

## 【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29年2月10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 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【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28年8月10日から平成29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28年 8月 9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）」の有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、平成29年 2月10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」

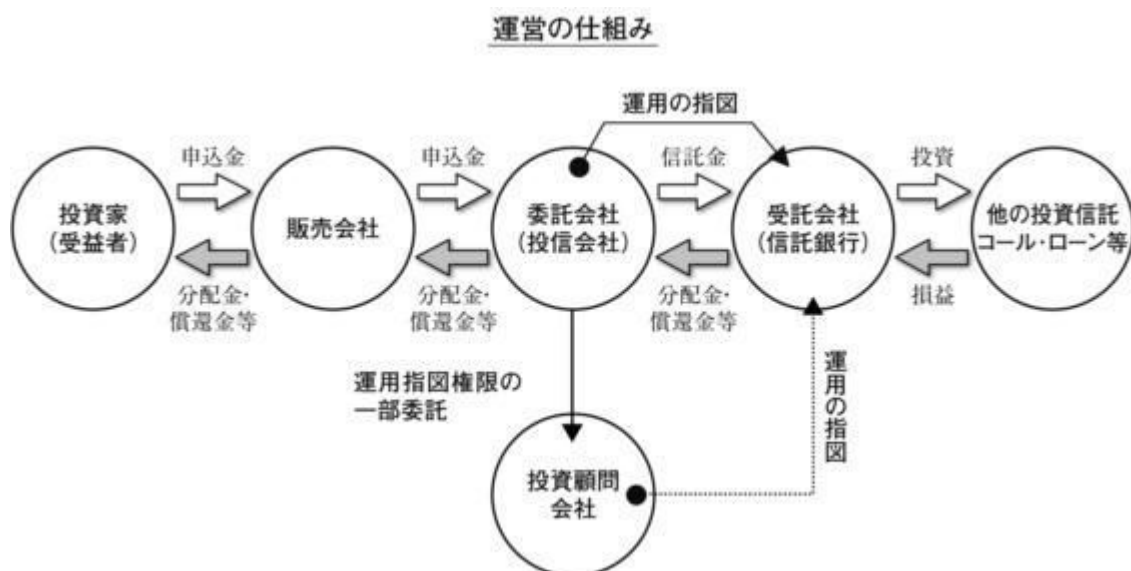
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(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28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

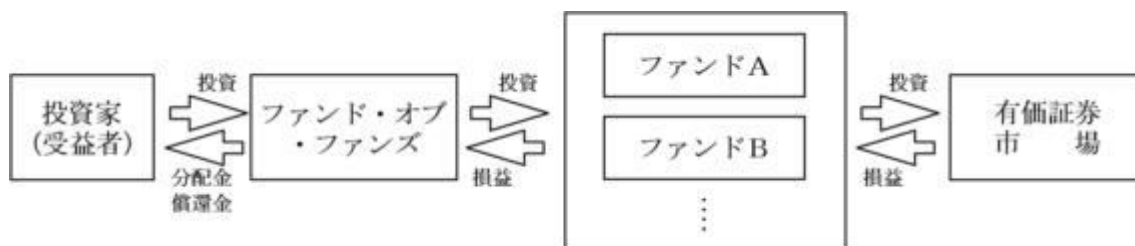
(平成28年11月30日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	10,584	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528	20.0
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	3,528	20.0

## 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。
- (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(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。
- (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(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。

※販売会社によっては、いずれか1ファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

**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。

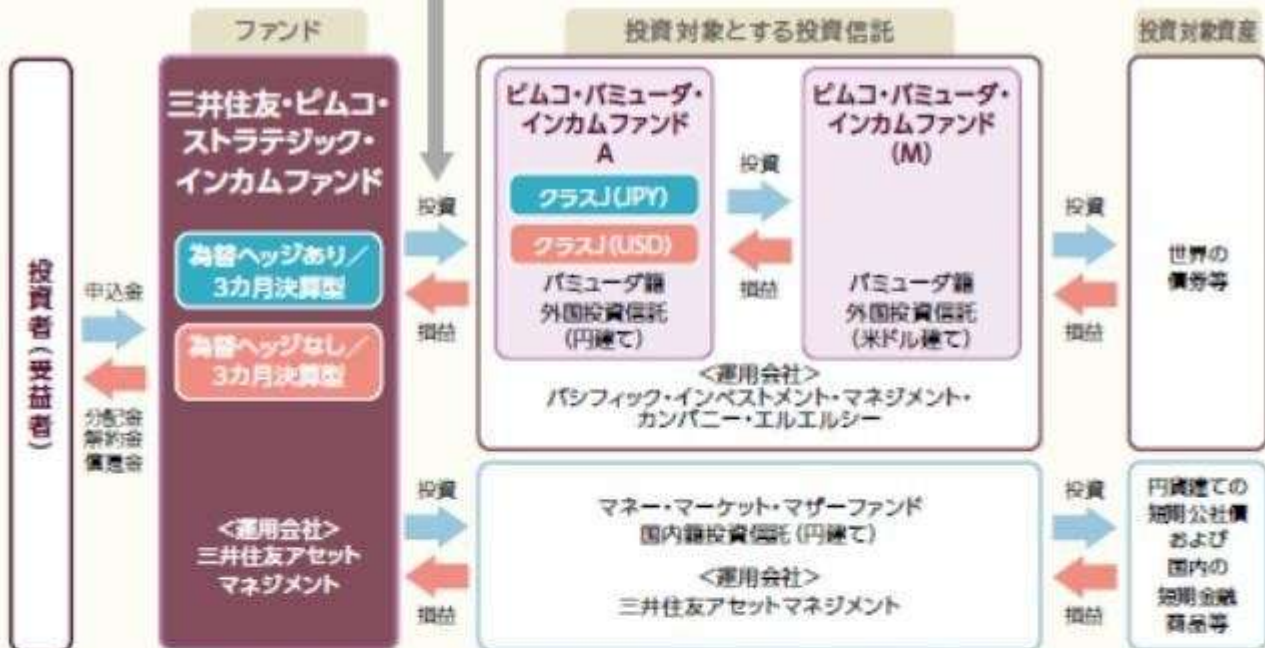
- 分配金額は、委託会社が収益分配方針に基づき、基準価額水準、市況動向等を考慮し決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※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。

## PIMCOが運用するストラテジック・インカムファンドの運用残高推移

■PIMCOが運用するストラテジック・インカムファンド(以下、PIMCOファンド)は、さまざまな市場局面を乗り越え、運用残高を伸ばしてきました。



(注) データは2007年3月末～2016年11月末。上記運用残高(グラフデータ)はPIMCOがPIMCOファンドと同等の運用コンセプトを有すると認めたファンドを含みます。

(出所) PIMCO, Bloombergのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

\*上記の評価は過去の一定期間の実績を分析したものであり、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。また、「主な受賞歴」は運用マネージャーの受賞歴であり、当ファンドが投資対象とする外国投資信託が受賞したものではありません。

\*上記の運用残高は当ファンドが投資対象とする外国投資信託と同様の運用手法を用いたファンドの過去の実績であり、当ファンドの運用実績ではありません。また、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。



## PIMCOファンドの運用実績

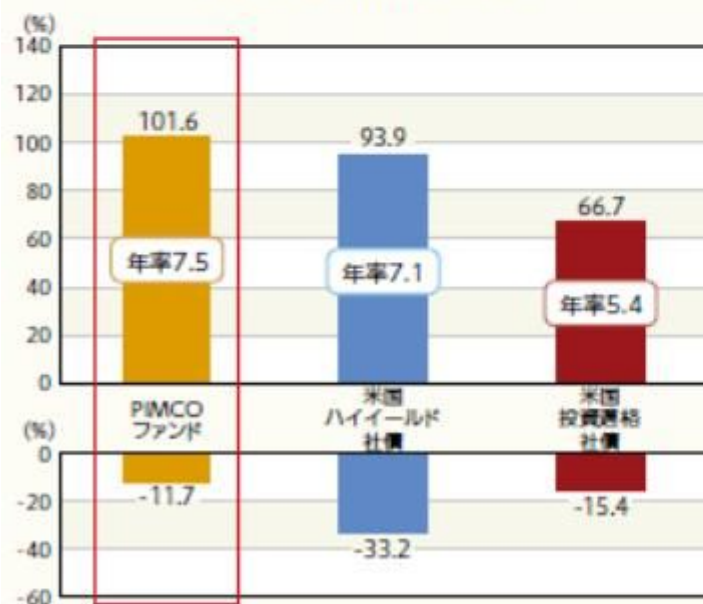
### [ パフォーマンスの推移 (米ドルベース) ]

(ポイント)



■ PIMCOファンドは、過去の金融危機時における影響が比較的小さく、米国ハイイールド社債や米国投資適格社債に比べ相対的に高い安定性と収益性を兼ね備えています。

### [ 騰落率 (米ドルベース) ]



■ 過去の最大下落率は米国投資適格社債の水準を下回る一方、年率リターンは約7.5%と米国ハイイールド社債を上回っています。

(注1) データは2007年3月末～2016年11月末。

(注2) 左図の最大下落率(米ドルベース)の期間は、PIMCOファンドは2008年1月末～2009年2月末、米国ハイイールド社債は2007年5月末～2008年11月末、米国投資適格社債は2008年2月末～2008年10月末。

(注3) PIMCOファンドは当ファンドの信託報酬等控除後のデータを使用。米国ハイイールド社債はBofAメリルリンチ・米国ハイイールド・マスターII・インデックス、米国投資適格社債はブルームバーグ・パークレイズ米国総合インデックスの社債サブインデックスを使用。

(出所) PIMCO、FactSet、Bloombergのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

### [ 同期間の最大下落率 (米ドルベース) ]

※ 上記は当ファンドが投資対象とする外国投資信託と同様の運用手法を用いたファンドの過去の実績から当ファンドの信託報酬等を控除したシミュレーションの結果であり、当ファンドの運用実績ではありません。

また、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。

## PIMCOファンドのリターンの源泉

### 〔 PIMCOファンドのパフォーマンス (円ベース)と為替の推移 〕



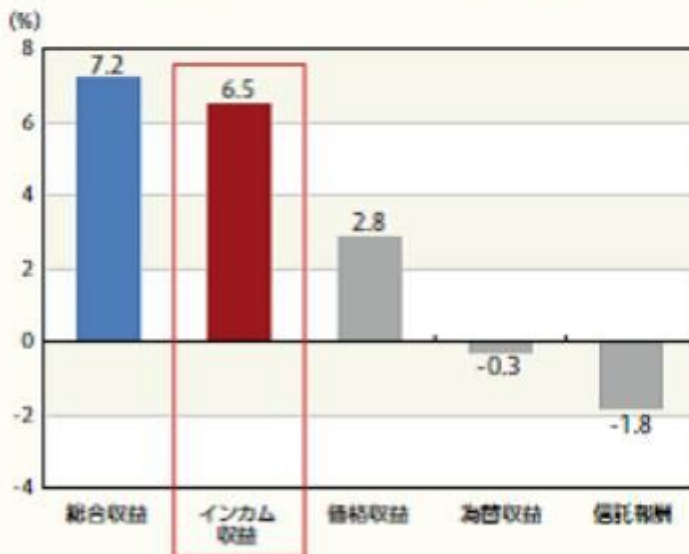
■ PIMCOファンドの円ベースでのリターンは概ね堅調に推移しています。設定後の円高局面においても、円ベースのリターンは小幅のマイナスに留まり、その後の円安局面では大幅な上昇となりました。

(注1)データは2007年3月末～2016年11月末。

(注2)PIMCOファンド(円ベース)は当ファンドの信託報酬等控除後、三井住友アセットマネジメントがPIMCOファンドを円換算。

(出所)PIMCO、Bloombergのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

### 〔 設定来の年率リターンの要因分解 〕



■ 設定来の年率リターン(信託報酬等控除前)のおよそ7割はインカム収益によるものであり、中長期間におけるリターンの安定性に寄与しています。

(注1)データは2007年3月末～2016年11月末。

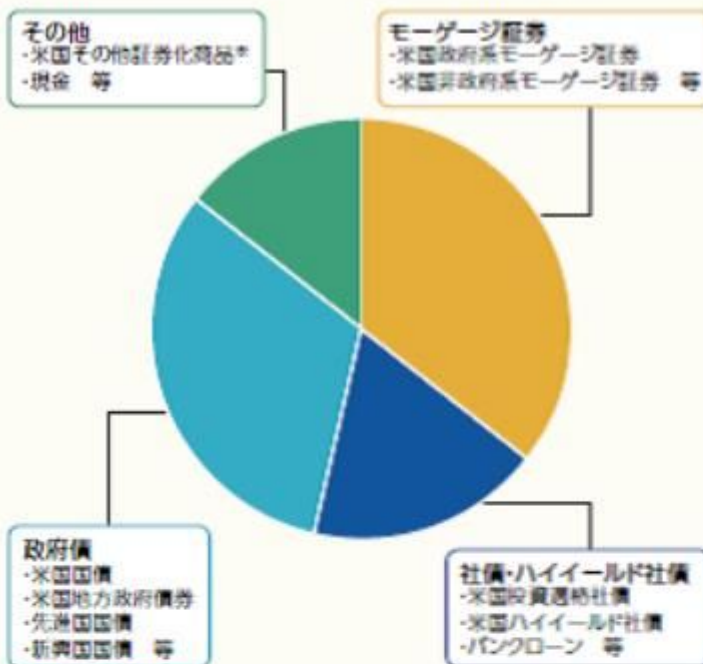
(注2)総合収益は円ベース、インカム収益、価格収益は米ドルベースで計算しています。計算上の誤差等により合計が一致しない場合があります。

