition Trust				
0.212% 期日 03/25/2047		59		58
0.325% 期日 04/25/2036		2,592		2,549
0.422% 期日 08/25/2036		8,600		5,830
Lehman XS Trust				
0.302% 期日 07/25/2047		3,778		3,649
0.422% 期日 02/25/2036		292		253
London & Regional Debt Securitisation No.1 PLC				
4.810% 期日 10/15/2017	GBP	570		921
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
0.372% 期日 11/25/2036	USD	52		36
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
2.317% 期日 04/25/2034		7		7
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
2.220% 期日 02/25/2033		54		52
Morgan Stanley ABS Capital , Inc. Trust				
1.152% 期日 03/25/2033		228		217
Morgan Stanley Dean Witter Capital Trust				
7.504% 期日 07/15/2033		2,019		2,321
Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates				
6.450% 期日 01/22/2026		1,072		1,183
Nomura Resecuritization Trust				
2.453% 期日 11/26/2036		13,544		13,307
Option One Mortgage Loan Trust				
0.252% 期日 02/25/2037		7,452		4,368
RBSCF Trust				
5.509% 期日 04/16/2047		25		27
RBSGC Mortgage Loan Trust				
6.000% 期日 01/25/2037		34		31
RBSSP Resecuritization Trust				
0.652% 期日 03/26/2036		217		212
0.652% 期日 04/26/2037		647		605
Renaissance Home Equity Loan Trust				
0.512% 期日 11/25/2034		86		74
1.152% 期日 09/25/2037		96		76
5.612% 期日 04/25/2037		740		421
Residential Accredited Securities Corporation Trust				
0.302% 期日 01/25/2037		5,027		4,728
0.920% 期日 03/25/2034		2,440		2,277
Residential Asset Mortgage Products Trust				
0.372% 期日 10/25/2034		18,053		16,488

	0.592% 期日 10/25/2035		5,000	4,527
	Saxon Asset Securities Trust			
	1.205% 期日 06/25/2033		2,524	2,349
	Sequoia Mortgage Trust			
	0.677% 期日 06/20/2034		123	121
	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
	0.802% 期日 12/25/2035		4,670	4,312
	SRERS Funding Ltd.			
	0.403% 期日 05/09/2046		10,485	9,960
	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
	0.472% 期日 10/25/2035		19,532	16,630
	1.516% 期日 05/25/2035		246	163
	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
	0.737% 期日 07/19/2034		18	18
	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
	0.817% 期日 09/19/2032	USD	76 USD	74
	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
	0.412% 期日 04/25/2036		1,700	1,540
	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
	5.500% 期日 07/25/2033		45	45
	Taurus CMBS UK Ltd.			
	1.960% 期日 05/01/2022	GBP	2,887	4,643
	Titan Europe Ltd.			
	0.302% 期日 04/23/2017	EUR	1,229	1,506
	Ulysses European Loan Conduit No.27 PLC			
	0.717% 期日 07/25/2017	GBP	6,300	9,815
	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
	0.512% 期日 01/25/2045	USD	307	281
	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
	0.422% 期日 07/25/2036		10,000	8,348
	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
	2.620% 期日 10/25/2036		93	88
	WFRBS Commercial Mortgage Trust			
	0.432% 期日 03/15/2047		8,800	350
	モーゲージ証券合計			
	(原価：339,756米ドル)			338,428
資産担保証券	Alzette European CLO S.A.			
8.0%	1.234% 期日 12/15/2020	EUR	1,341	1,678
	Attentus CDO Ltd.			
	0.471% 期日 10/09/2041	USD	11,086	10,531
	Boyne Valley BV			
	0.527% 期日 02/12/2022	EUR	345	433
	Capmark -CRE Delaware Corp.			
	0.443% 期日 08/15/2036	USD	4,346	4,269
	CREST Ltd.			
	1.988% 期日 05/28/2038		309	307
	5.712% 期日 05/28/2038		130	131
	Dalradian European CLO BV			
	0.578% 期日 04/11/2023	EUR	2,000	2,487
	Dalradian European CLO BV			

