

【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30年2月8日提出
【計算期間】	第4期中(自 平成29年5月13日至 平成29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)

2017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	48,640,359,040	100.02
親投資信託受益証券	日本	9,998	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,255,036	0.02
合計(純資産総額)		48,631,114,002	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)

2017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	7,110,425,763	100.35
親投資信託受益証券	日本	9,998	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		24,677,269	0.35
合計(純資産総額)		7,085,758,492	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3期 (2017年 5月12日)	1,286,764,994	1,286,764,994	10,908	10,908
2016年11月末日	379,148,843		10,564	
12月末日	386,059,690		10,621	
2017年 1月末日	387,808,480		10,670	
2月末日	463,170,590		10,783	
3月末日	479,507,633		10,812	
4月末日	1,081,080,133		10,853	

5月末日	2,329,596,878		10,947
6月末日	8,540,108,261		10,967
7月末日	14,725,081,027		11,012
8月末日	21,445,569,106		11,066
9月末日	29,107,561,756		11,068
10月末日	39,921,548,123		11,086
11月末日	48,631,114,002		11,080

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3期 (2017年 5月12日)	1,060,685,427	1,060,685,427	12,480	12,480
2016年11月末日	1,188,923,264		11,911	
12月末日	1,151,248,441		12,376	
2017年 1月末日	1,072,206,123		12,181	
2月末日	965,539,974		12,133	
3月末日	917,449,437		12,093	
4月末日	962,908,114		12,139	
5月末日	1,117,941,205		12,239	
6月末日	1,533,216,543		12,453	
7月末日	2,511,111,440		12,340	
8月末日	3,927,273,695		12,333	
9月末日	4,638,877,641		12,631	
10月末日	5,792,980,131		12,726	
11月末日	7,085,758,492		12,589	

【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3期	2016年 5月13日～2017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3期	2016年 5月13日～2017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3期	5.7
第4期(中間期)	1.5

(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3期	12.3
第4期(中間期)	2.3

(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3期	923,447,980	205,922,287
第4期(中間期)	38,178,455,162	308,198,967

(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3期	136,967,160	1,010,238,035
第4期(中間期)	4,317,980,754	192,238,641

(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4期中間計算期間(平成29年 5月13日から平成29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3期 (平成29年 5月12日現在)	第4期中間計算期間 (平成29年11月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	356,383,910
コール・ローン	17,302,548	747,358,303
投資信託受益証券	1,357,714,219	42,811,202,805
親投資信託受益証券	10,003	9,998
流動資産合計	1,375,026,770	43,914,955,016
資産合計	1,375,026,770	43,914,955,016
負債の部		
流動負債		
未払金	83,695,459	502,094,355
未払解約金	-	4,534,058
未払受託者報酬	81,262	2,963,078
未払委託者報酬	4,469,387	162,968,922
未払利息	46	6,142
その他未払費用	15,622	514,147
流動負債合計	88,261,776	673,080,702
負債合計	88,261,776	673,080,702
純資産の部		
元本等		
元本	1,179,634,571	39,049,890,766
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	107,130,423	4,191,983,548
元本等合計	1,286,764,994	43,241,874,314
純資産合計	1,286,764,994	43,241,874,314
負債純資産合計	1,375,026,770	43,914,955,016

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第4期中間計算期間 自 平成29年 5月13日 至 平成29年11月12日
営業収益		
受取配当金	14,716,747	497,513,561
有価証券売買等損益	775,302	178,529,800
営業収益合計	15,492,049	318,983,761
営業費用		
支払利息	2,000	182,892
受託者報酬	70,880	2,963,078
委託者報酬	3,898,467	162,968,922
その他費用	13,309	528,455
営業費用合計	3,984,656	166,643,347
営業利益又は営業損失（ ）	11,507,393	152,340,414
経常利益又は経常損失（ ）	11,507,393	152,340,414
中間純利益又は中間純損失（ ）	11,507,393	152,340,414
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（ ）	2,329,856	1,547,963
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	14,554,885	107,130,423
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,450,101	3,965,223,691
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	3,450,101	3,965,223,691
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,113,140	31,163,017
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,113,140	31,163,017
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（ ）	22,069,383	4,191,983,548