(出所)PIMCO、Bloombergのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※上記円ベースのデータは過去のデータを基に三井住友アセットマネジメントが行ったシミュレーションの結果であり、当ファンドの運用実績ではありません。また、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もありません。一定の前提条件に基づくものであり、経費等は考慮されていません。実際の運用においては、市場動向等の諸条件が異なることによりパフォーマンス等は大きく異なります。

## 魅力的なインカム収入

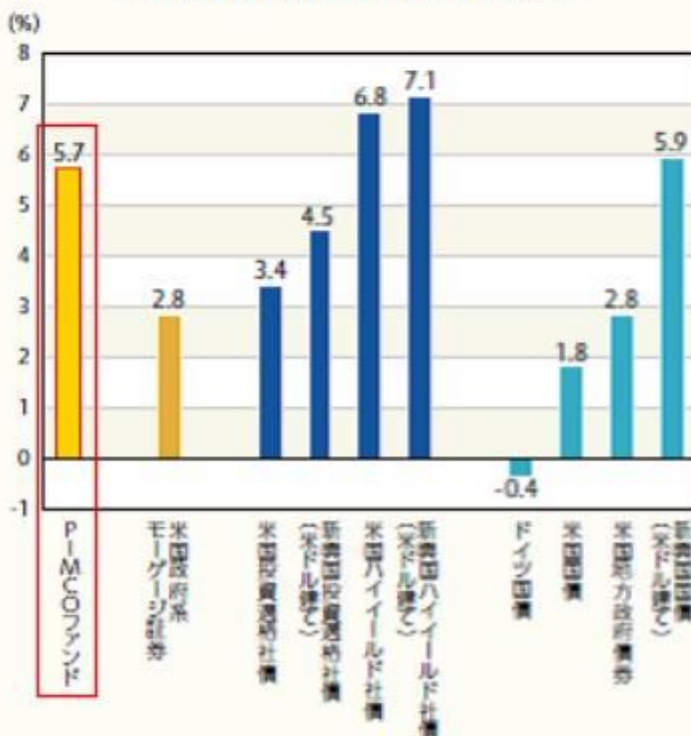
## 〔 PIMCOファンドの債券の種別構成比率 〕



■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。

※その他証券化商品の中には、一般に資産担保証券と呼ばれる自動車ローンや学費ローン等を担保とした証券が含まれます。

## 〔 各投資対象債券の利回り水準 〕



■銘柄選択においては、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ます。

(注1) データは2016年11月末時点。

(注2) PIMCOファンドは信託報酬等控除前のデータを使用。米国政府系モーゲージ証券、米国投資選格社債、米国国債、米国地方政府債券はブルームバーグ・パークレイズ米国総合インデックスの各サブインデックス、ドイツ国債はドイツ5年国債の利回り、新米国投資選格社債(米ドル建て)、新米国ハイールド社債(米ドル建て)はJPモルガンCEMBIブロード・ダイバーシファイドの各サブインデックス、米国ハイールド社債はBoFAメリアルリンチ・米国ハイールド・マスターII・インデックス、新米国国債(米ドル建て)はJPモルガン EMBIグローバル・ダイバーシファイドを使用。

(注3) PIMCO, Bloomberg, JPモルガン, FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

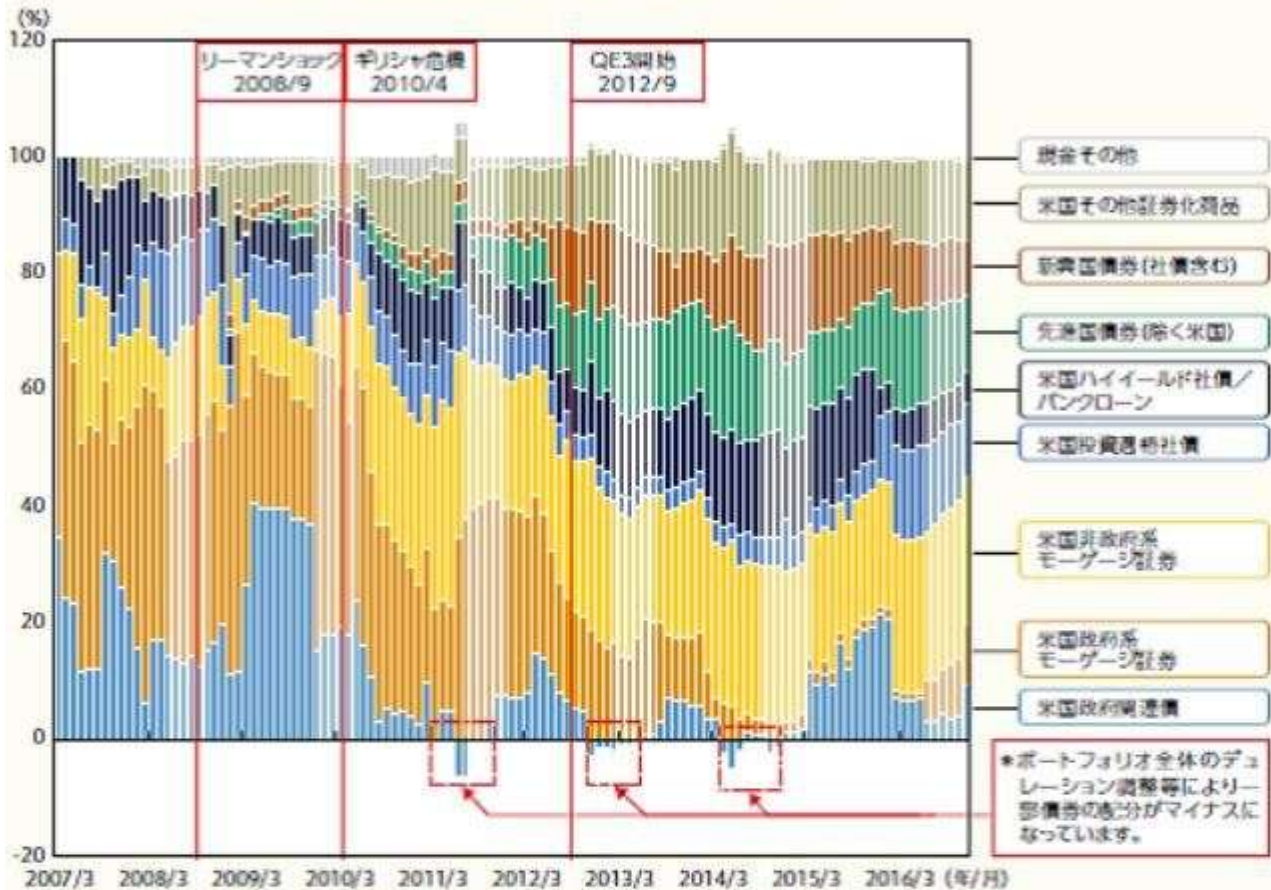
※上記は当ファンドが投資対象とする外国投資信託と同様の運用手法を用いたファンドの過去の実績であり、当ファンドの運用実績ではありません。

また、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。

## PIMCOファンドのリターンの源泉

- 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。
- 市場環境や経済見通しに応じて、債券の種別配分の調整やデュレーション調整等の金利戦略により機動的かつダイナミックに運用を行います。

### [ 債券の種別配分推移(月次・時価ベース) ]



#### デュレーションとは

金利がある一定の割合で変動した場合、債券価格がどの程度変化するかを示す指標です。この数値が大きいほど、金利の変化に対する債券価格の変動率が大きくなります。

(注) データは2007年3月末～2016年11月末。PIMCOファンド(個別報酬等控除前)のデータを使用。

(出所) PIMCOのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※上記は当ファンドが投資対象とする外国投資信託と同様の運用手法を用いたファンドの過去の実績であり、当ファンドの運用実績ではありません。

また、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。

### 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。
- 信用力が高く、安全性が高いため、相対的に利回りは低い。



#### 米国投資適格社債

- 企業が発行する債券で、格付けがBBB格以上のもの。
- 信用力が高く、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BB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。
- 短期間償還リスクがあるため、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。
- 信用力が高いため、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、社債等と比較して返済順位が高い。
- 変動金利で設定されることが多い。



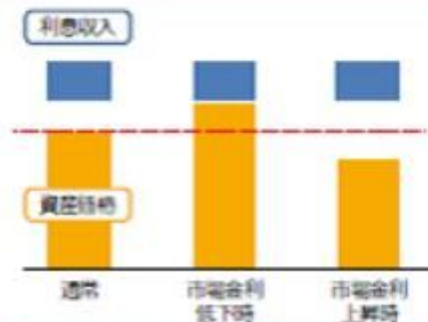
#### 米国非政府系モーゲージ証券

- 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。



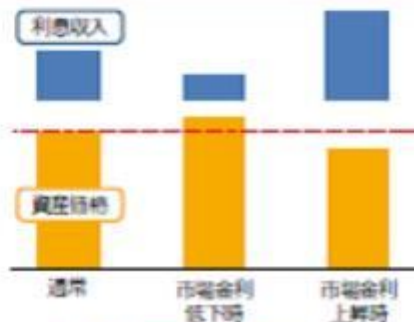
■変動金利資産は、金利変動による資産価格の変動が相対的に小さく、金利上昇に抵抗力があります。

### 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

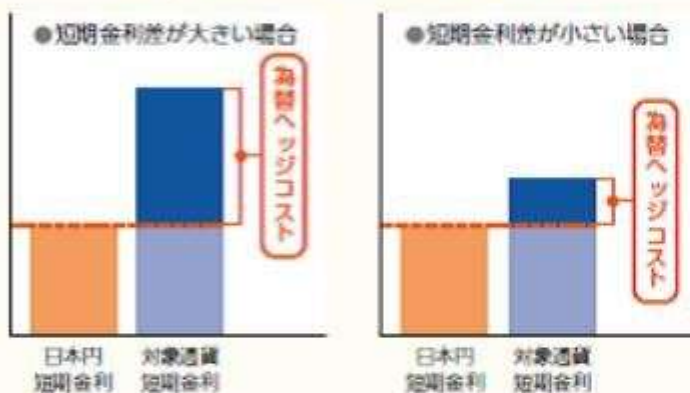
### 〔対円での為替ヘッジの効果〕



■「為替ヘッジあり/3カ月決算型」は、投資対象とする投資信託において、原則として対円での為替ヘッジを行うため、為替変動の影響は限定的になると考えられます。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。

■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。

### 〔為替ヘッジコストのイメージ〕



(注)上記は、対円での為替ヘッジコスト(費用)を説明するイメージです。日本円の短期金利が為替ヘッジ対象通貨の短期金利を上回ると、為替ヘッジプレミアム(収益)となります。

■対円での為替ヘッジには、為替ヘッジコストがかかります。例えば、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行う場合、日米の短期金利差相当分が為替ヘッジコスト\*となります。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。

\*通貨の先渡取引等を利用した実際の為替ヘッジコストは、需給要因等により大きく変動することがあります。

### 〔為替ヘッジコストの推移(年率)〕



■2015年12月の米国の利上げ実施や、2016年1月の日銀マイナス金利導入発表、その後の米国の追加利上げ観測等の影響により、日米の短期金利差が拡大していることから、為替ヘッジコストは増加傾向にあります。

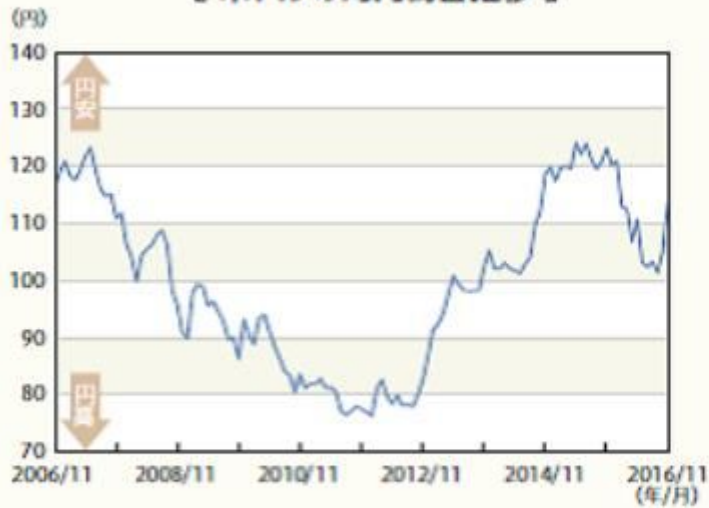
(注1)データは2006年11月末～2016年11月末。  
(注2)為替ヘッジコストは、各月末時点における米ドル・円のスポットレートと1ヵ月物フォワードレートを用いて算出し年率換算。

(出所)投資信託協会のデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※上記は過去のデータを基に委託会社が算出した結果であり、当ファンドの将来の運用成果や今後の市場環境等を示唆あるいは保証するものではありません。

## 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りました。2016年に入ってから、9月にかけて円高が進行しました。

(注)データは2006年11月末～2016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、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2,200名(うち運用担当者 約240名)
運用資産残高	約1.55兆米ドル(約157兆円、2016年9月 末現在、関係会社受託分を含む)