	1.106% 期日 08/08/2023		4,000	4,948
	Dureve Ltd.			
	0.701% 期日 11/01/2095		1,447	1,762
	Egret Funding CLO PLC			
	0.759% 期日 12/20/2022		660	802
	Eurocredit CDO BV			
	1.489% 期日 02/22/2020		2,200	2,759
	Fairfield Street Solar Ltd.			
	0.588% 期日 11/28/2039	USD	4,805	4,578
	Gallatin CLO Ltd.			
	1.501% 期日 07/15/2023		3,000	2,994
	Halcyon Structured Asset Management European CLO BV			
	0.488% 期日 06/21/2021	EUR	6,015	7,469
	Halcyon Structured Asset Management Long Secured			
	0.462% 期日 08/07/2021	USD	76	76
	Harbourmaster CLO 11 BV			
	1.698% 期日 11/17/2024	EUR	2,650	3,315
	Harbourmaster CLO 5 BV			
	0.484% 期日 06/15/2020		3,900	4,864
	Jubilee CDO BV			
	0.932% 期日 10/15/2019		1,383	1,729
	Leopard CLO BV			
	1.881% 期日 04/07/2019		1,768	2,205
	National Collegiate Student Loan Trust			
	0.282% 期日 06/26/2028	USD	3,669	3,534
	Pangaea ABS SPV			
	0.342% 期日 12/28/2096	EUR	126	146
	RMF Euro CDO PLC			
	0.591% 期日 09/11/2022		6,560	7,998
	South Coast Funding Ltd.			
	1.471% 期日 10/05/2038	USD	753 USD	752
	SpringCastle America Funding LLC			
	2.700% 期日 05/25/2023		1,300	1,303
	Wood Street CLO BV			
	0.688% 期日 08/27/2022	EUR	2,700	3,308
	資産担保証券合計			
	(原価：77,563米ドル)			74,378
ソブリン債	Corp. Andina De Fomento			
0.7%	3.950% 期日 10/15/2021	MXN	624	47
	Costa Rica Government International Bond			
	7.000% 期日 04/04/2044	USD	200	207
	Greece Government International Bond			
	4.500% 期日 11/08/2016	JPY	50,000	426
	5.000% 期日 08/22/2016		41,300	358
	5.250% 期日 02/01/2016		45,200	396
	Indonesia Government International Bond			
	2.875% 期日 07/08/2021	EUR	2,600	3,315
	Russia Government International Bond			
	5.625% 期日 04/04/2042	USD	2,000	2,033
	7.500% 期日 03/31/2030		58	66
	ソブリン債合計			
	(原価：7,170米ドル)			6,848
		株式数		
優先証券	Citigroup, Inc.			
0.4%	5.800% 期日 11/15/2019		600	60

		Entergy Texas, Inc.				
		5.625% 期日 06/01/2064			76,000	1,946
		JPMorgan Chase & Co.				
		5.000% 期日 07/01/2019			1,300	129
		6.100% 期日 10/01/2024			12,000	1,206
				優先証券合計		
				(原価：3,290米ドル)		3,341
					額面金額	
					通貨 (単位：千)	
短期証券	コマーシャル ペーパー	Fannie Mae				
12.5%	8.8%	0.070% 期日 04/27/2015		USD	10,400	10,397
		0.077% 期日 05/01/2015			3,300	3,299
		0.080% 期日 02/11/2015			5,200	5,199
		0.100% 期日 02/17/2015			600	600
		0.110% 期日 03/02/2015			3,100	3,100
		Federal Home Loan Bank				
		0.080% 期日 02/20/2015			4,100	4,100
		0.085% 期日 02/23/2015			100	100
		0.097% 期日 02/04/2015			1,900	1,900
		0.100% 期日 02/25/2015			500	500
		0.170% 期日 09/04/2015			1,000	999
		0.170% 期日 09/09/2015			2,700	2,698
		Freddie Mac				
		0.070% 期日 03/25/2015			600	600
		0.070% 期日 04/02/2015			11,200	11,198
		0.070% 期日 04/08/2015			4,200	4,199
		0.070% 期日 04/09/2015			22,300	22,295
		0.070% 期日 04/10/2015			5,600	5,599
		0.075% 期日 05/05/2015			2,900	2,899
		0.150% 期日 07/07/2015			1,900	1,899
						81,581
		レボ取引				
		2.1%			USD	19,600
		定期性預金				
		0.6%	ANZ National Bank			
		0.030% 期日 11/03/2014		USD	698	698
		0.091% 期日 11/03/2014		GBP	61	97
		Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.				
		0.005% 期日 11/04/2014		JPY	2,389	21
		0.030% 期日 11/03/2014		USD	219	219
		Brown Brothers Harriman & Co.				
		(0.110%) 期日 11/03/2014		EUR	1	1
		0.005% 期日 11/04/2014		JPY	18	0
		0.030% 期日 11/03/2014		USD	2	2
		0.091% 期日 11/03/2014		GBP	0	1
		1.799% 期日 11/03/2014		AUD	3	3
		Citibank N.A.				
		0.030% 期日 11/03/2014		USD	1,022	1,022
		DBS Bank Ltd.				
		0.030% 期日 11/03/2014			1,481	1,481
		DnB NORBank ASA				
		(0.110%) 期日 11/03/2014		EUR	102	128
		0.030% 期日 11/03/2014		USD	769	769
		1.799% 期日 11/03/2014		AUD	809	711
		HSBC Bank				
		0.091% 期日 11/03/2014		GBP	65	104
		National Australia Bank Ltd.				