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間	
	自 平成29年 5月13日	至 平成29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3期		第4期中間計算期間	
	(平成29年 5月12日現在)		(平成29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	1,179,634,571口		39,049,890,766口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0908円	1口当たり純資産額	1.1073円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,908円)	(10,000口当たりの純資産額)	11,073円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第3期中間計算期間		第4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	自 平成29年 5月13日	至 平成29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 1,412,255円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 59,999,951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4期中間計算期間 (平成29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3期 (平成29年 5月12日現在)	第4期中間計算期間 (平成29年11月12日現在)
期首元本額	462,108,878円	1,179,634,571円
期中追加設定元本額	923,447,980円	38,178,455,162円
期中一部解約元本額	205,922,287円	308,198,967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3期 （平成29年 5月12日現在）	第4期中間計算期間 （平成29年11月12日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	133,141,101
コール・ローン	20,045,756	154,984,242
投資信託受益証券	1,050,163,827	6,290,684,289
親投資信託受益証券	10,003	9,998
流動資産合計	1,070,219,586	6,578,819,630
資産合計	1,070,219,586	6,578,819,630
負債の部		
流動負債		
未払金	-	166,594,884
未払解約金	-	29,873,921
未払受託者報酬	169,742	513,951
未払委託者報酬	9,335,650	28,267,469
未払利息	53	1,273
その他未払費用	28,714	88,363
流動負債合計	9,534,159	225,339,861
負債合計	9,534,159	225,339,861
純資産の部		
元本等		
元本	849,884,124	4,975,626,237
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	210,801,303	1,377,853,532
元本等合計	1,060,685,427	6,353,479,769
純資産合計	1,060,685,427	6,353,479,769
負債純資産合計	1,070,219,586	6,578,819,630

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第4期中間計算期間 自 平成29年 5月13日 至 平成29年11月12日
営業収益		
受取配当金	54,155,671	105,119,282
有価証券売買等損益	44,588,186	80,661,702
営業収益合計	9,567,485	185,780,984
営業費用		
支払利息	8,399	17,801
受託者報酬	246,618	513,951
委託者報酬	13,563,794	28,267,469
その他費用	45,595	89,914
営業費用合計	13,864,406	28,889,135
営業利益又は営業損失（ ）	4,296,921	156,891,849
経常利益又は経常損失（ ）	4,296,921	156,891,849
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,296,921	156,891,849
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（ ）	19,312,614	1,610,525
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	191,460,310	210,801,303
剰余金増加額又は欠損金減少額	336,387	1,058,120,536
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	336,387	1,058,120,536
剰余金減少額又は欠損金増加額	78,375,510	46,349,631
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	78,375,510	46,349,631
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（ ）	128,436,880	1,377,853,532

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間	
	自 平成29年 5月13日	至 平成29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3期		第4期中間計算期間	
	(平成29年 5月12日現在)		(平成29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	849,884,124口		4,975,626,237口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2480円	1口当たり純資産額	1.2769円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,480円)	(10,000口当たりの純資産額)	12,769円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第3期中間計算期間		第4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	自 平成29年 5月13日	至 平成29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 4,905,203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 10,371,148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4期中間計算期間 （平成29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3期 （平成29年 5月12日現在）	第4期中間計算期間 （平成29年11月12日現在）
期首元本額	1,723,154,999円	849,884,124円
期中追加設定元本額	136,967,160円	4,317,980,754円
期中一部解約元本額	1,010,238,035円	192,238,641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(2016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

68,985

関連ファンドに対する投資

2,284,767

金融デリバティブ商品

OTC取引

3,466

現金

9

カウンターパーティー預け金

52,236

投資有価証券売却による未収入金

1

関連ファンド売却による未収入金

8,681

ファンド持分追加設定による未収入金

25,786

未収利息および未収配当金

16

2,443,947

負債：

金融デリバティブ商品

OTC取引

57,922

投資有価証券購入による未払金

3,960

関連ファンド購入による未払金

22,066

ファンド持分一部解約による未払金

12,326

96,279

純資産

2,347,668

投資有価証券(原価)