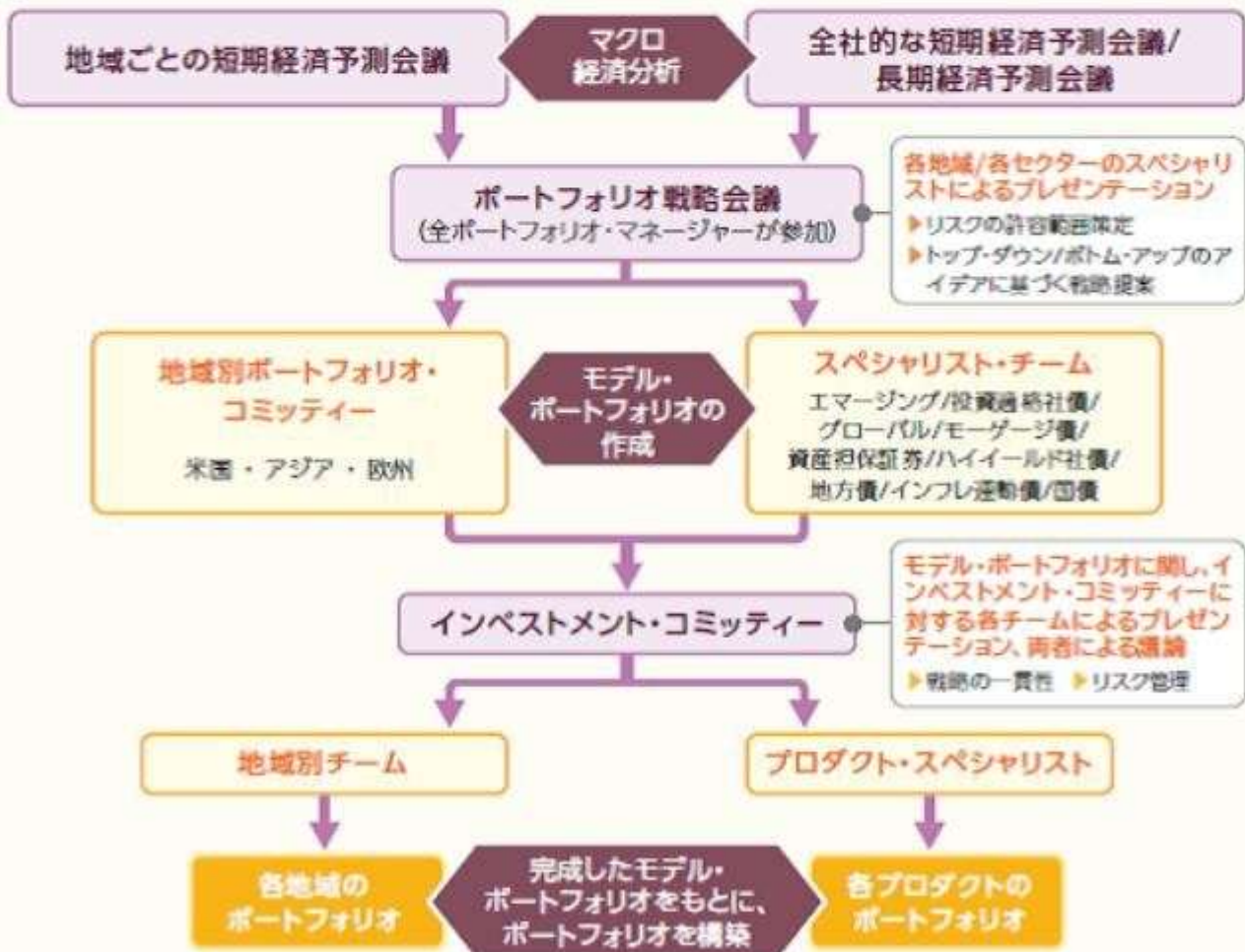
(注)1米ドル＝101.265円で換算

## 〔ピ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一つとして 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80名
運用資産残高	約1,017億米ドル (約10.3兆円、2016年9月末現在)

(注)1米ドル＝101.265円で換算

## 〔PIMCOの運用プロセス〕



(出所)ピ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

※上記の運用プロセスは2016年11月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## (4) 【分配方針】



## &lt;更新後&gt;

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

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

ファンドは計算期間中の基準価額の変動にかかわらず分配を行う場合があります。分配金額は運用状況等により変動します。分配金額は計算期間中の基準価額の上昇分を上回る場合があります。

## (5) 【投資制限】

## &lt;更新後&gt;

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。
- ニ 資金の借入れ
  - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  - (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
    1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
    2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
    3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含

みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

### 〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)

ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)

形態	バミューダ籍外国投資信託（円建て）
主要運用対象	「ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）」受益証券
運用の基本方針	「ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）」受益証券を主要投資対象として、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。 クラスJ(JPY)：原則として米ドル売り円買いの為替取引を行います。 クラスJ(USD)：原則として対円での為替ヘッジを行いません。
ベンチマーク	ありません。
主な投資制限	・米ドル建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・デリバティブおよび外国為替予約取引の利用は、原則としてヘッジ目的および資産の効率的な運用に資することを目的とします。
決算日	年1回決算（原則として、毎年10月31日）
分配方針	毎月、原則として利子収入および売買益から分配を行う方針です。
信託報酬等	ありません。
その他の費用	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、租税公課、借入費用等がかかります。
信託財産留保額	ありません。
申込手数料	ありません。
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

（ご参考）前記の投資信託が投資対象とするピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）の概要

形態	バミューダ籍外国投資信託（米ドル建て）
----	---------------------

主要運用対象	<p>投資する債券などの種類は以下の通りです。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 各国政府または政府の部局またはその他の政府系金融機関の発行または保証する債券</li> <li>2. 米国の発行体および米国以外の発行体の社債（新株予約権付社債およびCPを含みます。）</li> <li>3. モーゲージ証券およびアセット・バック証券</li> <li>4. 政府または企業が発行するインフレ連動債券</li> <li>5. 仕組債（ハイブリッド証券やインデックス証券、イベント・リンク債およびローン・パーティシペーションを含みます。）</li> <li>6. ディレード・ファンディング・ローンおよびリボルビング・クレジット・ファシリティ</li> <li>7. 譲渡性預金、定期預金および銀行引受手形</li> <li>8. 現先取引および逆現先取引</li> <li>9. 国際機関の発行する債券</li> <li>10. 米国1933年証券取引法規則144Aに定められている有価証券</li> </ol>
運用の基本方針	長期的な信託財産の成長を図りながら、利子収入の最大化を目指す運用を行います。
参考指数	ブルームバーグ・バークレイズ米国総合インデックス
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・通常、世界の幅広い債券および債券関連派生商品等にファンドの総資産額の65%以上を投資します。</li> <li>・ファンド全体のデュレーションは0-8年の範囲内で調整します。</li> <li>・ファンドは、その資産のすべてを派生商品への投資として、オプション取引、先物取引、先物オプション取引、クレジット・デフォルト・スワップを含むスワップ取引などにも投資できます。</li> <li>・投資適格未満の債券等への投資比率は、ファンドの総資産額の50%以下とします。ただし、モーゲージ証券、資産担保証券についてはこの限りではありません。</li> <li>・非米国資産への投資比率には制限を設けません。</li> <li>・米ドル以外の通貨の組入比率は、取得時においてファンドの総資産額の10%以下とします。</li> <li>・新興国債券への投資比率は、取得時においてファンドの総資産額の20%以下とします。</li> <li>・非流動性資産への投資比率は、取得時においてファンドの総資産額の15%以下とします。</li> <li>・資金の借入れの合計金額がファンドの純資産価額の10%を超える借入残高が生じる借入れは行わないものとします。</li> <li>・派生商品の使用はヘッジ目的に限定しません。</li> </ul>
決算日	年1回、原則として、毎年10月31日
分配方針	毎月、原則として利子収入および売買益から分配を行う方針です。
信託報酬	ありません。
成功報酬	ありません。
その他の費用	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、租税公課、借入費用など。
申込手数料	ありません。
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

## マネー・マーケット・マザーファンド

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	円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
ベンチマーク	ありません。

主な投資制限	・ 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
決算日	原則として毎年3月1日
信託報酬	ありません。
信託財産留保額	設定・解約時に0.005%
申込手数料	ありません。
委託会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

### 3【投資リスク】

#### < 更新後 >

#### 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。

#### （二）為替変動リスク

「為替ヘッジあり / 3カ月決算型」「為替ヘッジなし / 3カ月決算型」

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」

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

ファンドの資金流出入に伴い、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・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)

〔 ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移 〕

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

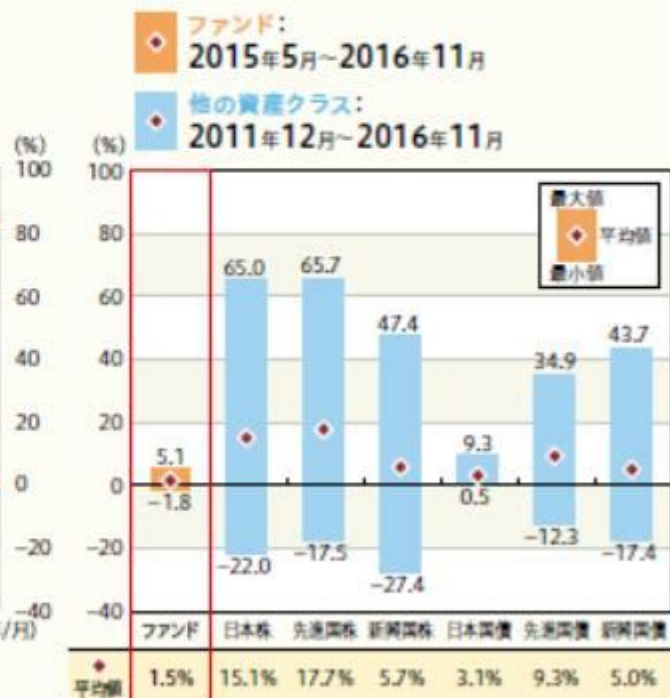


※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

〔 ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較 〕

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## ■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)

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的財産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】

## (5) 【課税上の取扱い】

## &lt; 更新後 &gt;

## 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。

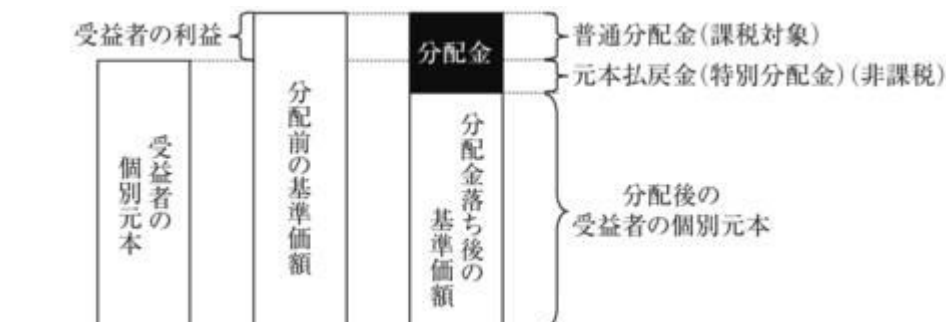
## ハ 収益分配金の課税について

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

なお、当ファンドは、配当控除の適用はありません。

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への直接投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成28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28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	880,231,488	99.35
親投資信託受益証券	日本	10,006	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,760,816	0.65
合計(純資産総額)		886,002,310	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28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	8,984,568,798	98.95
親投資信託受益証券	日本	10,006	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		95,744,753	1.05
合計(純資産総額)		9,080,323,557	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28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)	89,664	9,806.49	879,289,119	9,817	880,231,488	99.35
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	1.0035	10,006	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。

#### ロ 種類別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.35
親投資信託受益証券	0.00
合計	99.35

## 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28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)	818,938	10,345.61	8,472,413,162	10,971	8,984,568,798	98.95
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	1.0035	10,006	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。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	98.95
親投資信託受益証券	0.00
合計	98.95

## 【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
特定4期（平成28年 5月12日）	1,252,750,557	1,276,019,691	9,733	9,913
特定5期（平成28年11月14日）	926,190,128	943,716,411	9,797	9,967
平成27年11月末日	1,393,982,160		9,816	
12月末日	1,357,747,655		9,708	
平成28年 1月末日	1,273,725,151		9,644	
2月末日	1,222,059,863		9,473	
3月末日	1,259,985,576		9,657	
4月末日	1,261,517,951		9,801	
5月末日	1,216,858,119		9,795	
6月末日	1,171,419,253		9,777	
7月末日	1,131,872,732		9,899	
8月末日	1,059,661,196		9,859	
9月末日	1,001,995,848		9,889	
10月末日	942,902,725		9,943	
11月末日	886,002,310		9,799	

## 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
特定4期（平成28年 5月12日）	14,217,025,639	14,518,776,347	8,832	9,012
特定5期（平成28年11月14日）	8,896,518,536	9,058,719,811	8,804	8,944
平成27年11月末日	18,117,097,961		9,962	
12月末日	17,676,970,988		9,688	
平成28年 1月末日	16,873,534,822		9,497	
2月末日	15,497,282,984		8,992	
3月末日	15,310,844,697		9,061	
4月末日	15,097,492,275		9,105	
5月末日	13,760,877,824		8,994	

6月末日	11,915,569,873		8,402
7月末日	11,621,537,535		8,692
8月末日	10,481,365,998		8,522
9月末日	9,504,167,206		8,464
10月末日	9,182,020,599		8,835
11月末日	9,080,323,557		9,323

## 【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
特定4期	平成27年11月13日～平成28年 5月12日	180
特定5期	平成28年 5月13日～平成28年11月14日	170

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
特定4期	平成27年11月13日～平成28年 5月12日	180
特定5期	平成28年 5月13日～平成28年11月14日	140

## 【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
特定4期	0.9
特定5期	2.4

（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
特定4期	9.7
特定5期	1.3

（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
特定4期	152,576,448	299,862,052
特定5期	111,191,776	452,831,272

