

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年2月10日提出
【計算期間】	第3期中(自 平成28年5月13日至 平成28年11月12日)
【ファンド名】	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） 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）
【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
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(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/年1回決算型）

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	376,747,009	99.37
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)		2,391,828	0.63
合計(純資産総額)		379,148,843	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/年1回決算型）

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	1,178,022,096	99.08
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)		10,891,162	0.92
合計(純資産総額)		1,188,923,264	100.00

(2)【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/年1回決算型）

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)
第2期 (平成28年 5月12日)	476,663,763	476,663,763	10,315	10,315
平成27年11月末日	639,515,613		10,201	
12月末日	645,071,950		10,090	
平成28年 1月末日	593,120,079		10,024	
2月末日	572,460,055		9,942	
3月末日	538,850,320		10,139	
4月末日	521,729,631		10,291	

5月末日	473,682,222		10,380	
6月末日	405,965,455		10,360	
7月末日	464,505,283		10,491	
8月末日	431,058,664		10,546	
9月末日	428,588,903		10,578	
10月末日	398,131,055		10,636	
11月末日	379,148,843		10,564	

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)

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)
第2期 (平成28年 5月12日)	1,914,615,309	1,914,615,309	11,111	11,111
平成27年11月末日	2,595,851,478		12,345	
12月末日	2,456,115,309		11,997	
平成28年 1月末日	2,361,446,816		11,751	
2月末日	2,161,840,316		11,187	
3月末日	2,049,335,387		11,278	
4月末日	1,976,146,654		11,342	
5月末日	1,927,504,234		11,315	
6月末日	1,703,324,375		10,571	
7月末日	1,589,074,941		10,934	
8月末日	1,345,059,241		10,794	
9月末日	1,233,521,593		10,719	
10月末日	1,226,523,345		11,192	
11月末日	1,188,923,264		11,911	

【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/年1回決算型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第2期	平成27年 5月13日～平成28年 5月12日	0

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)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第2期	平成27年 5月13日～平成28年 5月12日	0

【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/年1回決算型)

	収益率(%)
第2期	1.0
第3期(中間期)	2.7

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落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/年1回決算型)

	収益率(%)
第2期	7.9
第3期(中間期)	1.3

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

2【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/年1回決算型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第2期	528,872,780	229,236,210
第3期(中間期)	67,812,947	155,606,534

(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/年1回決算型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第2期	1,593,471,323	1,167,340,379
第3期(中間期)	4,211,373	705,587,854

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「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)ならびに同規則第38条の3、第57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、中間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. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(平成28年 5月13日から平成28年11月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (平成28年 5月12日現在)	第3期中間計算期間 (平成28年11月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,111,927	10,074,591
コール・ローン	16,128,734	-
投資信託受益証券	467,554,259	392,375,456
親投資信託受益証券	10,007	10,006
流動資産合計	492,804,927	402,460,053
資産合計	492,804,927	402,460,053
負債の部		
流動負債		
未払金	-	2,094,216
未払解約金	10,834,661	-
未払受託者報酬	94,465	70,880
未払委託者報酬	5,195,259	3,898,467
未払利息	47	-
その他未払費用	16,732	11,816
流動負債合計	16,141,164	6,075,379
負債合計	16,141,164	6,075,379
純資産の部		
元本等		
元本	462,108,878	374,315,291
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	14,554,885	22,069,383
元本等合計	476,663,763	396,384,674
純資産合計	476,663,763	396,384,674
負債純資産合計	492,804,927	402,460,053

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日	第3期中間計算期間 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月12日
営業収益		
受取配当金	17,021,674	14,716,747
受取利息	1,293	-
有価証券売買等損益	11,431,782	775,302
営業収益合計	5,591,185	15,492,049
営業費用		
支払利息	-	2,000
受託者報酬	82,619	70,880
委託者報酬	4,544,202	3,898,467
その他費用	13,705	13,309
営業費用合計	4,640,526	3,984,656
営業利益又は営業損失（ ）	950,659	11,507,393
経常利益又は経常損失（ ）	950,659	11,507,393
中間純利益又は中間純損失（ ）	950,659	11,507,393
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	15,385	2,329,856
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,438,809	14,554,885
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,803,593	3,450,101
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,803,593	3,450,101
剰余金減少額又は欠損金増加額	884,521	5,113,140
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	884,521	5,113,140
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	13,293,155	22,069,383