	(0.110%) 期日 11/03/2014	EUR	4	5
	Nordea Bank AB			
	0.005% 期日 11/04/2014	JPY	378	3
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
	(0.110%) 期日 11/03/2014	EUR	319	400
	0.005% 期日 11/04/2014	JPY	41	0
	Wells Fargo Bank			
	(0.110%) 期日 11/03/2014	EUR	261	327
	0.030% 期日 11/03/2014	USD	22	22
				6,014
米国短期国債	0.020% 期日 11/06/2014		1,700	1,700
1.0%	0.021% 期日 01/02/2015		412	412
	0.032% 期日 01/08/2015		1,746	1,746
	0.040% 期日 03/12/2015		707	707
	0.042% 期日 02/12/2015		1,943	1,943
	0.043% 期日 01/22/2015		1,290	1,290
	0.048% 期日 02/26/2015		1,542	1,542
				9,340
				短期証券合計
				(原価: 116,522米ドル)
				116,535
				投資有価証券合計 101.5%
				(原価: 957,248米ドル)
		USD	944,654	
				金融デリバティブ商品 0.6%
				(原価またはプレミアム、純額(6,798)米ドル)
				5,231
				その他の資産および負債(純額)(2.0%)
				(18,955)
				純資産 100.0%
		USD	930,930	

## マネー・マーケット・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成27年 5月12日現在) (平成27年11月12日現在)

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	964,302	1,359,558
国債証券	95,832,204	91,524,340
未収利息	131,472	260,392
前払費用	183,007	4,602
流動資産合計	97,110,985	93,148,892
資産合計	97,110,985	93,148,892
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	96,769,791	92,824,171
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	341,194	324,721
元本等合計	97,110,985	93,148,892
純資産合計	97,110,985	93,148,892
負債純資産合計	97,110,985	93,148,892

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年 5月12日現在）	（平成27年11月12日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	96,769,791口	92,824,171口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0035円 (10,000口当たりの純資産額 10,035円)	1口当たり純資産額 1.0035円 (10,000口当たりの純資産額 10,035円)

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成27年11月12日現在)
-----	-----------------

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成27年 5月12日現在)	
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	92,743,477円
同期中における追加設定元本額	4,026,314円
同期中における一部解約元本額	-円
平成27年 5月12日現在における元本の内訳	
日興ワールドC Bファンド(通貨アルファ戦略コース)	70,000,000円
日興ワールドC Bファンド(円ヘッジありコース)	9,500,000円
日興ワールドC Bファンド(円ヘッジなしコース)	9,800,000円
インド内需関連株式ファンド	10,000円
アセアン内需関連株式ファンド	10,000円
チャイナ内需関連株式ファンド	10,000円
韓国内需関連株式ファンド	10,000円
高成長インド・中型株式ファンド	49,986円
アジア好利回りリート・ファンド	99,971円
アジア好利回りリート・ファンド・トルコリラ	99,971円
アジア好利回りリート・ファンド・ブラジルリアル	499,851円
米国ハイインカム・ローン・ファンド(為替ヘッジ型)	499,102円
ヨーロッパ・割安戦略株式ファンド(為替ヘッジなし)	1,995,013円

ヨーロッパ・割安戦略株式ファンド(為替ヘッジあり)	99,751円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)	9,972円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし)	9,972円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ)	9,972円
三井住友・ニュー・アジア・ファンド	9,967円
YOURMIRAI フレキシブル・ボンドアロケーション(為替ヘッジなし)	9,967円
YOURMIRAI フレキシブル・ボンドアロケーション(米ドル円ヘッジ)	9,967円
S M A M ・ニュー・アジア・株式ファンド<適格機関投資家限定>	3,996,413円
合計	96,769,791円

(平成27年11月12日現在)

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	96,769,791円
同期中における追加設定元本額	60,793円
同期中における一部解約元本額	4,006,413円
平成27年11月12日現在における元本の内訳	
日興ワールドCBファンド(通貨アルファ戦略コース)	70,000,000円
日興ワールドCBファンド(円ヘッジありコース)	9,500,000円
日興ワールドCBファンド(円ヘッジなしコース)	9,800,000円
インド内需関連株式ファンド	10,000円
アセアン内需関連株式ファンド	10,000円
韓国内需関連株式ファンド	10,000円
高成長インド・中型株式ファンド	49,986円
アジア好利回りリート・ファンド	99,971円
アジア好利回りリート・ファンド・トルコリラ	99,971円
アジア好利回りリート・ファンド・ブラジルリアル	499,851円
米国ハイインカム・ローン・ファンド(為替ヘッジ型)	499,102円
ヨーロッパ・割安戦略株式ファンド(為替ヘッジなし)	1,995,013円
ヨーロッパ・割安戦略株式ファンド(為替ヘッジあり)	99,751円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)	9,972円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし)	9,972円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ)	9,972円
三井住友・ニュー・アジア・ファンド	9,967円
YOURMIRAI フレキシブル・ボンドアロケーション(為替ヘッジなし)	9,967円
YOURMIRAI フレキシブル・ボンドアロケーション(米ドル円ヘッジ)	9,967円
アジア好利回りリート・ファンド(年1回決算型)	997円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし/年2回決算型)	9,966円