（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
特定4期	2,492,147,680	4,503,001,837
特定5期	109,827,062	6,102,692,805

（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:2016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。  
 ※後託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

### ■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か月決算型)



決算期	分配金
2016年11月	80円
2016年8月	90円
2016年5月	90円
2016年2月	90円
2015年11月	90円
設定来累計	730円

※分配金は1万円当たり税引前です。  
 ※直近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か月決算型)



決算期	分配金
2016年11月	70円
2016年8月	70円
2016年5月	90円
2016年2月	90円
2015年11月	90円
設定来累計	2,590円

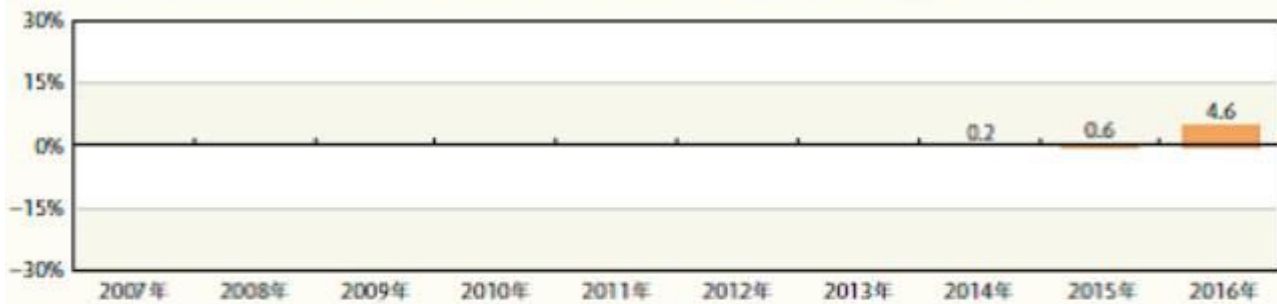
※分配金は1万円当たり税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。

※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。

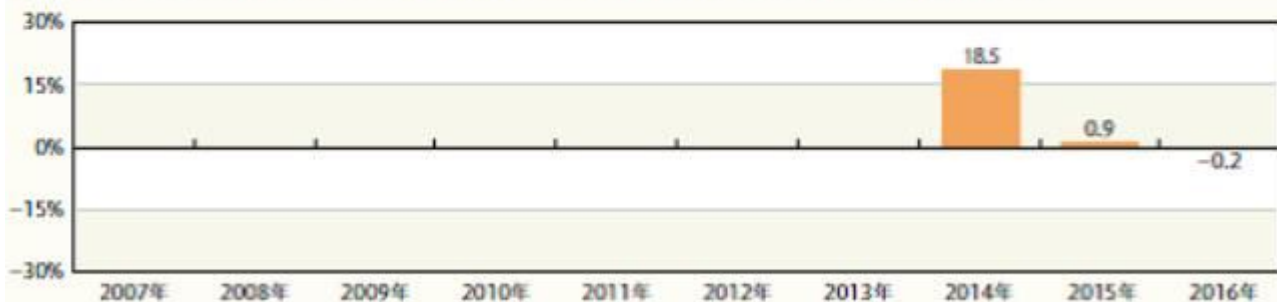
※分配金再投資基準価額は、上記期間における分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算した価額です。

## 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か月決算型)



### ■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か月決算型)



※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。ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※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。

※2016年のファンドの収益率は、年初から2016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;

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、特定5期（平成28年5月13日から平成28年11月14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4期 (平成28年5月12日現在)	特定5期 (平成28年11月14日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	15,378,603	67,868,092
コール・ローン	27,221,181	-
投資信託受益証券	1,196,682,483	871,302,915
親投資信託受益証券	10,007	10,006
未収入金	35,890,952	-
流動資産合計	1,275,183,226	939,181,013
資産合計	1,275,183,226	939,181,013
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	11,583,531	7,563,356
未払解約金	5,305,212	710,718
未払受託者報酬	98,670	83,962
未払委託者報酬	5,426,804	4,617,850
未払利息	79	-
その他未払費用	18,373	14,999
流動負債合計	22,432,669	12,990,885
負債合計	22,432,669	12,990,885
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,287,059,062	945,419,566
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	34,308,505	19,229,438
元本等合計	1,252,750,557	926,190,128
純資産合計	1,252,750,557	926,190,128
負債純資産合計	1,275,183,226	939,181,013

## (2)【損益及び剰余金計算書】

	特定4期		特定5期	
	自	平成27年11月13日 至 平成28年 5月12日	自	平成28年 5月13日 至 平成28年11月14日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		46,073,402		35,833,998
受取利息		1,410		-
有価証券売買等損益		25,965,757		1,608,776
営業収益合計		20,109,055		37,442,774
<b>営業費用</b>				
支払利息		417		9,515
受託者報酬		208,621		180,315
委託者報酬		11,474,060		9,917,151
その他費用		36,665		34,861
営業費用合計		11,719,763		10,141,842
営業利益又は営業損失（ ）		8,389,292		27,300,932
経常利益又は経常損失（ ）		8,389,292		27,300,932
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,389,292		27,300,932
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（ ）		388,242		2,831,900
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,921,537		34,308,505
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,746,085		10,023,448
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,746,085		10,023,448
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,864,969		1,887,130
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,864,969		1,887,130
分配金		23,269,134		17,526,283
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		34,308,505		19,229,438

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	特定5期	
	自	平成28年 5月13日 至 平成28年11月14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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当特定期間は当期末が休日のため、平成28年 5月13日から平成28年11月14日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	特定4期 (平成28年 5月12日現在)	特定5期 (平成28年11月14日現在)
1. 当特定期間の末日における受益権の総数	1,287,059,062口	945,419,566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 34,308,505円	元本の欠損 19,229,438円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9733円 (10,000口当たりの純資産額 9,733円)	1口当たり純資産額 0.9797円 (10,000口当たりの純資産額 9,797円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	特定4期 自 平成27年11月13日 至 平成28年 5月12日	特定5期 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14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 4,172,827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 3,590,524円
2. 分配金の計算過程	(自 平成27年11月13日 至 平成28年 2月12日) 第7計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,360,122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(17,970,008円)、および分配準備積立金(17,518,547円)より、分配対象収益は51,848,677円(1万口当たり399.32円)であり、うち11,685,603円(1万口当たり90円)を分配金額としております。	(自 平成28年 5月13日 至 平成28年 8月12日) 第9計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,910,815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(19,536,081円)、および分配準備積立金(22,529,843円)より、分配対象収益は56,976,739円(1万口当たり514.68円)であり、うち9,962,927円(1万口当たり90円)を分配金額としております。

	<p>（自平成28年2月13日 至平成28年5月12日）</p> <p>第8計算期間末における費用控除後の配当等収益（19,719,410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（20,507,218円）、および分配準備積立金（19,973,780円）より、分配対象収益は60,200,408円（1万口当たり467.72円）であり、うち11,583,531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28年8月13日 至平成28年11月14日）</p> <p>第10計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,567,434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（17,377,341円）、および分配準備積立金（22,875,606円）より、分配対象収益は50,820,381円（1万口当たり537.53円）であり、うち7,563,356円（1万口当たり80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5期 自平成28年5月13日 至平成28年11月14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せん。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	特定5期 (平成28年11月14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	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

特定4期（自 平成27年11月13日 至 平成28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	34,315,788円
親投資信託受益証券	2円
合計	34,315,786円

特定5期（自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14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	7,360,808円
親投資信託受益証券	2円
合計	7,360,810円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

特定5期 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	特定4期 （平成28年 5月12日現在）	特定5期 （平成28年11月14日現在）
期首元本額	1,434,344,666円	1,287,059,062円
期中追加設定元本額	152,576,448円	111,191,776円
期中一部解約元本額	299,862,052円	452,831,272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・パミューダ・インカムファンドAクラスJ(JPY)	88,845	871,302,915	
投資信託受益証券合計		88,845	871,302,915	
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			871,312,921	

## 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4期 (平成28年 5月12日現在)	特定5期 (平成28年11月14日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	209,038,469	446,375,865
コール・ローン	370,012,413	-
投資信託受益証券	13,996,156,236	8,540,083,827
親投資信託受益証券	10,007	10,006
未収入金	81,999,330	47,992,581
流動資産合計	14,657,216,455	9,034,462,279
資産合計	14,657,216,455	9,034,462,279
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	144,880,208	70,734,546
未払解約金	227,549,105	21,531,438
未払受託者報酬	1,206,017	813,120
未払委託者報酬	66,330,796	44,721,460
未払利息	1,084	-
その他未払費用	223,606	143,179
流動負債合計	440,190,816	137,943,743
負債合計	440,190,816	137,943,743
<b>純資産の部</b>		
元本等		

	特定4期 (平成28年 5月12日現在)	特定5期 (平成28年11月14日現在)
元本	16,097,800,934	10,104,935,191
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,880,775,295	1,208,416,655
元本等合計	14,217,025,639	8,896,518,536
純資産合計	14,217,025,639	8,896,518,536
負債純資産合計	14,657,216,455	9,034,462,279

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	特定4期 自 平成27年11月13日 至 平成28年 5月12日	特定5期 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14日
営業収益		
受取配当金	613,908,058	389,184,835
受取利息	22,157	-
有価証券売買等損益	2,211,083,635	287,156,834
営業収益合計	1,597,153,420	102,028,001
営業費用		
支払利息	5,389	91,317
受託者報酬	2,633,333	1,836,721
委託者報酬	144,833,250	101,019,599
その他費用	461,465	353,499
営業費用合計	147,933,437	103,301,136
営業利益又は営業損失( )	1,745,086,857	1,273,135
経常利益又は経常損失( )	1,745,086,857	1,273,135
当期純利益又は当期純損失( )	1,745,086,857	1,273,135
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( )	35,420,481	806,012
期首剰余金又は期首欠損金( )	33,069,911	1,880,775,295
剰余金増加額又は欠損金減少額	323,583,353	848,315,805
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	323,583,353	848,315,805
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	159,871,653	13,288,767
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	159,871,653	13,288,767
分配金	301,750,708	162,201,275
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,880,775,295	1,208,416,655

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	特定5期
	自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当特定期間は当期末が休日のため、平成28年 5月13日から平成28年11月14日までとなっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	特定4期 (平成28年 5月12日現在)	特定5期 (平成28年11月14日現在)
1. 当特定期間の末日における受益権の総数	16,097,800,934口	10,104,935,191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 1,880,775,295円	元本の欠損 1,208,416,655円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.8832円 (10,000口当たりの純資産額 8,832円)	1口当たり純資産額 0.8804円 (10,000口当たりの純資産額 8,804円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	特定4期 自 平成27年11月13日 至 平成28年 5月12日	特定5期 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14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  52,641,081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  36,539,763円

<p>2. 分配金の計算過程</p>	<p>（自平成27年11月13日 至平成28年 2月12日）</p> <p>第7計算期間末における費用控除後の配当等収益（217,602,916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（13,041,603円）、および分配準備積立金（42,303,723円）より、分配対象収益は272,948,242円（1万口当たり156.58円）であり、うち156,870,500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28年 2月13日 至平成28年 5月12日）</p> <p>第8計算期間末における費用控除後の配当等収益（222,214,130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（23,971,936円）、および分配準備積立金（88,154,647円）より、分配対象収益は334,340,713円（1万口当たり207.68円）であり、うち144,880,208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28年 5月13日 至平成28年 8月12日）</p> <p>第9計算期間末における費用控除後の配当等収益（155,978,618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（20,426,376円）、および分配準備積立金（133,479,561円）より、分配対象収益は309,884,555円（1万口当たり237.14円）であり、うち91,466,729円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成28年 8月13日 至平成28年11月14日）</p> <p>第10計算期間末における費用控除後の配当等収益（141,075,805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（15,961,407円）、および分配準備積立金（152,956,366円）より、分配対象収益は309,993,578円（1万口当たり306.75円）であり、うち70,734,546円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>
--------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	特定5期 自平成28年 5月13日 至平成28年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当特定期間については、投資信託受益証券、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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	特定5期 (平成28年11月14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	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

特定4期（自 平成27年11月13日 至 平成28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	8,406,220円
親投資信託受益証券	2円
合計	8,406,218円

特定5期（自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14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	378,865,570円
親投資信託受益証券	2円
合計	378,865,568円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

特定5期 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	特定4期 （平成28年 5月12日現在）	特定5期 （平成28年11月14日現在）
期首元本額	18,108,655,091円	16,097,800,934円
期中追加設定元本額	2,492,147,680円	109,827,062円
期中一部解約元本額	4,503,001,837円	6,102,692,805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)	825,847	8,540,083,827	
投資信託受益証券合計		825,847	8,540,083,827	
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			8,540,093,833	

## 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(2015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)	
有価証券に対する投資	36,632
関連ファンドに対する投資	1,515,503
金融デリバティブ商品	
OTC取引	652
現金	1
カウンターパーティー預け金	3,484
投資有価証券売却による未収入金	2
関連ファンド売却による未収入金	1,598
ファンド持分追加設定による未収入金	11,597
未収利息および未収配当金	3
	<u>1,569,472</u>

## 負債：

金融デリバティブ商品	
OTC取引	4,343
投資有価証券購入による未払金	3,105
関連ファンド購入による未払金	10,635
未払利息	8
カウンターパーティー預り金	9
ファンド持分一部解約による未払金	2,516
	<u>20,616</u>
	<u>1,548,856</u>