68,984

関連ファンドに対する投資(原価)

2,163,101

純資産：

Jクラス(円)

41,585

Jクラス(米ドル)

94,853

発行済口数：

Jクラス(円)

440

Jクラス(米ドル)

967

発行済み受益証券一口当たり純資産価額および買戻価額：

Jクラス(円)

(機能通貨建て：米ドル) 94.43

(NAV報告通貨建て：円) 9,923

Jクラス(米ドル)

(機能通貨建て：米ドル) 98.13

(NAV報告通貨建て：円) 10,312

投資明細表(2016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				
3.0%	3.0%	2.7%	0.150% 期日 11/01/2016	USD	14,858	USD	14,858
			Brown Brothers Harriman & Co.				
			0.150% 期日 11/01/2016		21		21
			Citibank N.A.				
			0.150% 期日 11/01/2016		11,801		11,801
			DBS Bank Ltd.				
			0.150% 期日 11/01/2016		23,416		23,416
			DnB NORBank ASA				
			0.150% 期日 11/01/2016		823		823
			JPMorgan Chase & Co.				
			0.150% 期日 11/01/2016		35		35
			Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
			(0.420%) 期日 11/01/2016	JPY	5		0
			0.150% 期日 11/01/2016	USD	12,715		12,715
							63,669
		米国短期国債	0.269% 期日 01/19/2017		592		592
		0.3%	0.328% 期日 02/02/2017		734		733
			0.436% 期日 03/02/2017		1,778		1,776
			0.453% 期日 03/09/2017		2,218		2,215
							5,316
			短期証券合計				68,985
			(原価：68,984米ドル)				
			投資有価証券合計				68,985
			(原価：68,984米ドル)				
関連ファンドに 対する投資	ミューチュア ル・ファンド		PIMCO Bermuda Income Fund (M)				
97.3%	97.3%		(原価：2,163,101米ドル)		194,946		2,284,767
			関連ファンドに対する投資合計				2,284,767
			(原価：2,163,101米ドル)				
			投資合計 100.3%			USD	2,353,752
			(原価：2,232,085米ドル)				
			金融デリバティブ商品 (2.3%)				(54,456)
			(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) 2.0%				48,372
			純資産 100.0%			USD	2,347,668

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(2016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	2,859,830
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	317
OTC取引	24,442
現金	197
カウンターパーティー預け金	15,584
外国通貨(時価)	811
投資有価証券売却による未収入金	32,857
TBA売却による未収入金	275,891
ファンド持分追加設定による未収入金	25,100
未収利息および未収配当金	13,060
その他の資産	91
	<u>3,248,180</u>

負債：

借入およびその他資金調達取引	
買戻し未払金	49,365
空売り未払金	36,742
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	1,064
OTC取引	14,297
投資有価証券購入による未払金	95,237
TBA購入による未払金	470,392
未払利息	6
カウンターパーティー預り金	21,593
ファンド持分一部解約による未払金	8,681
	<u>697,377</u>

純資産

2,550,803

投資有価証券(原価)

2,888,092

外国通貨(原価)

813

空売りによる収益

36,702

金融デリバティブ商品による収益又は費用(純額)

(17,983)

投資明細表(2016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	(単位：千)
投資有価証券	銀行貸付債権証券	Ancestry.com Operations, Inc.				
112.1%	3.5%	5.250% 期日 10/19/2023	USD	800	USD	803
		Avago Technologies Cayman Finance Ltd.				
		3.535% 期日 02/01/2023		67		68
		AWAS Leasing 2011- Ltd.				
		4.870% 期日 10/02/2021		860		876
		Boyd Gaming Corp.				
		3.534% 期日 09/15/2023		200		202
		Camelot U.S. Acquisition 1 Co.				
		4.750% 期日 10/03/2023		200		200
		Charter Communications Operating LLC				
		3.000% 期日 07/01/2020		665		667
		DaVita, Inc.				
		3.500% 期日 06/24/2021		196		196
		Diamond Resorts International, Inc.				
		7.000% 期日 08/11/2023		1,100		1,091
		Energy Future Intermediate Holding Co. LLC				
		4.250% 期日 12/19/2016		43,296		43,575