日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ/年2回決算型)	9,966円
日興フィデリティ世界企業債券ファンド(為替ヘッジあり)	9,966円
日興フィデリティ世界企業債券ファンド(為替ヘッジなし)	9,966円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド(為替ヘッジあり)	9,966円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド(為替ヘッジなし)	9,966円
合計	92,824,171円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第335回利付国債(2年)	30,000,000	30,002,400	
	第338回利付国債(2年)	15,200,000	15,205,168	
	第276回利付国債(10年)	15,300,000	15,322,797	
	第280回利付国債(10年)	15,300,000	15,473,196	
	第282回利付国債(10年)	15,300,000	15,520,779	
合計		91,100,000	91,524,340	

### 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】

<更新後>

### 【純資産額計算書】

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)

平成27年11月30日現在

資産総額	1,395,231,341円
負債総額	1,249,181円
純資産総額( - )	1,393,982,160円
発行済口数	1,420,174,391口
1口当たり純資産額( / )	0.9816円

(1万口当たり純資産額)	(9,816円)
--------------	----------

## 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)

平成27年11月30日現在

資産総額	18,219,588,017円
負債総額	102,490,056円
純資産総額( - )	18,117,097,961円
発行済口数	18,186,751,626口
1口当たり純資産額( / )	0.9962円
(1万口当たり純資産額)	(9,962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>

###### イ 資本金の額および株式数

	平成27年11月30日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

###### ハ 会社の機構

委託会社の取締役は7名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

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

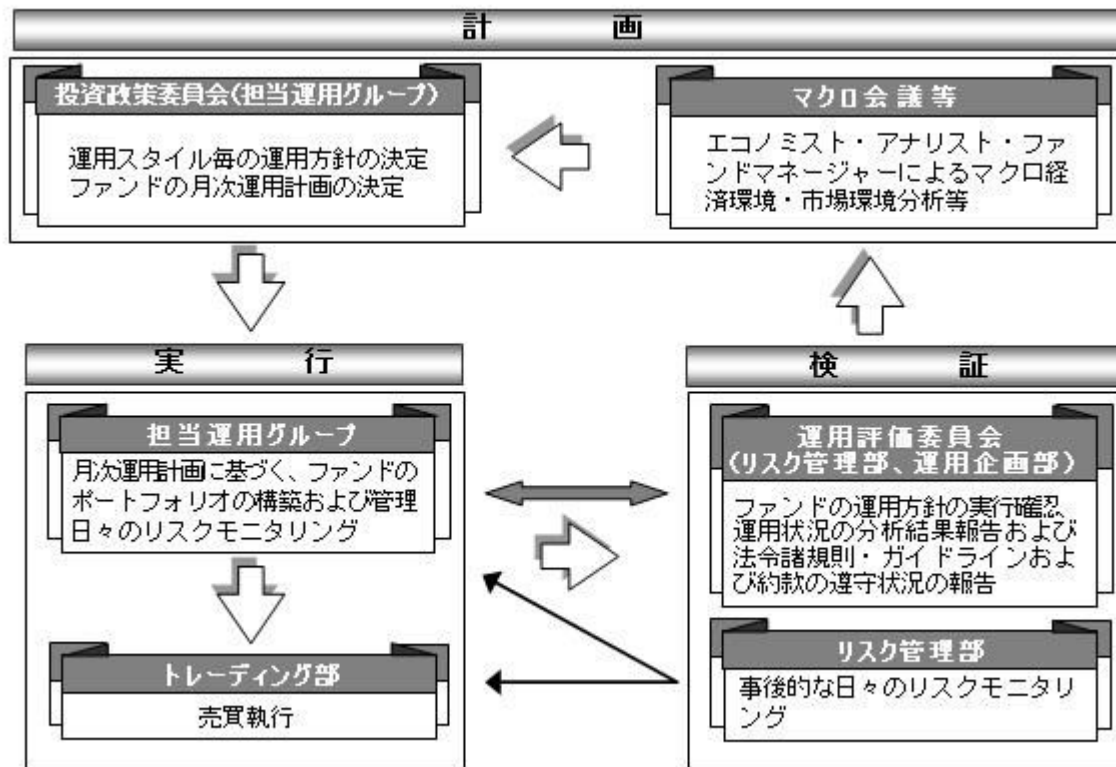
委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

###### ニ 投資信託の運用の流れ





## 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

平成27年11月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成27年11月30日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	50 ( 13 )	159,994 ( 52,202 )
	追加型	462 ( 186 )	5,192,745 ( 2,862,862 )
	計	512 ( 199 )	5,352,739 ( 2,915,063 )
公社債投資信託	単位型	44 ( 44 )	191,690 ( 191,690 )
	追加型	4 ( 1 )	255,686 ( 176,487 )
	計	48 ( 45 )	447,376 ( 368,177 )
合 計		560 ( 244 )	5,800,115 ( 3,283,241 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