## 純資産

## 投資明細表(2015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		
2.4%	2.4%	2.2%	0.030% 期日 11/02/2015	USD	4,339
			Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.		USD
			0.030% 期日 11/02/2015		2,430
			Brown Brothers Harriman & Co.		
			0.030% 期日 11/02/2015		8
			Citibank N.A.		
			0.030% 期日 11/02/2015		7,686
			JPMorgan Chase & Co.		
			0.030% 期日 11/02/2015		10,248
			Nordea Bank AB		
			0.030% 期日 11/02/2015		2,471
			Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
			0.030% 期日 11/02/2015		3,323
			Wells Fargo Bank		
			0.030% 期日 11/02/2015		3,604
					<u>34,109</u>
		米国短期国債	(0.005%) 期日 02/25/2016		465
		0.2%	0.003% 期日 01/28/2016		186
			0.016% 期日 02/04/2016		1,081
			0.050% 期日 01/07/2016		791
					<u>2,523</u>
			短期証券合計		<u>36,632</u>
			(原価：36,632米ドル)		
			投資有価証券合計		<u>36,632</u>
			(原価：36,632米ドル)		
関連ファンドに	ミューチュア		PIMCO Bermuda Income Fund (M)		
対する投資	ル・ファンド				
97.8%	97.8%		(原価：1,478,897米ドル)	138,909	<u>1,515,503</u>
			関連ファンドに対する投資合計		<u>1,515,503</u>

(原価：1,478,897米ドル)

投資合計 100.2%	1,552,135
(原価：1,515,529米ドル)	
金融デリバティブ商品 (0.2%)	(3,691)
(原価またはプレミアム、純額(0)米ドル)	
その他の資産および負債(純額) 0.0%	412
純資産 100.0%	<u>1,548,856</u>

## 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(2015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)	
有価証券に対する投資	1,615,056
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	620
OTC取引	6,337
カウンターパーティー預け金	33,419
外国通貨(時価)	927
投資有価証券売却による未収入金	5,736
ファンド持分追加設定による未収入金	10,635
未収利息および未収配当金	9,057
	<u>1,681,787</u>

## 負債：

借入およびその他資金調達取引	
空売り未払金	469
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	696
OTC取引	32,795
投資有価証券購入による未払金	1,948
未払利息	1
カウンターパーティー預り金	2,020
ファンド持分一部解約による未払金	1,739
未払税金	19
	<u>39,687</u>

## 純資産

1,642,100

## 投資明細表(2015年10月31日現在)

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	
投資有価証券	銀行貸付債権証券	Albertson's LLC			
98.4%	4.9%	5.000% 期日 08/25/2019	USD	16	USD 16
		5.500% 期日 08/25/2021		913	915
		AWAS Leasing 2011- Ltd.			
		4.870% 期日 10/02/2021		930	948
		Charter Communications Operating LLC			
		3.000% 期日 07/01/2020		672	666





BPCE S.A.				
12.500% 期日 09/30/2019		800		1,040
CIT Group, Inc.				
4.250% 期日 08/15/2017		40		41
5.000% 期日 05/15/2017		6,025		6,224
5.250% 期日 03/15/2018		8		8
Cooperatieve Centrale Raiffeisen- Boerenleenbank BA				
6.875% 期日 03/19/2020	EUR	100		131
8.375% 期日 07/26/2016	USD	4,680		4,879
8.400% 期日 06/29/2017		600		651
Credit Agricole S.A.				
6.500% 期日 06/23/2021	EUR	300		335
7.500% 期日 06/23/2026	GBP	1,000		1,521
7.875% 期日 01/23/2024	USD	4,346		4,466
Credit Suisse AG				
0.633% 期日 03/11/2016		2,700		2,699
6.500% 期日 08/08/2023		3,000		3,292
Eksporffinans ASA				
2.375% 期日 05/25/2016		500		502
5.500% 期日 05/25/2016		800		816
ERB Hellas PLC				
4.250% 期日 06/26/2018	EUR	3,600		3,078
Goldman Sachs Group, Inc.				
2.750% 期日 09/15/2020	USD	300		302
3.750% 期日 05/22/2025		1,000		1,008
4.750% 期日 10/21/2045		500		508
HBOS PLC				
0.767% 期日 09/01/2016	EUR	400		442
1.027% 期日 09/30/2016	USD	200		200
Host Hotels & Resorts LP				
4.000% 期日 06/15/2025		400		387
HSBC Holdings PLC				
5.250% 期日 09/16/2022	EUR	1,400		1,506
6.000% 期日 09/29/2023		8,210		9,133
6.375% 期日 03/30/2025	USD	400		396
International Lease Finance Corp.				
6.750% 期日 09/01/2016		500		520
8.750% 期日 03/15/2017		1,100		1,189
Jefferies Finance LLC				
6.875% 期日 04/15/2022		1,000		945
Jefferies LoanCore LLC				
6.875% 期日 06/01/2020		2,400		2,364
KBC Bank NV				
8.000% 期日 01/25/2023		800		885
LBG Capital No.2 PLC				
15.000% 期日 12/21/2019	EUR	1,640		2,658
15.000% 期日 12/21/2019	GBP	1,700		3,681
Lloyds Bank PLC				
12.000% 期日 12/16/2024	USD	300		434
Lloyds Banking Group PLC				
7.625% 期日 06/27/2023	GBP	500		816
National Bank of Greece S.A.				
3.875% 期日 10/07/2016	EUR	100		106
Navient Corp.				
5.500% 期日 01/15/2019	USD	40		40
5.625% 期日 08/01/2033		5,353		3,948
6.000% 期日 01/25/2017		200		206
6.250% 期日 01/25/2016		1,080		1,091
8.450% 期日 06/15/2018		700		753
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
2.000% 期日 10/01/2047	DKK	2,999		411

	Novo Banco S.A.				
	2.625% 期日 05/08/2017	EUR	3,100		3,189
	5.000% 期日 04/04/2019		33		33
	5.000% 期日 04/23/2019		4,528		4,600
	5.000% 期日 05/14/2019		119		120
	5.000% 期日 05/21/2019		202		204
	5.875% 期日 11/09/2015		800		883
	Nykredit Realkredit A/S				
	2.000% 期日 10/01/2047	DKK	11,097		1,518
	2.500% 期日 10/01/2047		31,338		4,461
	Prologis LP				
	3.750% 期日 11/01/2025	USD	250		248
	Realkredit Danmark A/S				
	2.500% 期日 10/01/2047	DKK	10,587		1,508
	Rio Oil Finance Trust Series 2014-3				
	6.750% 期日 01/06/2027	USD	700		561
	Royal Bank of Scotland Group PLC				
	7.500% 期日 08/10/2020		500		519
	8.000% 期日 08/10/2025		200		210
	Royal Bank of Scotland PLC				
	9.500% 期日 03/16/2022		1,800		1,968
	13.125% 期日 03/19/2022	AUD	3,700		2,923
	Santander Holdings USA, Inc.				
	4.500% 期日 07/17/2025	USD	4,100		4,174
	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
	3.352% 期日 11/15/2019	EUR	9,400		10,218
	5.717% 期日 06/16/2021	USD	1,300		1,313
	6.125% 期日 02/07/2022		12,600		12,972
	SL Green Realty Corp.				
	7.750% 期日 03/15/2020		500		592
	Societe Generale S.A.				
	8.000% 期日 09/29/2025		1,700		1,720
	Springleaf Finance Corp.				
	5.400% 期日 12/01/2015		3,875		3,887
	5.750% 期日 09/15/2016		600		610
	6.500% 期日 09/15/2017		400		417
	6.900% 期日 12/15/2017		7,390		7,796
	Tesco Property Finance 2 PLC				
	6.052% 期日 10/13/2039	GBP	385		573
	Tesco Property Finance 6 PLC				
	5.411% 期日 07/13/2044		199		270
	TIG FINCO PLC				
	8.500% 期日 03/02/2020		336		544
	8.750% 期日 04/02/2020		1,724		2,474
	UBS AG				
	5.125% 期日 05/15/2024	USD	5,500		5,618
	7.250% 期日 02/22/2022		10,000		10,569
	7.625% 期日 08/17/2022		1,000		1,158
	UBS Group Funding Jersey Ltd.				
	2.950% 期日 09/24/2020		310		311
	4.125% 期日 09/24/2025		2,470		2,486
	Vnesheconombank Via VEB Finance PLC				
	5.942% 期日 11/21/2023		9,700		9,312
	6.902% 期日 07/09/2020		1,600		1,640
					211,817
産業	AbbVie, Inc.				
5.7%	3.600% 期日 05/14/2025		116		114
	Actavis Funding SCS				
	3.000% 期日 03/12/2020		300		302
	Altice Luxembourg S.A.				
	7.250% 期日 05/15/2022	EUR	300		323
	Amgen, Inc.				

3.125% 期日 05/01/2025	USD	200	192
3.625% 期日 05/22/2024		100	102
Boston Scientific Corp.			
3.850% 期日 05/15/2025		200	199
Boxer Parent Co., Inc.			
9.000% 期日 10/15/2019		556	400
Caesars Entertainment Operating Co., INC.			
8.500% 期日 02/15/2020		5,171	4,201
9.000% 期日 02/15/2020		8,069	6,536
11.250% 期日 06/01/2017		3,045	2,428
California Resources Corp.			
5.000% 期日 01/15/2020		2,364	1,732
5.500% 期日 09/15/2021		2,434	1,686
6.000% 期日 11/15/2024		690	472
CCO Safari LLC			
3.579% 期日 07/23/2020		441	443
4.464% 期日 07/23/2022		661	671
4.908% 期日 07/23/2025		992	1,010
6.384% 期日 10/23/2035		441	455
Chesapeake Energy Corp.			
3.571% 期日 04/15/2019		695	450
DISH DBS Corp.			
7.125% 期日 02/01/2016		2,360	2,392
DR Horton, Inc.			
5.625% 期日 01/15/2016		1,100	1,111
First Quantum Minerals Ltd.			
6.750% 期日 02/15/2020		900	690
7.000% 期日 02/15/2021		500	373
7.250% 期日 10/15/2019		300	235
General Motors Financial Co., Inc.			
2.750% 期日 05/15/2016		140	141
HCA, Inc.			
3.750% 期日 03/15/2019		1,045	1,066
6.500% 期日 02/15/2016		500	507
7.190% 期日 11/15/2015		100	100
Hellenic Railways Organization S.A.			
4.028% 期日 03/17/2017	EUR	400	390
4.500% 期日 12/06/2016	JPY	26,000	193
5.014% 期日 12/27/2017	EUR	180	175
iHeartCommunications, Inc.			
9.000% 期日 03/01/2021	USD	789	652
9.000% 期日 09/15/2022		600	493
Imperial Tobacco Finance PLC			
3.500% 期日 02/11/2023		555	548
Intrepid Aviation Group Holdings LLC			
6.875% 期日 02/15/2019		2,406	2,102
Kraft Heinz Foods Co.			
3.950% 期日 07/15/2025		155	159
MGM Resorts International			
7.500% 期日 06/01/2016		2,000	2,062
10.000% 期日 11/01/2016		920	992
North Westerly CLO BV			
1.850 % 期日 06/03/2016	EUR	408	451
Numericable-SFR SAS			
4.875% 期日 05/15/2019		2,410	2,428
5.625% 期日 05/15/2024		4,220	4,788
Perstorp Holding AB			
8.750% 期日 05/15/2017	USD	7,800	8,093
9.000% 期日 05/15/2017	EUR	6,750	7,643
Pertamina Persero PT			
6.450% 期日 05/30/2044	USD	200	186
QVC, Inc.			

	5.450% 期日 08/15/2034		50	45
	Russian Railways via RZD Capital PLC			
	3.374% 期日 05/20/2021	EUR	500	511
	7.487% 期日 03/25/2031	GBP	6,300	9,174
	Schaeffler Holding Finance BV			
	6.875% 期日 08/15/2018	EUR	2,500	2,876
	Sequa Corp.			
	7.000% 期日 12/15/2017	USD	399	202
	Spanish Broadcasting System, Inc.			
	12.500% 期日 04/15/2017		900	923
	Spirit Issuer PLC			
	3.287% 期日 12/28/2031	GBP	760	1,115
	6.582% 期日 12/28/2027		300	495
	Thermo Fisher Scientific, Inc.			
	3.300% 期日 02/15/2022	USD	100	100
	4.150% 期日 02/01/2024		300	314
	Times Square Hotel Trust			
	8.528% 期日 08/01/2026		2,314	2,833
	Tyson Foods, Inc.			
	4.500% 期日 06/15/2022		100	106
	UAL 2009-1 Pass-Through Trust			
	10.400% 期日 11/01/2016		7,289	7,740
	Unique Pub Finance Co. PLC			
	5.659% 期日 06/30/2027	GBP	1,764	2,728
	6.542% 期日 03/30/2021		1,479	2,384
	Univision Communications, Inc.			
	5.125% 期日 02/15/2025	USD	200	197
	6.750% 期日 09/15/2022		23	24
	Valeant Pharmaceuticals International, Inc.			
	4.500% 期日 05/15/2023	EUR	800	721
	Volkswagen Bank GmbH			
	0.377% 期日 11/27/2017		200	212
	Westmoreland Coal Co.			
	8.750% 期日 01/01/2022	USD	710	548
	Wynn Las Vegas LLC			
	5.500% 期日 03/01/2025		1,043	983
				<u>93,917</u>
公共事業	AK Transneft OJSC Via TransCapital Invest Ltd.			
4.6%	8.700% 期日 08/07/2018		200	222
	AT&T, Inc.			
	3.000% 期日 06/30/2022		600	589
	3.400% 期日 05/15/2025		178	173
	EXCO Resources, Inc.			
	7.500% 期日 09/15/2018		105	29
	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
	4.375% 期日 09/19/2022		5,950	5,311
	6.000% 期日 11/27/2023		11,100	10,742
	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.			
	4.300% 期日 11/12/2015		1,400	1,401
	4.950% 期日 02/06/2028		800	709
	5.092% 期日 11/29/2015		400	401
	5.999% 期日 01/23/2021		1,622	1,650
	6.510% 期日 03/07/2022		6,398	6,683
	6.605% 期日 02/13/2018	EUR	100	118
	7.288% 期日 08/16/2037	USD	937	944
	8.146% 期日 04/11/2018		300	326
	8.625% 期日 04/28/2034		2,622	3,001
	9.250% 期日 04/23/2019		7,200	8,114
	Illinois Power Generating Co.			
	6.300% 期日 04/01/2020		35	28
	7.000% 期日 04/15/2018		5,000	4,275