3.900% 期日 04/01/2026		330	346
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6.750% 期日 02/18/2020	EUR	2,200	2,332
9.000% 期日 05/09/2018	USD	1,000	1,042
Banco Espirito Santo S.A.			
2.625% 期日 05/08/2017	EUR	3,100	935
Banco Popular Espanol S.A.			
8.250% 期日 04/10/2020		7,600	7,696
Banco Santander S.A.			
6.250% 期日 09/11/2021		5,700	5,844
Bank of America Corp.			
3.875% 期日 08/01/2025	USD	1,120	1,181
Barclays Bank PLC			
7.625% 期日 11/21/2022		5,640	6,306
7.750% 期日 04/10/2023		3,000	3,161
14.000% 期日 06/15/2019	GBP	9,970	15,031
Barclays PLC			
3.250% 期日 02/12/2027		1,000	1,167
6.500% 期日 09/15/2019	EUR	2,300	2,378
7.875% 期日 03/15/2022	USD	1,200	1,194
7.875% 期日 09/15/2022	GBP	5,353	6,412
8.000% 期日 12/15/2020	EUR	600	675
8.250% 期日 12/15/2018	USD	200	203
BGC Partners, Inc.			
5.125% 期日 05/27/2021		400	419
5.375% 期日 12/09/2019		1,450	1,535
BNP Paribas S.A.			
7.625% 期日 03/30/2021		600	629
BPCE S.A.			
12.500% 期日 09/30/2019		800	1,013
Brixmor Operating Partnership LP			
3.250% 期日 09/15/2023		400	400
CIT Group, Inc.			
3.875% 期日 02/19/2019		972	989
4.250% 期日 08/15/2017		40	41
5.000% 期日 05/15/2017		6,025	6,108
5.250% 期日 03/15/2018		1,611	1,672
Citigroup, Inc.			
2.255% 期日 09/01/2023		280	281
Cooperatieve Rabobank UA			
6.625% 期日 06/29/2021	EUR	1,800	2,113
6.875% 期日 03/19/2020		100	130
8.400% 期日 06/29/2017	USD	600	624
Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.			
7.500% 期日 07/08/2026	GBP	600	880
Credit Agricole S.A.			
7.500% 期日 06/23/2026		1,200	1,477
7.875% 期日 01/23/2024	USD	4,346	4,419
Credit Suisse AG			
6.500% 期日 08/08/2023		3,985	4,351
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.			
2.750% 期日 08/08/2025	GBP	600	702
3.750% 期日 03/26/2025	USD	1,300	1,292
Deutsche Bank AG			
1.350% 期日 05/30/2017		400	397
2.717% 期日 05/10/2019		80	79
4.250% 期日 10/14/2021		10,000	10,077
6.000% 期日 09/01/2017		60	62
Digital Euro Finco LLC			
2.625% 期日 04/15/2024	EUR	1,400	1,610
Host Hotels & Resorts LP			
4.000% 期日 06/15/2025	USD	400	406
HSBC Holdings PLC			
2.625% 期日 08/16/2028	GBP	360	417
4.300% 期日 03/08/2026	USD	500	532
6.000% 期日 09/29/2023	EUR	8,210	9,382
International Lease Finance Corp.			