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

2 当社は、第30期（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は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第31期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（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	2	20,615,467	25,021,336
有価証券		4,999,802	-
前払費用		257,741	291,119
未収入金		4,026	41,860
未収委託者報酬		4,128,531	4,897,032
未収運用受託報酬		934,710	1,000,744
未収投資助言報酬	2	453,941	455,390
未収収益		11,700	13,030
繰延税金資産		548,658	475,859
その他の流動資産		4,577	52,473
流動資産合計		31,959,157	32,248,847
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		124,723	120,234
器具備品		204,970	230,712
有形固定資産合計		329,694	350,947
無形固定資産			
ソフトウェア		517,480	497,668
ソフトウェア仮勘定		4,595	77,155
電話加入権		103	91
商標権		468	222
無形固定資産合計		522,646	575,137
投資その他の資産			
投資有価証券		6,843,224	7,151,933
関係会社株式		353,036	509,146
長期差入保証金		541,904	600,480
長期前払費用		41,193	36,031
会員権		9,480	17,299

繰延税金資産	463,476	665,425
投資その他の資産合計	8,252,316	8,980,317
固定資産合計	9,104,657	9,906,402
資産合計	41,063,815	42,155,249

(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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	61,327	82,723
未払金		
未払収益分配金	671	711
未払償還金	143,230	143,201
未払手数料	2,138,441	2,338,432
その他未払金	203,170	1,075,587
未払費用	1,615,419	2,095,111
未払消費税等	215,390	478,421
未払法人税等	1,623,022	454,520
賞与引当金	926,263	906,623
その他の流動負債	8	808
流動負債合計	6,926,944	7,576,142
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,802,340	2,633,080
固定負債合計	1,802,340	2,633,080
負債合計	8,729,285	10,209,222
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	19,227,103	18,861,359
利益剰余金合計	21,048,308	20,682,564
株主資本計	31,677,292	31,311,548
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券		
評価差額金	657,238	634,478
評価・換算差額等合計	657,238	634,478
純資産合計	32,334,530	31,946,027
負債・純資産合計	41,063,815	42,155,249

## (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	30,300,842		30,094,858	
運用受託報酬	3,773,696		3,862,895	
投資助言報酬	2,117,669		2,106,161	
その他営業収益				
情報提供コンサルタント 業務報酬	5,000		5,000	
投資法人運用受託報酬	26,625		27,345	
サービス支援手数料	24,883		18,274	
その他	56,406		52,255	
営業収益計	36,305,122		36,166,790	
営業費用				
支払手数料	15,695,322		15,123,724	
広告宣伝費	276,591		407,991	
公告費	5,637		4,737	
調査費				
調査費	1,028,700		1,319,743	
委託調査費	3,053,376		3,550,675	
営業雑経費				
通信費	38,776		38,911	
印刷費	262,934		294,002	
協会費	14,337		26,955	
諸会費	32,186		18,577	
情報機器関連費	2,277,699		2,403,857	
販売促進費	40,388		28,281	
その他	117,451		144,250	
営業費用合計	22,843,403		23,361,707	
一般管理費				
給料				
役員報酬	140,440		190,241	
給料・手当	4,900,885		5,186,853	
賞与	786,372		569,685	
賞与引当金繰入額	926,263		906,623	
交際費	24,915		22,609	
寄付金	82		-	
事務委託費	303,945		366,661	
旅費交通費	196,933		226,254	
租税公課	100,575		108,953	
不動産賃借料	546,821		552,589	
退職給付費用	330,002		387,799	
固定資産減価償却費	227,090		287,833	
諸経費	258,736		283,156	
一般管理費合計	8,743,067		9,089,262	
営業利益	4,718,652		3,715,820	
営業外収益				
受取配当金	50,559		26,821	

有価証券利息		2,660	1,187
受取利息	1	5,190	6,113
時効成立分配金・償還金		5,958	12
原稿・講演料		2,456	1,899
還付加算金		182	-
雑収入		3,692	7,324
営業外収益合計		70,701	43,357
営業外費用			
為替差損		29,406	14,361
雑損失		38	-
営業外費用合計		29,444	14,361
経常利益		4,759,909	3,744,816
特別利益			
投資有価証券償還益		8,250	4,181
投資有価証券売却益		310,894	893,251
負ののれん発生益		186,047	-
企業結合に係る 特定勘定取崩益		2,870	-
特別利益合計		508,062	897,432
特別損失			
固定資産除却損	2	6,717	1,076
投資有価証券償還損		2,337	-
投資有価証券評価損		1,280	-
投資有価証券売却損		454	1,091
合併関連費用		17,767	-
事務所移転費用		1,313	-
その他の特別損失	3	-	973,862
特別損失合計		29,870	976,030
税引前当期純利益		5,238,102	3,666,218
法人税、住民税及び事業税		2,147,762	1,574,213
法人税等調整額		282,886	166,505
法人税等合計		1,864,875	1,740,718
当期純利益		3,373,226	1,925,499