	Linn Energy LLC			
	6.250% 期日 11/01/2019		110	26
	6.500% 期日 05/15/2019		320	85
	7.750% 期日 02/01/2021		370	87
	8.625% 期日 04/15/2020		460	122
	Petrobras Global Finance BV			
	1.953% 期日 05/20/2016		5,091	4,994
	2.000% 期日 05/20/2016		57	56
	2.461% 期日 01/15/2019		3,200	2,583
	2.694% 期日 03/17/2017		999	945
	3.000% 期日 01/15/2019		160	133
	3.214% 期日 03/17/2020		333	256
	3.250% 期日 03/17/2017		759	725
	3.250% 期日 04/01/2019	EUR	320	295
	3.500% 期日 02/06/2017	USD	642	622
	3.875% 期日 01/27/2016		220	220
	4.250% 期日 10/02/2023	EUR	1,400	1,165
	4.375% 期日 05/20/2023	USD	1,330	973
	4.875% 期日 03/17/2020		1,769	1,451
	5.375% 期日 01/27/2021		2,800	2,285
	5.625% 期日 05/20/2043		75	50
	5.750% 期日 01/20/2020		825	706
	5.875% 期日 03/07/2022	EUR	1,000	903
	6.250% 期日 03/17/2024	USD	30	24
	6.250% 期日 12/14/2026	GBP	1,400	1,512
	6.625% 期日 01/16/2034		900	914
	6.750% 期日 01/27/2041	USD	488	347
	6.850% 期日 06/05/2115		2,390	1,652
	6.875% 期日 01/20/2040		260	188
	7.875% 期日 03/15/2019		3,930	3,733
	Sprint Communications, Inc.			
	6.000% 期日 12/01/2016		305	309
	9.125% 期日 03/01/2017		1,400	1,459
	Sprint Corp.			
	7.125% 期日 06/15/2024		270	238
	Verizon Communications, Inc.			
	5.150% 期日 09/15/2023		1,490	1,663
				75,437
				381,171
		社債券等合計		
		(原価: 398,417米ドル)		
地方債	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			
0.1%	7.350% 期日 07/01/2035		100	108
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015			
	7.375% 期日 01/01/2033		440	456
	7.750% 期日 01/01/2042		780	794
		地方債合計		1,1358
		(原価: 1,307米ドル)		
米国政府機関債	Fannie Mae			
0.0%	4.197% 期日 05/25/2025		180	171
	Freddie Mac			
	3.447% 期日 05/25/2025		250	234
	6.354% 期日 06/15/2042		133	37
		米国政府機関債合計		442
		(原価: 467米ドル)		
米国財務省証券	Treasury Inflation Protected Securities			
4.1%	0.125% 期日 04/15/2020		1,119	1,112
	0.250% 期日 01/15/2025		111	107
	0.625% 期日 07/15/2021		85	86
	2.375% 期日 01/15/2025		25,058	28,849
	U.S. Treasury Notes			

	0.094% 期日 04/30/2017		5,957	5,955
	2.125% 期日 05/15/2025		30,840	30,780
		米国財務省証券合計		66,889
		(原価: 67,106米ドル)		
モーゲージ証券	ABFC Trust			
39.9%	0.932% 期日 06/25/2035		5,000	3,856
	Accredited Mortgage Loan Trust			
	0.457% 期日 09/25/2036		1,600	1,361
	0.827% 期日 07/25/2035		9,806	6,993
	ACE Securities Corporation Home Equity loan Trust			
	0.352% 期日 08/25/2036		7,122	5,983
	1.097% 期日 08/25/2035		5,023	3,895
	Aggregator of Loans Backed by Assets PLC			
	2.838% 期日 12/16/2042	GBP	1,692	2,619
	ALESCO Preferred Funding Ltd.			
	0.776% 期日 12/23/2036	USD	5,000	2,900
	Alternative Loan Trust			
	0.367% 期日 07/25/2046		8,336	8,586
	0.377% 期日 07/25/2036		21,157	20,143
	0.384% 期日 09/20/2046		4,619	4,022
	0.447% 期日 12/25/2046		25,244	17,039
	2.558% 期日 08/25/2035		1,616	1,381
	2.673% 期日 09/25/2034		3,713	3,656
	5.500% 期日 08/25/2035		205	200
	5.500% 期日 02/25/2036		48	43
	6.000% 期日 07/25/2037		119	123
	Amerquest Mortgage Securities Trust			
	0.607% 期日 03/25/2036		24,915	17,743
	Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
	0.877% 期日 09/25/2033		95	89
	1.265% 期日 09/25/2032		978	896
	1.952% 期日 10/25/2034		9,000	6,369
	Argent Securities Trust			
	0.377% 期日 04/25/2036		10,133	4,013
	Argent Securities, Inc.			
	2.897% 期日 09/25/2033		2,992	2,874
	Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
	0.947% 期日 03/25/2035		3,317	3,211
	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust			
	0.996% 期日 06/15/2028		5,000	4,988
	Banc of America Alternative Loan Trust			
	5.839% 期日 04/25/2022		647	647
	Banc of America Funding Ltd.			
	0.413% 期日 11/03/2041		1,782	1,759
	BCAP LLC Trust			
	0.022% 期日 11/26/2035		1,482	1,453
	0.335% 期日 09/26/2035		304	302
	0.354% 期日 03/26/2037		2,271	2,235
	0.416% 期日 07/26/2036		1,467	1,400
	0.934% 期日 01/26/2036		1,445	1,433
	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
	2.785% 期日 11/25/2034		54	52
	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
	0.397% 期日 04/25/2037		6,902	6,785
	0.437% 期日 02/25/2037		13,868	12,006
	0.627% 期日 12/25/2035		9,109	8,338
	0.697% 期日 12/25/2035		6,400	5,868
	0.897% 期日 11/25/2035		8,393	7,215

Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
0.457% 期日 10/25/2036		10,873	10,417
2.219% 期日 06/25/2035		3,853	3,447
Bear Stearns Deutsche Bank Trust			
5.116% 期日 09/15/2027		2,405	2,470
5.156% 期日 09/15/2027		1,580	1,610
Blackstone CQP Holdco LP			
2.324% 期日 03/19/2019		5,262	5,315
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage			
5.540% 期日 01/25/2039		3,863	3,358
Celtic Residential Irish Mortgage Securitisation No.12 Ltd.			
0.163% 期日 03/18/2049	EUR	9,527	9,657
Centex Home Equity Loan Trust			
0.627% 期日 03/25/2035	USD	5,514	4,462
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
0.557% 期日 03/25/2035		1,552	1,409
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
0.095% 期日 03/10/2047		25,400	492
Citigroup Mortgage Loan Trust			
0.507% 期日 12/25/2035		17,145	16,071
0.537% 期日 01/25/2036		197	188
2.424% 期日 08/25/2036		9,000	7,549
CNL Commercial Mortgage Loan Trust			
0.637% 期日 10/25/2030		1,432	1,303
Commercial Mortgage Trust			
0.151% 期日 04/10/2047		33,000	445
Conseco Financial Corp.			
7.500% 期日 03/01/2030		73,427	60,383
7.700% 期日 09/15/2026		4,921	5,436
Countrywide Asset-Backed Certificates			
0.367% 期日 06/25/2047		10,071	9,553
0.697% 期日 08/26/2033		36	31
1.802% 期日 01/25/2034		2,054	1,945
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
0.347% 期日 04/25/2046		6,647	6,565
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2.511% 期日 06/25/2034		5	5
2.605% 期日 11/25/2034		37	35
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
0.320% 期日 03/27/2036		2,247	2,204
1.686% 期日 04/15/2027		60,000	457
4.946% 期日 10/26/2036		749	594
CWABS Asset-Backed Certificates Trust			
1.322% 期日 12/25/2034		3,150	2,909
Deco 10 - Pan Europe 4 PLC			
0.139% 期日 10/27/2019	EUR	5,449	5,893
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
0.434% 期日 11/27/2036	USD	8,706	7,544
EMC Mortgage Loan Trust			
1.197% 期日 04/25/2042		3,765	3,587
Eurosail-UK PLC			
1.359% 期日 09/13/2045	GBP	547	746
First Franklin Mortgage Loan Trust			
0.347% 期日 07/25/2036	USD	2,647	2,535
0.357% 期日 04/25/2036		12,387	10,445
GE Business Loan Trust			
0.376% 期日 11/15/2034		8,016	7,622
GreenPoint Mortgage Funding Trust			

0.477% 期日 11/25/2045		152	111
Grifonas Finance PLC			
0.319% 期日 08/28/2039	EUR	1,580	1,278
GSAA Home Equity Trust			
6.500% 期日 11/25/2037	USD	37	28
GSAMP Trust			
0.347% 期日 06/25/2036		10,715	10,099
0.357% 期日 05/25/2046		2,467	2,226
HarborView Mortgage Loan Trust			
0.437% 期日 12/19/2036		802	563
Hercules Eclipse PLC			
0.819% 期日 10/25/2018	GBP	1,136	1,717
Home Equity Asset Trust			
0.507% 期日 07/25/2036	USD	1,037	1,017
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
0.857% 期日 08/25/2035		5,750	4,639
Jefferies Resecuritization Trust			
6.121% 期日 06/25/2047		1,685	1,644
JPMorgan Alternative Loan Trust			
2.621% 期日 03/25/2036		1,188	950
5.730% 期日 03/25/2036		2,198	2,020
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
5.762% 期日 12/12/2034		37	38
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
0.257% 期日 03/25/2047		6	6
0.367% 期日 04/25/2036		1,995	1,965
0.397% 期日 05/25/2036	USD	20,379	18,821
0.467% 期日 08/25/2036		8,600	5,893
LB-UBS Commercial Mortgage Trust			
6.616% 期日 06/15/2036		4,000	4,022
Lehman XS Trust			
0.347% 期日 07/25/2047		1,903	1,857
0.467% 期日 02/25/2036		272	219
Long Beach Mortgage Loan Trust			
0.437% 期日 01/25/2046		1,875	1,771
2.297% 期日 06/25/2034		2,695	2,580
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
0.417% 期日 11/25/2036		48	31
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
2.380% 期日 04/25/2034		7	6
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
0.577% 期日 08/25/2035		89	81
2.184% 期日 02/25/2033		48	46
Morgan Stanley ABS Capital , Inc. Trust			
1.197% 期日 03/25/2033		197	188
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital , Inc. Trust			
0.902% 期日 07/25/2035		4,400	4,141
Morgan Stanley Dean Witter Capital Trust			
7.507% 期日 07/15/2033		8,019	8,947
Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates			
6.450% 期日 01/22/2026		1,072	1,155
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
5.745% 期日 10/25/2036		29,274	15,938
Nomura Resecuritization Trust			
2.466% 期日 11/26/2036		11,460	11,278
NovaStar Mortgage Funding Trust			
0.677% 期日 10/25/2035		2,500	2,035



Option One Mortgage Loan Trust		
0.297% 期日 02/25/2037	7,000	4,154
Quest Trust		
1.147% 期日 03/25/2035	6,060	5,051
RAMP Trust		
0.647% 期日 11/25/2035	13,000	9,951
RBSCF Trust		
5.509% 期日 04/16/2047	25	26
RBSGC Mortgage Loan Trust		
6.000% 期日 01/25/2037	25	23
RBSSP Resecuritization Trust		
0.694% 期日 04/26/2037	491	466
0.694% 期日 03/26/2036	111	109
Renaissance Home Equity Loan Trust		
0.557% 期日 11/25/2034	78	67
1.197% 期日 09/25/2037	86	67
5.612% 期日 04/25/2037	733	401
5.675% 期日 06/25/2037	3,996	2,001
Residential Accredited Securities Corporation		
Trust		
0.347% 期日 01/25/2037	4,234	3,915
0.357% 期日 11/25/2036	13,465	11,586
0.962% 期日 03/25/2034	5,510	5,152
Residential Asset Mortgage Products Trust		
0.414% 期日 10/25/2034	13,418	12,477
0.637% 期日 10/25/2035	5,000	4,763
0.697% 期日 09/25/2035	12,591	9,319
Saxon Asset Securities Trust		
0.992% 期日 03/25/2035	1,929	1,762
1.247% 期日 06/25/2033	2,161	2,020
Securitized Asset-Backed Receivables LLC		
Trust		
0.467% 期日 03/25/2036	13,800	11,196
Sequoia Mortgage Trust		
0.714% 期日 06/20/2034	96	94
Specialty Underwriting & Residential		
Finance Trust		
1.172% 期日 12/25/2035	4,639	4,147
SRERS Funding Ltd.		
0.446% 期日 05/09/2046	11,370	11,000
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan		
Trust		
0.517% 期日 10/25/2035	16,935	15,276
1.622% 期日 05/25/2035	215	150
Structured Asset Investment Loan Trust		
0.347% 期日 06/25/2036	18,387	15,754
1.397% 期日 12/25/2034	12,273	10,879
Structured Asset Mortgage Investments Trust		
0.857% 期日 09/19/2032	118	116
Structured Asset Securities Corporation		
Mortgage Loan Trust		
0.457% 期日 04/25/2036	1,700	1,597
0.697% 期日 04/25/2031	8,945	7,563
Structured Asset Securities Corporation		
Mortgage Pass-Through Certificates		
5.500% 期日 07/25/2033	33	33
Taurus CMBS UK Ltd.		
1.985% 期日 05/01/2022	GBP 2,656	4,060
Theatre Hospitals No.1 PLC		
3.579% 期日 10/15/2031	1,585	2,305
Theatre Hospitals No.2 PLC		
3.579% 期日 10/15/2031	747	1,086