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期中間計算期間	
	自 平成28年 5月13日	至 平成28年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期		第3期中間計算期間	
	(平成28年 5月12日現在)		(平成28年11月12日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	462,108,878口		374,315,291口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0315円	1口当たり純資産額	1.0590円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,315円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,590円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第2期中間計算期間		第3期中間計算期間	
	自 平成27年 5月13日	至 平成27年11月12日	自 平成28年 5月13日	至 平成28年11月12日

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 1,665,309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 1,412,255円
-------	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期中間計算期間 (平成28年11月12日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第2期 (平成28年 5月12日現在)	第3期中間計算期間 (平成28年11月12日現在)
期首元本額	162,472,308円	462,108,878円
期中追加設定元本額	528,872,780円	67,812,947円
期中一部解約元本額	229,236,210円	155,606,534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)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (平成28年5月12日現在)	第3期中間計算期間 (平成28年11月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17,299,118	49,526,721
コール・ローン	30,620,625	-
投資信託受益証券	1,891,510,746	1,138,629,380
親投資信託受益証券	10,007	10,006
未収入金	-	53,394,712
流動資産合計	1,939,440,496	1,241,560,819
資産合計		
	1,939,440,496	1,241,560,819
負債の部		
流動負債		
未払金	-	5,994,966
未払解約金	4,393,876	71,498,787
未払受託者報酬	363,714	246,618
未払委託者報酬	20,004,486	13,563,794
未払利息	89	-
その他未払費用	63,022	41,256
流動負債合計	24,825,187	91,345,421
負債合計		
	24,825,187	91,345,421
純資産の部		
元本等		
元本	1,723,154,999	1,021,778,518
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	191,460,310	128,436,880
元本等合計	1,914,615,309	1,150,215,398
純資産合計		
	1,914,615,309	1,150,215,398
負債純資産合計	1,939,440,496	1,241,560,819

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 平成27年 5月13日 至 平成27年11月12日	第3期中間計算期間 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月12日
営業収益		
受取配当金	79,893,227	54,155,671
受取利息	7,247	-
有価証券売買等損益	30,145,028	44,588,186
営業収益合計	49,755,446	9,567,485
営業費用		
支払利息	-	8,399
受託者報酬	391,196	246,618
委託者報酬	21,515,938	13,563,794
その他費用	65,140	45,595
営業費用合計	21,972,274	13,864,406
営業利益又は営業損失（ ）	27,783,172	4,296,921
経常利益又は経常損失（ ）	27,783,172	4,296,921
中間純利益又は中間純損失（ ）	27,783,172	4,296,921
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,892,562	19,312,614
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	268,256,653	191,460,310
剰余金増加額又は欠損金減少額	364,937,009	336,387
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	364,937,009	336,387
剰余金減少額又は欠損金増加額	165,427,133	78,375,510
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	165,427,133	78,375,510
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	493,657,139	128,436,880

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期中間計算期間	
	自 平成28年 5月13日	至 平成28年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期		第3期中間計算期間	
	(平成28年 5月12日現在)		(平成28年11月12日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,723,154,999口		1,021,778,518口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.1111円	1口当たり純資産額	1.1257円
	(10,000口当たりの純資産額)	11,111円)	(10,000口当たりの純資産額)	11,257円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第2期中間計算期間		第3期中間計算期間	
	自 平成27年 5月13日	至 平成27年11月12日	自 平成28年 5月13日	至 平成28年11月12日

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 7,863,298円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 4,905,203円
-------	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期中間計算期間 (平成28年11月12日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第2期 (平成28年 5月12日現在)	第3期中間計算期間 (平成28年11月12日現在)
期首元本額	1,297,024,055円	1,723,154,999円
期中追加設定元本額	1,593,471,323円	4,211,373円
期中一部解約元本額	1,167,340,379円	705,587,854円

(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/年1回決算型)は、「ピムコ・パミュダ・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/年1回決算型)は、「ピムコ・パミュダ・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、各中間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>

純資産

1,548,856

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.		
			0.030% 期日 11/02/2015		2,430
			Brown Brothers Harriman & Co.		
			0.030% 期日 11/02/2015	8	8
			Citibank N.A.		
			0.030% 期日 11/02/2015	7,686	7,686