## (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				株主資本 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	16,718,237	18,539,441	29,168,425
当期変動額									
剰余金の配当							864,360	864,360	864,360
当期純利益							3,373,226	3,373,226	3,373,226
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,508,866	2,508,866	2,508,866
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	529,488	529,488	29,697,914
当期変動額			
剰余金の配当			864,360
当期純利益			3,373,226
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	127,749	127,749	127,749
当期変動額合計	127,749	127,749	2,636,616
当期末残高	657,238	657,238	32,334,530

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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更 による累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	73,299	73,299	73,299
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更 による累積的影響額			439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当期変動額			
剰余金の配当			1,852,200
当期純利益			1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	22,759	22,759	22,759
当期変動額合計	22,759	22,759	50,540
当期末残高	634,478	634,478	31,946,027

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

## (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (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いたしました。

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繰越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退職給付引当金が682,168千円、繰延税金資産が243,124千円増加し、繰越利益剰余金が439,043千円減少しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28,067千円減少しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

#### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	241,339千円	258,412千円
器具備品	704,790千円	783,602千円

##### 2 関係会社に対する資産及び負債

	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)
現金及び預金	14,959,545千円	18,853,119千円
未収投資助言報酬	290,426千円	286,990千円
未払手数料	360,659千円	392,772千円

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

##### 4 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、前事業年度は平成27年6月まで、当事業年度は平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	27,470千円	355,376千円

#### (損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自 平成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)
受取利息	2,104千円	2,463千円

##### 2 固定資産除却損



	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)
器具備品	864千円	1,076千円
ソフトウェア	5,853千円	- 千円
計	6,717千円	1,076千円

### 3 その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

#### 1. 発行済株式数に関する事項

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

#### 2. 剰余金の配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	864,360	49,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成26年 6月26日開催の第29回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年 6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27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. 発行済株式数に関する事項

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

#### 2. 剰余金の配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年 6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成27年 6月30日開催の第30回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年 6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月 1日

## (リース取引関係)

## オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1年以内	525,188	572,402
1年超	751,482	1,340,637
合計	1,276,671	1,913,040

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、

これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,615,467	20,615,467	-
(2)未収委託者報酬	4,128,531	4,128,531	-
(3)未収運用受託報酬	934,710	934,710	-
(4)未収投資助言報酬	453,941	453,941	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	4,999,802	4,999,500	302
其他有価証券	6,811,166	6,811,166	-
(6)長期差入保証金	541,904	541,904	-
資産計	38,485,524	38,485,221	302
(1)未払金			
未払手数料	2,138,441	2,138,441	-
負債計	2,138,441	2,138,441	-

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	25,021,336	25,021,336	-
(2)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(3)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(4)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	-	-	-
其他有価証券	7,131,075	7,131,075	-
(6)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)未払金			
未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### 資 産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

(6)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいこと

から、当該帳簿価額によっています。

## 負債

### (1)未払金

未払手数料

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

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	31,760	20,560
合計	32,058	20,858
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	353,036	509,146
合計	353,036	509,146

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,615,467	-	-	-
未収委託者報酬	4,128,531	-	-	-
未収運用受託報酬	934,710	-	-	-
未収投資助言報酬	453,941	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	5,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	23,475	518,429	-	-
合計	31,156,125	518,429	-	-

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	25,021,336	-	-	-
未収委託者報酬	4,897,032	-	-	-
未収運用受託報酬	1,000,744	-	-	-
未収投資助言報酬	455,390	-	-	-
長期差入保証金	4,148	596,332	-	-
合計	31,378,651	596,332	-	-

(有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの			
国債	4,999,802	4,999,500	302
小計	4,999,802	4,999,500	302
合計	4,999,802	4,999,500	302

当事業年度(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成26年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式353,036千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式509,146千円)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。

## 3. その他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	6,390,685	5,387,490	1,003,195
小計	6,390,685	5,387,490	1,003,195
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託等	420,480	424,165	3,684
小計	420,480	424,165	3,684
合計	6,811,166	5,811,655	999,510

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 32,058千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,280千円です。

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	5,826,531	4,894,554	931,977
小計	5,826,531	4,894,554	931,977
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託等	1,304,543	1,312,300	7,756
小計	1,304,543	1,312,300	7,756
合計	7,131,075	6,206,854	924,220

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 20,858千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,097,321	310,894	454

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)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,892,685	893,251	1,091

(退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成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	1,605,470	1,802,340
会計方針の変更による 累積的影響額	-	682,168
会計方針の変更を反映した期首残高	1,605,470	2,484,508
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の発生額	21,670	276
退職給付の支払額	93,535	87,196
過去勤務費用の発生額	27,157	-
その他	75,176	-
退職給付債務の期末残高	1,802,340	2,633,080

(注) その他は、トヨタアセットマネジメント株式会社との合併により引き継いだ退職給付債務額になります。

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年 3月31日)	当事業年度 (平成27年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,802,340	2,633,080
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	1,802,340	2,633,080

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成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)
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の費用処理額	21,670	276

過去勤務費用の費用処理額	27,157	-
その他	114,773	152,031
確定給付制度に係る退職給付費用	330,002	387,799

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

#### (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 (自 平成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%	0.731%