	Pangaea ABS SPV			
	0.220% 期日 12/28/2096	EUR	69	73
	Panther CDO BV			
	0.312% 期日 10/15/2084		6,067	6,418
	RAIT Preferred Funding Ltd.			
	0.487% 期日 06/25/2045	USD	10,272	9,568
	RMF Euro CDO PLC			
	0.438% 期日 09/11/2022	EUR	6,560	7,196
	Skellig Rock BV			
	0.599% 期日 11/30/2022		2,303	2,503
	Sorin Real Estate CDO Ltd.			
	0.623% 期日 10/28/2046	USD	11,350	11,208
	SpringCastle America Funding LLC			
	2.700% 期日 05/25/2023		840	842
	Wood Street CLO BV			
	0.441% 期日 08/27/2022	EUR	2,700	2,892
	資産担保証券合計			142,113
	(原価: 144,802米ドル)			
ソブリン債	Athens Urban Transportation Organisation			
1.0%	4.851% 期日 09/19/2016		1,000	997
	Brazil Letras do Tesouro Nacional			
	0.000% 期日 07/01/2016	BRL	9,900	2,349
	0.000% 期日 10/01/2016		9,900	2,260
	Corp. Andina de Fomento			
	3.950% 期日 10/15/2021	MXN	640	39
	Costa Rica Government International Bond			
	7.000% 期日 04/04/2044	USD	200	181
	Greece Government International Bond			
	3.000% 期日 02/24/2023	EUR	121	100
	3.000% 期日 02/24/2024		265	215
	3.000% 期日 02/24/2025		121	97
	3.000% 期日 02/24/2026		271	212
	3.000% 期日 02/24/2027		661	506
	3.000% 期日 02/24/2028		121	91
	3.000% 期日 02/24/2029		121	89
	3.000% 期日 02/24/2030		121	88
	3.000% 期日 02/24/2031		121	86
	3.000% 期日 02/24/2032		121	84
	3.000% 期日 02/24/2033		121	83
	3.000% 期日 02/24/2034		1,068	725
	3.000% 期日 02/24/2035		231	155
	3.000% 期日 02/24/2036		251	167
	3.000% 期日 02/24/2037		121	80
	3.000% 期日 02/24/2038		121	80
	3.000% 期日 02/24/2039		191	126
	3.000% 期日 02/24/2040		121	80
	3.000% 期日 02/24/2041		121	80
	3.000% 期日 02/24/2042		121	80
	3.800% 期日 08/08/2017	JPY	5,000	36
	4.500% 期日 11/08/2016		120,000	915
	4.500% 期日 07/03/2017		20,000	144
	4.750% 期日 04/17/2019	EUR	2,893	2,929
	5.000% 期日 08/22/2016	JPY	79,900	622
	5.250% 期日 02/01/2016		46,200	368
	Jamaica Government International Bond			
	6.750% 期日 04/28/2028	USD	200	204
	Mexico Government International Bond			
	4.000% 期日 03/15/2115	EUR	400	400
	Russia Government International Bond			
	5.625% 期日 04/04/2042	USD	2,000	2,000
	ソブリン債合計			16,668
	(原価: 15,042米ドル)			

普通株式	Towergate Finance PLC	株式数	296,778	396
0.0%		普通株式合計		396
		(原価:0米ドル)		
短期証券	コマーシャルペーパー	元本金額		
16.5%	Hitachi Capital America Corp.		12,000	11,999
	0.7% 0.450% 期日 11/09/2015			
	レポ取引			
	15.3%			250,500
定期性預金	ANZ National Bank			
0.5%	0.030% 期日 11/02/2015		928	928
	0.080% 期日 11/02/2015	GBP	167	259
	1.104% 期日 11/02/2015	AUD	700	499
	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ LTD.			
	0.005% 期日 11/02/2015	JPY	55	0
	0.030% 期日 11/02/2015	USD	519	519
	Brown Brothers Harriman & Co.			
	(0.800%) 期日 11/02/2015	DKK	1,484	220
	0.030% 期日 11/02/2015	USD	2	2
	0.050% 期日 11/02/2015	CAD	1	1
	0.080% 期日 11/02/2015	GBP	2	4
	1.104% 期日 11/02/2015	AUD	4	3
	Citibank N.A.			
	0.030% 期日 11/02/2015	USD	1,643	1,643
	Deutsche Bank AG			
	0.050% 期日 11/02/2015	CAD	37	29
	HSBC Bank			
	0.080% 期日 11/02/2015	GBP	146	226
	JPMorgan Chase & Co.			
	0.030% 期日 11/02/2015	USD	2,191	2,191
	National Australia Bank Ltd.			
	1.104% 期日 11/02/2015	AUD	202	144
	Nordea Bank AB			
	0.030% 期日 11/02/2015	USD	528	528
	Royal Bank of Canada			
	0.050% 期日 11/02/2015	CAD	5	4
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
	0.005% 期日 11/02/2015	JPY	20	0
	0.030% 期日 11/02/2015	USD	710	710
	0.080% 期日 11/02/2015	GBP	91	141
	Wells Fargo Bank			
	0.030% 期日 11/02/2015	USD	770	770
				8,821
	短期証券合計			271,320
	(原価:271,320米ドル)			
	投資有価証券合計 98.4%			1,615,056
	(原価:1,634,266米ドル)			
	金融デリバティブ商品 1.6%			(26,534)
	(原価またはプレミアム、純額(7,315)米ドル)			
	その他の資産および負債(純額)(3.2%)			53,578
	純資産 100.0%	USD		1,642,100

マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

	（平成28年 5月12日現在）	（平成28年11月14日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,400,840	88,216,662
コール・ローン	7,789,788	-
国債証券	30,729,591	-
特殊債券	274,646,280	89,690,480
未収利息	377,155	212,667
前払費用	159,588	-
流動資産合計	318,103,242	178,119,809
資産合計	318,103,242	178,119,809
負債の部		
流動負債		
未払利息	22	-
その他未払費用	3,892	1,357
流動負債合計	3,914	1,357
負債合計	3,914	1,357
純資産の部		
元本等		
元本	316,969,929	177,498,920
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,129,399	619,532
元本等合計	318,099,328	178,118,452
純資産合計	318,099,328	178,118,452
負債純資産合計	318,103,242	178,119,809

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債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28年 5月12日現在）	（平成28年11月14日現在）
----	-----------------	-----------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	316,969,929口	177,498,920口
2. 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) 1.0036円 10,036円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.0035円 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28年 5月13日 至 平成28年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、特殊債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28年11月14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	<p>(1) 有価証券（特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(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。</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 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。</p>

(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）

自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月14日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

（平成28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	92,824,171円
同期中における追加設定元本額	224,145,758円
同期中における一部解約元本額	-円
平成28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
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CB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CBファンド(為替ヘッジなし)	9,966円
S M A M ・国内株式エンゲージメントファンド<適格機関投資家限定>	224,145,758円
合計	316,969,929円

(平成28年11月14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	316,969,929円
同期中における追加設定元本額	19,926円
同期中における一部解約元本額	139,490,935円
平成28年11月14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
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CB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CBファンド(為替ヘッジなし)	9,966円
アジア高利回り現地通貨建て債券ファンド(毎月分配型)	9,963円

アジア高利回り現地通貨建て債券ファンド（資産成長型）	9,963円
S M A M ・国内株式エンゲージメントファンド＜適格機関投資家限定＞	84,664,823円
合計	177,498,920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
特殊債券	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	15,000,000	15,078,600	
	第870回政府保証公営企業債券	17,000,000	17,028,730	
	第874回政府保証公営企業債券	40,000,000	40,291,600	
	第880回政府保証公営企業債券	17,000,000	17,291,550	
合計		89,000,000	89,690,480	

## 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28年11月30日現在

資産総額	886,722,798円
負債総額	720,488円
純資産総額（ - ）	886,002,310円
発行済口数	904,159,822口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9799円
（1万口当たり純資産額）	（9,799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28年11月30日現在

資産総額	9,203,698,159円
負債総額	123,374,602円
純資産総額（ - ）	9,080,323,557円
発行済口数	9,739,895,114口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9323円
（1万口当たり純資産額）	（9,323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28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。

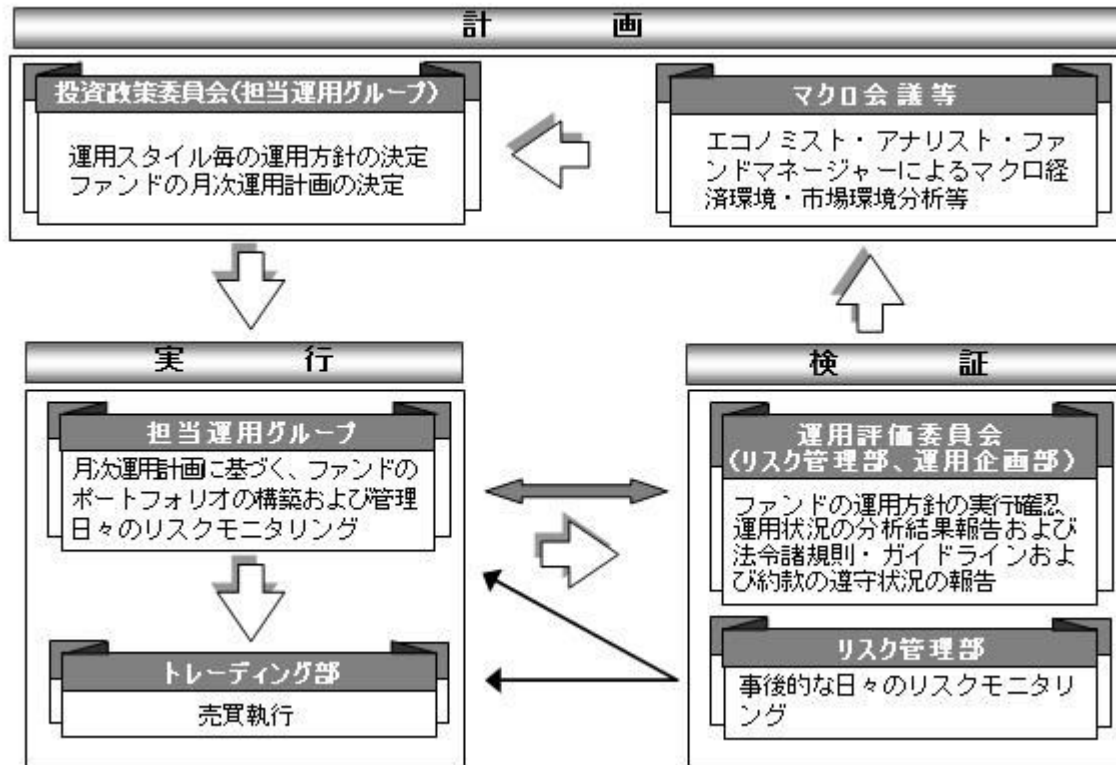
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

平成28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28年11月30日現在）

		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単字型	62 ( 17 )	165,921 ( 66,962 )
	追加型	457 ( 193 )	5,058,907 ( 2,763,617 )
	計	519 ( 210 )	5,244,827 ( 2,830,579 )
公社債投資信託	単字型	79 ( 79 )	359,242 ( 359,242 )
	追加型	1 ( 0 )	26,661 ( 0 )
	計	80 ( 79 )	385,903 ( 359,242 )
合計		599 ( 289 )	5,610,730 ( 3,189,821 )

（ ）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31期（平成27年4月1日から平成28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32期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>資産の部</b>			
<b>流動資産</b>			
現金及び預金	2	25,021,336	10,857,507
顧客分別金信託		-	20,006
前払費用		291,119	324,934
未収入金		41,860	81,347
未収委託者報酬		4,897,032	5,418,116
未収運用受託報酬		1,000,744	1,635,461
未収投資助言報酬		455,390	382,911
未収収益		13,030	28,813
繰延税金資産		475,859	494,032
その他の流動資産		52,473	6,226
<b>流動資産合計</b>		<b>32,248,847</b>	<b>19,249,357</b>
<b>固定資産</b>			
<b>有形固定資産</b>			
建物	1	120,234	154,246
器具備品		230,712	240,748
<b>有形固定資産合計</b>		<b>350,947</b>	<b>394,995</b>
<b>無形固定資産</b>			
ソフトウェア		497,668	449,034
ソフトウェア仮勘定		77,155	146,452
電話加入権		91	79
商標権		222	60
<b>無形固定資産合計</b>		<b>575,137</b>	<b>595,627</b>
<b>投資その他の資産</b>			
投資有価証券		7,151,933	13,115,106
関係会社株式		509,146	10,412,523
長期差入保証金		600,480	603,625
長期前払費用		36,031	32,533
会員権		17,299	17,299