	JPMorgan Chase & Co.			
	0.030% 期日 11/02/2015	10,248		10,248
	Nordea Bank AB			
	0.030% 期日 11/02/2015	2,471		2,471
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
	0.030% 期日 11/02/2015	3,323		3,323
	Wells Fargo Bank			
	0.030% 期日 11/02/2015	3,604		3,604
				<u>34,109</u>
米国短期国債	(0.005)% 期日 02/25/2016	465		465
0.2%	0.003% 期日 01/28/2016	186		186
	0.016% 期日 02/04/2016	1,081		1,081
	0.050% 期日 01/07/2016	791		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 対する投資	ル・ファンド			
97.8%	97.8%			
	PIMCO Bermuda Income Fund (M)			
	(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%			<u>1,552,135</u>
	(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	<u>1,642,100</u>

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) 通貨	
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	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
		CSC Holdings LLC			
		2.688% 期日 04/17/2020		897	896
		DaVita HealthCare Partners, Inc.			
		3.500% 期日 06/24/2021		198	198
		Energy Future Intermediate Holding Co. LLC			
		4.250% 期日 06/19/2016		34,598	34,619
		FCA US LLC			
		3.250% 期日 12/31/2018		1,086	1,084
		HCA, Inc.			
		3.077% 期日 05/01/2018		5,870	5,879
		Hilton Worldwide Finance LLC			
		3.500% 期日 10/26/2020		4,598	4,613
		iHeartCommunications, Inc.			
		6.938% 期日 01/30/2019		11,688	9,822
		Intelsat Jackson Holdings S.A.			
		3.750% 期日 06/30/2019		9,300	9,031
		MGM Resorts International			
		3.500% 期日 12/20/2019		2,546	2,545
		NRG Energy, Inc.			
		2.750% 期日 07/02/2018		1,786	1,740
		Seadrill Operating LP			
		4.000% 期日 02/21/2021		56	33
		Sequa Corp.			
		5.250% 期日 06/19/2017		362	302
		Univision Communications, Inc.			
		4.000% 期日 03/01/2020		7,085	7,046
		Valeant Pharmaceuticals International, Inc.			
		4.000% 期日 04/01/2022		60	56
		銀行貸付債権証券合計			<u>80,409</u>
		(原価: 82,151米ドル)			
社債券等	銀行および金融	AGFC Capital Trust			
23.2%	12.9%	6.000% 期日 01/15/2067		2,200	1,430
		Ally Financial, Inc.			
		2.750% 期日 01/30/2017		1,110	1,118
		3.125% 期日 01/15/2016		200	200
		3.500% 期日 07/18/2016		1,840	1,856
		3.500% 期日 01/27/2019		300	303

5.500% 期日 02/15/2017		2,705	2,813
6.250% 期日 12/01/2017		5,090	5,446
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6.750% 期日 02/18/2020	EUR	2,200	2,394
9.000% 期日 05/09/2018	USD	1,000	1,081
Banco Popular Espanol S.A.			
8.250% 期日 04/10/2020	EUR	9,200	10,023
11.500% 期日 10/10/2018		100	122
Banco Santander S.A.			
6.250% 期日 09/11/2021		5,700	6,091
Bank of America Corp.			
3.875% 期日 08/01/2025	USD	1,220	1,244
Barclays Bank PLC			
7.625% 期日 11/21/2022		2,800	3,202
7.750% 期日 04/10/2023		1,700	1,849
14.000% 期日 06/15/2019	GBP	500	1,003
Barclays PLC			
6.500% 期日 09/15/2019	EUR	700	781
7.875% 期日 09/15/2022	GBP	2,800	4,394
8.000% 期日 12/15/2020	EUR	300	362
8.250% 期日 12/15/2018	USD	200	213
BGC Partners, Inc.			
5.375% 期日 12/09/2019		650	681
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
Eksporthfinans 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	
				93,917

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
	社債券等合計			381,171

		(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	20,379 USD		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