### 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43,539千円、当事業年度105,357千円であります。

#### (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)
(単位：千円)		
流動の部		
繰延税金資産		
未払金	-	321,602
賞与引当金	330,120	299,729
調査費	62,002	77,863
未払事業税	123,029	49,504
その他	33,507	48,762
繰延税金資産小計	548,658	797,462
評価性引当額	-	321,602
繰延税金資産合計	548,658	475,859
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	642,354	849,431
特定外国子会社留保金額	226,680	211,024
ソフトウェア償却	105,651	62,560
投資有価証券評価損	50,143	43,051
その他	6,970	6,291
繰延税金資産小計	1,031,799	1,172,360
評価性引当額	233,276	217,192
繰延税金資産合計	798,523	955,168
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	334,588	289,742
その他	457	-
繰延税金負債合計	335,046	289,742
繰延税金資産の純額	1,012,135	1,141,285

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	38.0%	35.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.5	9.6
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	0.5
住民税均等割等	0.1	0.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.7	3.7
所得税額控除による税額控除	-	1.3
負ののれん発生益	1.3	-
企業結合に係る特定勘定取崩	1.5	-
その他	0.1	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.6	47.5

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）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成27年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の35.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成27年4月1日から平成28年3月31日までのものは33.1%、平成28年4月1日以降のものについては32.3%にそれぞれ変更されております。

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106,175千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が136,532千円、その他有価証券評価差額金が30,357千円それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,300,842	3,773,696	2,117,669	112,914	36,305,122

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報



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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当社は単一セグメントのため、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)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1.親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	3,299,099	未払手数料	257,411
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,127,963	未収投資助言報酬	290,426

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2.子会社及び関連会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	3,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接50	投信の販売委託 役員の兼任	出資の引受	118,725	-	-

(注) 1. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

## 3.その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,037,816	未払手数料	403,591

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

当事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1.親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,072,459	未収投資助言報酬	286,990

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2.子会社及び関連会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	------------	-----	-------------	-----------	----------------	-----------	-------	------	----	------

子会社	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) % 直接100	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	-	-
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接50	投信の販売委託 役員の兼任	増資の引受	136,110	-	-

- (注) 1. ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。  
2. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル)出資しました。

### 3. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等  
(1)投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

### (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	1,833,023.27円	1,810,999.27円
1株当たり当期純利益金額	191,226.00円	109,155.30円

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。  
2. 「会計方針の変更に関する注記」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、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おります。この結果、当事業年度の期首の1株当たり純資産額が、24,889円09銭減少し、1株当たり当期純利益金額は、1,591円10銭減少しております。  
3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成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株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,373,226	1,925,499
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	3,373,226	1,925,499
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

### (重要な後発事象)

#### 1. 日興グローバルラップ株式会社の株式の取得(子会社化)について

当社は、平成26年12月26日開催の取締役会において、当社が日興グローバルラップ株式会社(以下「NGW」)の発行済株式の全部を取得し子会社化することを決議し、平成26年12月26日付にて株式譲渡契約を締結し、平成27年4月1日付にて発行済株式を取得いたしました。

#### (1)株式取得の目的

NGWは、国内外資産の効率的な配分と、海外運用会社の評価・選定に特化した大変特徴ある運用

会社であり、既に「日興・新経済成長国エクイティ・ファンド（EG5）」や「日興ワールド CB ファンド」等の商品で当社と協働しております。本件子会社化は、外部委託運用機能の強化、アセットアロケーション機能の強化及びファンドラップビジネスへの参画の3つの分野において当社事業に対するプラスをもたらすと考えております。今後、当社はNGWと双方のリソースを活用した相乗効果の醸成を進め、更なるビジネスの拡大を目指していく考えです。

## (2)取得する会社の概要（平成26年3月末現在）

名称	日興グローバルラップ株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	1,499,000千円
純資産	7,620,283千円
総資産	8,134,920千円
営業利益	501,574千円
当期純利益	303,382千円

## (3)株式取得日

平成27年4月1日

## (4)取得する株式の数、取得価額及び取得後の持株比率

取得株式数	59,960株
取得価額	9,877,717千円
取得後の持株比率	100%

## (5)支払資金の調達方法

自己資金によります。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第31期中間会計期間 (平成27年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		10,975,719
顧客分別金信託		20,003
前払費用		325,776
未収委託者報酬		5,173,183
未収運用受託報酬		1,458,560
未収投資助言報酬		423,030
未収収益		31,637
繰延税金資産		519,032
その他		2,190
流動資産合計		18,929,133
固定資産		
有形固定資産	1	421,791
無形固定資産		573,943
投資その他の資産		
投資有価証券		10,008,703
関係会社株式		10,412,523
その他		1,298,972
投資その他の資産合計		21,720,199
固定資産合計		22,715,935