繰延税金資産	665,425	750,481
投資その他の資産合計	8,980,317	24,931,569
固定資産合計	9,906,402	25,922,192
資産合計	42,155,249	45,171,549

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	711	154
未払償還金	143,201	141,808
未払手数料	2,338,432	2,479,778
その他未払金	1,075,587	58,453
<b>未払費用</b>		
未払消費税等	2,095,111	2,092,669
未払法人税等	478,421	317,444
賞与引当金	454,520	992,491
賞与引当金	906,623	982,654
その他の流動負債	808	-
流動負債合計	7,576,142	7,138,557
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212
賞与引当金	-	51,310
その他の固定負債	-	693
固定負債合計	2,633,080	3,080,216
負債合計	10,209,222	10,218,774
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
<b>その他利益剰余金</b>		
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	18,861,359	21,984,811
利益剰余金合計	20,682,564	23,806,015
株主資本計	31,311,548	34,434,999
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	634,478	517,775
評価・換算差額等合計	634,478	517,775
純資産合計	31,946,027	34,952,774
負債・純資産合計	42,155,249	45,171,549

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,094,858		32,339,255	
運用受託報酬	3,862,895		7,401,835	
投資助言報酬	2,106,161		1,909,892	
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	27,345		8,546	
サービス支 hands 手数料	18,274		74,038	
その他	52,255		55,319	
営業収益計	36,166,790		41,793,887	
営業費用				
支払手数料	15,123,724		16,006,652	
広告宣伝費	407,991		615,596	
公告費	4,737		4,507	
調査費				
調査費	1,319,743		1,624,477	
委託調査費	3,550,675		4,106,366	
営業雑経費				
通信費	38,911		43,662	
印刷費	294,002		399,236	
協会費	26,955		23,328	
諸会費	18,577		22,650	
情報機器関連費	2,403,857		2,557,200	
販売促進費	28,281		31,271	
その他	144,250		161,974	
営業費用合計	23,361,707		25,596,925	
一般管理費				
給料				
役員報酬	190,241		181,739	
給料・手当	5,186,853		5,824,767	
賞与	569,685		609,597	
賞与引当金繰入額	906,623		1,033,964	
交際費	22,609		26,912	
寄付金	-		23	
事務委託費	366,661		540,251	
旅費交通費	226,254		277,212	
租税公課	108,953		161,628	
不動産賃借料	552,589		595,051	
退職給付費用	387,799		701,070	
固定資産減価償却費	287,833		334,024	
諸経費	283,156		354,884	
一般管理費合計	9,089,262		10,641,129	
営業利益	3,715,820		5,555,832	
営業外収益				



受取配当金		26,821	36,102
有価証券利息		1,187	-
受取利息	1	6,113	3,728
時効成立分配金・償還金		12	1,394
原稿・講演料		1,899	1,766
雑収入		7,324	19,472
営業外収益合計		43,357	62,465
営業外費用			
為替差損		14,361	51,385
営業外費用合計		14,361	51,385
経常利益		3,744,816	5,566,912
特別利益			
投資有価証券償還益		4,181	13,036
投資有価証券売却益		893,251	38,823
投資有価証券清算益		-	29,214
特別利益合計		897,432	81,075
特別損失			
固定資産除却損	2	1,076	5,300
投資有価証券償還損		-	2,313
投資有価証券売却損		1,091	8,184
その他の特別損失	3	973,862	-
特別損失合計		976,030	15,798
税引前当期純利益		3,666,218	5,632,188
法人税、住民税及び事業税		1,574,213	1,598,176
法人税等調整額		166,505	41,999
法人税等合計		1,740,718	1,556,177
当期純利益		1,925,499	4,076,011

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当期変動額									
剰余金の配当							952,560	952,560	952,560
当期純利益							4,076,011	4,076,011	4,076,011
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,123,451	3,123,451	3,123,451
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999

	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
当期変動額			
剰余金の配当			952,560
当期純利益			4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	116,703	116,703	116,703
当期変動額合計	116,703	116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

[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。

## (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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	258,412千円	281,421千円
器具備品	783,602千円	758,541千円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
現金及び預金	18,853,119千円	4,716,352千円

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28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、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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	355,376千円	296,815千円

#### (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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
受取利息	2,463千円	1,423千円

#### 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	1,076千円	5,300千円

#### 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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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

(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28年6月27日開催の第31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28年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1年以内	572,402	579,592
1年超	1,340,637	756,470
合計	1,913,040	1,336,063

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した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。

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

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

#### 市場リスクの管理

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

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

### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成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)顧客分別金信託	-	-	-
(3)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(4)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(5)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	7,131,075	7,131,075	-
(7)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)顧客からの預り金	-	-	-
(2)未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

当事業年度（平成28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	10,857,507	10,857,507	-
(2)顧客分別金信託	20,006	20,006	-
(3)未収委託者報酬	5,418,116	5,418,116	-
(4)未収運用受託報酬	1,635,461	1,635,461	-

(5)未収投資助言報酬	382,911	382,911	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	13,114,808	13,114,808	-
(7)長期差入保証金	603,625	603,625	-
資産計	32,032,437	32,032,437	-
(1)顧客からの預り金	0	0	-
(2)未払手数料	2,479,778	2,479,778	-
負債計	2,479,778	2,479,778	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	20,560	-
合計	20,858	298
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	509,146	10,412,523
合計	509,146	10,412,523

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

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

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成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	-	-	-
顧客分別金信託	-	-	-	-
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	-	-

当事業年度（平成28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	10,857,507	-	-	-
顧客分別金信託	20,006	-	-	-
未収委託者報酬	5,418,116	-	-	-
未収運用受託報酬	1,635,461	-	-	-
未収投資助言報酬	382,911	-	-	-
長期差入保証金	537,057	66,567	-	-
合計	18,851,060	66,567	-	-

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成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。

当事業年度（平成28年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,852,587	7,058,420	794,166
小計	7,852,587	7,058,420	794,166
(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	5,262,221	5,310,100	47,878
小計	5,262,221	5,310,100	47,878
合計	13,114,808	12,368,520	746,288

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

3. 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

当事業年度(自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28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
327,278	38,823	8,184

(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	当事業年度
	(自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日)	(自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)
退職給付債務の期首残高	1,802,340	2,633,080
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	2,484,508	2,633,080
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の発生額	276	285,510
退職給付の支払額	87,196	135,507
退職給付債務の期末残高	2,633,080	3,028,212

## (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	当事業年度
	(平成27年 3 月31日)	(平成28年 3 月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,633,080	3,028,212
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	2,633,080	3,028,212

## (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	当事業年度
	(自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日)	(自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の費用処理額	276	285,510
その他	152,031	170,430
確定給付制度に係る退職給付費用	387,799	701,070

(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26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
割引率	0.731%	0.000%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度105,357千円、当事業年度125,210千円であります。

## (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27年 3月31日)	当事業年度 (平成28年 3月31日)
(単位：千円)		
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	299,729	303,247
調査費	77,863	74,734
未払金	321,602	44,028
未払事業税	49,504	67,598
その他	48,762	7,369
繰延税金資産小計	797,462	496,977
評価性引当額	321,602	2,945
繰延税金資産合計	475,859	494,032
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	849,431	927,238
特定外国子会社留保金額	211,024	205,413
ソフトウェア償却	62,560	35,707
賞与引当金	-	15,834
投資有価証券評価損	43,051	95
その他	6,291	5,971
繰延税金資産小計	1,172,360	1,190,261
評価性引当額	217,192	211,267
繰延税金資産合計	955,168	978,994
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	289,742	228,513
繰延税金負債合計	289,742	228,513
繰延税金資産の純額	1,141,285	1,244,513

## 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27年 3月31日)	当事業年度 (平成28年 3月31日)
法定実効税率	35.6%	33.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	9.6	5.5
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.1

受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.5	0.0
住民税均等割等	0.2	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.7	1.3
所得税額控除による税額控除	1.3	1.5
その他	0.1	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	47.5	27.6

### 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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産および繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.2%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.8%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。

この税率変更により、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）は62,206千円減少し、法人税等調整額が74,445千円、その他有価証券評価差額金が12,239千円、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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	32,339,255	7,401,835	1,909,892	142,903	41,793,887

## (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

(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。

## 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	S M B 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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	2,740,552	未払手数料	471,118

(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。

## 2. 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B 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	子会社株式の取得	9,877,717	-	-
							委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,810,999.27円	1,981,449.82円
1株当たり当期純利益金額	109,155.30円	231,066.40円

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

りません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,925,499	4,076,011
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)	1,925,499	4,076,011
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		8,667,657
顧客分別金信託		20,007
前払費用		306,916
未収委託者報酬		5,324,329
未収運用受託報酬		1,209,751
未収投資助言報酬		355,952
未収収益		22,873
繰延税金資産		493,517
その他		3,031
流動資産合計		16,404,036
固定資産		
有形固定資産	1	474,760
無形固定資産		615,866
投資その他の資産		
投資有価証券		13,931,717
関係会社株式		10,412,523
その他		1,631,772
投資その他の資産合計		25,976,013
固定資産合計		27,066,640
資産合計		43,470,677
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		98
その他の預り金		79,964

未払金		2,578,503
未払費用		1,682,389
未払法人税等		686,618
前受収益		414
賞与引当金		1,044,361
その他	2	125,455
流動負債合計		6,197,805
固定負債		
退職給付引当金		3,116,174
賞与引当金		30,000
その他		480
固定負債合計		3,146,654
負債合計		9,344,459
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		21,442,639
利益剰余金合計		23,263,844
株主資本合計		33,892,828
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		233,389
評価・換算差額等合計		233,389
純資産合計		34,126,217
負債純資産合計		43,470,677

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		15,185,419
運用受託報酬		2,663,858
投資助言報酬		869,344
その他の営業収益		63,406
営業収益計		18,782,028
営業費用		11,579,429
一般管理費	1	5,398,630

営業利益		1,803,967
営業外収益	2	116,871
営業外費用	3	3,173
経常利益		1,917,665
特別利益	4	179,785
特別損失	5	27,232
税引前中間純利益		2,070,218
法人税、住民税及び事業税		622,698
法人税等調整額		21,268
法人税等合計		601,429
中間純利益		1,468,788

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
中間純利益							1,468,788	1,468,788	1,468,788
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	-	-	-	-	-	-	542,171	542,171	542,171
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,442,639	23,263,844	33,892,828

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当中間期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
中間純利益			1,468,788
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	284,385	284,385	284,385
当中間期変動額合計	284,385	284,385	826,557
当中間期末残高	233,389	233,389	34,126,217

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

### (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．引当金の計上基準

### (1)賞与引当金

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

### (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

### （会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ729千円増加しております。

## （追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

## （中間貸借対照表関係）

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,094,757千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。	当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。
	当座借越極度額の総額 10,000,000千円
	借入実行残高 -
	差引額 10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額248,465千円の支払保証を行っております。	

## （中間損益計算書関係）

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1.減価償却実施額	
有形固定資産	73,172千円
無形固定資産	112,944千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	106,640千円
雑収入	9,734千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	3,173千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	179,784千円
5.特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	10,871千円
事務所移転費用	8,962千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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28年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

## (リース取引関係)

第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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	606,895千円
1年超	785,123千円
合 計	1,392,018千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第32期中間会計期間(平成28年9月30日)

平成28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	8,667,657	8,667,657	-
(2)顧客分別金信託	20,007	20,007	-
(3)未収委託者報酬	5,324,329	5,324,329	-
(4)未収運用受託報酬	1,209,751	1,209,751	-
(5)未収投資助言報酬	355,952	355,952	-
(6)投資有価証券 其他有価証券	13,931,419	13,931,419	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	662,172	662,172	-
資産計	30,171,290	30,171,290	-
(1)顧客からの預り金	98	98	-
(2)未払金 未払手数料	2,393,062	2,393,062	-
負債計	2,393,160	2,393,160	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資 産

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

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

- (6)投資有価証券

    其他有価証券

これらの時価について、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
その他有価証券 非上場株式	298
合計	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523
合計	10,412,523

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

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

(有価証券関係)

第32期中間会計期間(平成28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	5,237,120	4,771,627	465,493
小計	5,237,120	4,771,627	465,493
(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	8,694,298	8,823,400	129,101
小計	8,694,298	8,823,400	129,101

合計	13,931,419	13,595,027	336,392
----	------------	------------	---------

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

(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32期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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	15,185,419	2,663,858	869,344	63,406	18,782,028

(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32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
------------------------------------------

1株当たり純資産額	1,934,592円84銭
1株当たり中間純利益	83,264円67銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(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	34,126,217千円
普通株式に係る純資産額	34,126,217千円
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	1,468,788千円
普通株式に係る中間純利益	1,468,788千円
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。

5【その他】

<更新後>

イ 定款の変更、その他の重要事項

平成28年6月27日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を2名増員し6名以内とする定款の変更が決議されました。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<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28年9月末現在)
(ハ) 事業の内容	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

・ 名称	日本マスタートラスト信託銀行株式会社
・ 資本金の額	10,000百万円(平成28年9月末現在)
・ 事業の内容	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(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	

資本金の額は、平成28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28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】

#### <更新後>

- 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用すること、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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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28年12月27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28年5月13日から平成28年11月14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28年11月14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28年12月27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28年5月13日から平成28年11月14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28年11月14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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成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28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

(注) 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28年11月24日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤陽一	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	池ヶ谷正	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。