	0.675% 期日 11/28/2039	USD	6,484	6,262
	Ford Credit Auto Owner Trust			
	0.350% 期日 06/15/2016		474	474
	Gallatin CLO Ltd.			
	1.591% 期日 07/15/2023		2,936	2,933
	Gramercy Real Estate CDO Ltd.			
	0.770% 期日 07/25/2035		1,990	1,972
	1.020% 期日 07/25/2035		24,500	23,961
	Harbourmaster CLO 5 BV			
	0.362% 期日 06/15/2020	EUR	674	746
	ING IM CLO Ltd.			
	1.536% 期日 03/14/2022	USD	10,750	10,733
	Jubilee CDO BV			
	0.776% 期日 10/15/2019	EUR	290	321
	Jubilee CDO BV			
	0.402% 期日 08/21/2021		6,000	6,480
	Leopard CLO BV			
	1.754% 期日 04/07/2019		213	235
	LNR CDO Ltd.			
	6.727% 期日 07/24/2037	USD	2,974	3,007
	National Collegiate Student Loan Trust			
	0.327% 期日 06/26/2028		2,599	2,523
	OHA Credit Partners Ltd.			
	1.531% 期日 05/15/2023		8,200	8,185
	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)					
	株式数					
普通株式	Towergate Finance PLC				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 Hitachi Capital America Corp.				元本金額	
16.5%	0.7%	0.450%	期日	11/09/2015	12,000	11,999
	レボ取引					
	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

(単位：円)

	(平成28年 5月12日現在)	(平成28年11月12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	89,704,640
未収利息	377,155	200,115
前払費用	159,588	-
流動資産合計	318,103,242	178,121,417
資産合計	318,103,242	178,121,417
負債の部		
流動負債		
未払利息	22	-
その他未払費用	3,892	574
流動負債合計	3,914	574
負債合計	3,914	574
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	621,923
元本等合計	318,099,328	178,120,843
純資産合計	318,099,328	178,120,843
負債純資産合計	318,103,242	178,121,417

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12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12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 1.0036円 (10,000口当たりの純資産額 10,036円)	1口当たり純資産額 1.0035円 (10,000口当たりの純資産額 10,035円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年11月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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。

（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	96,769,791円
同期中における追加設定元本額	224,206,551円
同期中における一部解約元本額	4,006,413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・ビムコ・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・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／年1回決算型）	9,972円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）	9,972円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／3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・ドウ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド（為替ヘッジあり）	9,966円
日興エドモン・ドウ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド（為替ヘッジなし）	9,966円
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	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
高成長インド・中型株式ファンド	49,986円
アジア好利回りリート・ファンド	99,971円
アジア好利回りリート・ファンド・トルコリラ	99,971円
アジア好利回りリート・ファンド・ブラジルリアル	499,851円
米国ハイインカム・ローン・ファンド(為替ヘッジ型)	499,102円
ヨーロッパ・割安戦略株式ファンド(為替ヘッジなし)	1,995,013円
ヨーロッパ・割安戦略株式ファンド(為替ヘッジあり)	99,751円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)	9,972円
三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)	9,972円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし)	9,972円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ)	9,972円
三井住友・ニュー・アジア・ファンド	9,967円
YOURMIRAI フレキシブル・ボンドアロケーション(為替ヘッジなし)	9,967円
YOURMIRAI フレキシブル・ボンドアロケーション(米ドル円ヘッジ)	9,967円
アジア好利回りリート・ファンド(年1回決算型)	997円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし/年2回決算型)	9,966円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ/年2回決算型)	9,966円
日興フィデリティ世界企業債券ファンド(為替ヘッジあり)	9,966円
日興フィデリティ世界企業債券ファンド(為替ヘッジなし)	9,966円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド(為替ヘッジあり)	9,966円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド(為替ヘッジなし)	9,966円
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

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

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

最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

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	単位型	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	単位型	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)【その他】

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。

5【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第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)
資産の部			
流動資産			
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
流動資産合計		32,248,847	19,249,357
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	120,234	154,246
器具備品		230,712	240,748
有形固定資産合計		350,947	394,995
無形固定資産			
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
無形固定資産合計		575,137	595,627
投資その他の資産			
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)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
未払金		
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
未払費用	2,095,111	2,092,669
未払消費税等	478,421	317,444
未払法人税等	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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	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
評価・換算差額等		
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	
サービス支援手数料	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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

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/年1回決算型）の平成28年5月13日から平成28年11月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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・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）の平成28年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年5月13日から平成28年11月12日まで）の損益の状況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

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。

独立監査人の中間監査報告書

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/年1回決算型）の平成28年5月13日から平成28年11月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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・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）の平成28年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年5月13日から平成28年11月12日まで）の損益の状況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

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。