資産合計		41,645,068
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		29
その他の預り金		61,740
未払金		2,614,352
未払費用		1,987,591
未払法人税等		406,231
賞与引当金		1,066,694
その他	2	169,290
流動負債合計		6,305,931
固定負債		
退職給付引当金		2,705,437
固定負債合計		2,705,437
負債合計		9,011,368
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		19,580,326
利益剰余金合計		21,401,531
株主資本合計		32,030,515
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		603,184
評価・換算差額等合計		603,184
純資産合計		32,633,699
負債純資産合計		41,645,068

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第31期中間会計期間 (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	16,529,753
運用受託報酬	2,843,500
投資助言報酬	978,992
その他の営業収益	64,711
営業収益計	20,416,958

営業費用		13,207,542
一般管理費	1	5,203,152
営業利益		2,006,263
営業外収益	2	41,105
営業外費用	3	48,535
経常利益		1,998,832
特別利益	4	34,739
特別損失		7,932
税引前中間純利益		2,025,639
法人税、住民税及び事業税		368,130
法人税等調整額		14,018
法人税等合計		354,112
中間純利益		1,671,526

## (3)中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間(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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当中間期変動額									
剰余金の配当							952,560	952,560	952,560
中間純利益							1,671,526	1,671,526	1,671,526
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	-	-	-	-	-	-	718,966	718,966	718,966
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,580,326	21,401,531	32,030,515

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	634,478	634,478	31,946,027
当中間期変動額			
剰余金の配当			952,560
中間純利益			1,671,526
株主資本以外の項 目の当中間期変動額 (純額)	31,294	31,294	31,294
当中間期変動額合計	31,294	31,294	687,672
当中間期末残高	603,184	603,184	32,633,699

## 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

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

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

## (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(中間貸借対照表関係)

第31期中間会計期間 (平成27年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	973,461千円
2.消費税等の取扱い	
<p>仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。</p>	

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

当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円

4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額337,247千円の支払保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	65,954千円
無形固定資産	95,946千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	21,723千円
雑収入	17,209千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	48,535千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券清算益	24,751千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月1日

(リース取引関係)

第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	585,430千円
1年超	1,047,704千円
合計	1,633,134千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第31期中間会計期間(平成27年9月30日)

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。



(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	10,975,719	10,975,719	-
(2)顧客分別金信託	20,003	20,003	-
(3)未収委託者報酬	5,173,183	5,173,183	-
(4)未収運用受託報酬	1,458,560	1,458,560	-
(5)未収投資助言報酬	423,030	423,030	-
(6)投資有価証券			
其他有価証券	10,008,395	10,008,395	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	600,466	600,466	-
資産計	28,659,358	28,659,358	-
(1)顧客からの預り金	29	29	-
(2)未払金			
未払手数料	2,360,638	2,360,638	-
負債計	2,360,667	2,360,667	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

- (6) 投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

- (7) 投資その他の資産

## 長期差入保証金

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

負 債

- (1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
其他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	10
合計	308
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	10,412,523
合計	10,412,523

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

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

（有価証券関係）

第31期中間会計期間（平成27年9月30日）

1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式

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

3．その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,450,671	5,524,611	926,060
小計	6,450,671	5,524,611	926,060
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,557,723	3,605,760	48,037
小計	3,557,723	3,605,760	48,037
合計	10,008,395	9,130,371	878,023

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 308千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1．セグメント情報

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

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

2．関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	16,529,753	2,843,500	978,992	64,711	20,416,958

(2)地域ごとの情報

売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,849,982円98銭
1株当たり中間純利益	94,757円75銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。</p>	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	32,633,699千円
普通株式に係る純資産額	32,633,699千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,671,526千円
普通株式に係る中間純利益	1,671,526千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

## イ 受託会社

- (イ) 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
(ロ) 資本金の額 324,279百万円(平成27年9月末現在)

- (八) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円(平成27年9月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## □ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
岡三証券株式会社	5,000百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
東洋証券株式会社	13,494百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
むさし証券株式会社	5,000百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

資本金の額は、平成27年9月末現在。

## 八 投資顧問会社(運用の委託先)

- (イ) 名称 ピムコジャパンリミテッド
- (ロ) 資本金の額 13,411千米ドル(平成27年9月末現在)
- (ハ) 事業の内容 金融商品取引法に基づき投資運用業等を営んでいます。

## 第3【その他】

## &lt;更新後&gt;

1. 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
2. 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
3. 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
4. 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
5. 有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
6. 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
7. 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
8. 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合

には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。

このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。

9. 当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年12月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり/3カ月決算型）の平成27年5月13日から平成27年11月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり/3カ月決算型）の平成27年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成27年12月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし/3カ月決算型）の平成27年5月13日から平成27年11月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし/3カ月決算型）の平成27年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成27年 6月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫 印

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 池 ヶ 谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成27年4月1日付にて日興グローバルラップ株式会社の発行済株式の全部を取得している。

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

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



**独立監査人の中間監査報告書**

平成27年11月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

公認会計士 池ヶ谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成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。

## 利害関係

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

以上

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