3.875% 期日 04/15/2018	USD	600	615
8.750% 期日 03/15/2017		1,300	1,334
8.875% 期日 09/01/2017		50	53
Jefferies Finance LLC			
6.875% 期日 04/15/2022		1,000	950
Jefferies LoanCore LLC			
6.875% 期日 06/01/2020		1,200	1,140
JPMorgan Chase & Co.			
2.322% 期日 03/01/2021		1,100	1,130
2.550% 期日 03/01/2021		1,000	1,016
2.950% 期日 10/01/2026		7,150	7,085
KBC Bank NV			
8.000% 期日 01/25/2023		800	849
Kennedy Wilson Europe Real Estate PLC			
3.950% 期日 06/30/2022	GBP	500	616
Lloyds Bank PLC			
12.000% 期日 12/16/2024	USD	200	273
Lloyds Banking Group PLC			
3.100% 期日 07/06/2021		200	206
7.500% 期日 06/27/2024		2,900	2,994
7.625% 期日 06/27/2023	GBP	5,526	7,042
7.875% 期日 06/27/2029		1,700	2,213
Loews Corp.			
3.750% 期日 04/01/2026	USD	500	526
Merlin Properties Socimi S.A.			
1.875% 期日 11/02/2026	EUR	900	971
National Australia Bank Ltd.			
1.375% 期日 07/12/2019	USD	1,800	1,787
Navient Corp.			
4.625% 期日 09/25/2017		2,435	2,473
4.875% 期日 06/17/2019		300	303
5.500% 期日 01/15/2019		774	791
5.625% 期日 08/01/2033		4,953	3,950
6.625% 期日 07/26/2021		130	131
8.450% 期日 06/15/2018		585	634
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
2.000% 期日 04/01/2017	DKK	7,700	1,148
2.000% 期日 10/01/2047		2,923	420
Novo Banco S.A.			
5.000% 期日 04/04/2019	EUR	33	28
5.000% 期日 04/23/2019		4,528	3,902
5.000% 期日 05/14/2019		119	102
5.000% 期日 05/21/2019		202	174
Nykredit Realkredit A/S			
1.000% 期日 07/01/2017	DKK	183,300	27,260
2.000% 期日 04/01/2017		7,600	1,131
2.500% 期日 10/01/2047		13,797	2,050
Preferred Term Securities Ltd.			
1.230% 期日 09/23/2035	USD	1,127	935
Preferred Term Securities Ltd.			
1.150% 期日 03/22/2037		1,413	1,018
1.230% 期日 03/22/2037		5,033	2,416
Realkredit Danmark A/S			
1.000% 期日 01/01/2017	DKK	8,478	1,253
1.000% 期日 04/01/2017		17,630	2,613
1.000% 期日 01/01/2018		4,700	704
1.000% 期日 04/01/2018		11,800	1,770
2.000% 期日 01/01/2017		31,300	4,629
2.000% 期日 04/01/2017		64,315	9,573
2.500% 期日 10/01/2047		12,373	1,839
3.000% 期日 10/01/2047		10,261	1,545
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			
9.750% 期日 01/06/2027	USD	657	622
Royal Bank of Scotland Group PLC			
2.500% 期日 03/22/2023	EUR	6,700	7,380
3.875% 期日 09/12/2023	USD	5,000	4,903
4.800% 期日 04/05/2026		1,200	1,226

	7.500% 期日 08/10/2020		1,900	1,748
	8.000% 期日 08/10/2025		1,400	1,334
	8.625% 期日 08/15/2021		2,000	1,995
	Royal Bank of Scotland PLC			
	9.500% 期日 03/16/2022		1,800	1,848
	13.125% 期日 03/19/2022	AUD	3,700	2,920
	Santander Holdings USA, Inc.			
	4.500% 期日 07/17/2025	USD	2,000	2,045
	Santander UK Group Holdings PLC			
	2.875% 期日 08/05/2021		800	798
	7.375% 期日 06/24/2022	GBP	1,900	2,332
	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
	3.352% 期日 11/15/2019	EUR	5,600	6,435
	5.717% 期日 06/16/2021	USD	900	962
	6.125% 期日 02/07/2022		10,600	11,542
	SL Green Realty Corp.			
	7.750% 期日 03/15/2020		500	578
	Societe Generale S.A.			
	7.875% 期日 12/18/2023		600	596
	8.000% 期日 09/29/2025		1,700	1,719
	Sovran Acquisition LP			
	3.500% 期日 07/01/2026		1,200	1,206
	Springleaf Finance Corp.			
	5.250% 期日 12/15/2019		250	252
	6.500% 期日 09/15/2017		400	415
	6.900% 期日 12/15/2017		4,490	4,715
	8.250% 期日 12/15/2020		15,389	16,736
	Tesco Property Finance 2 PLC			
	6.052% 期日 10/13/2039	GBP	2,773	3,567
	Tesco Property Finance 3 PLC			
	5.744% 期日 04/13/2040		167	203
	Tesco Property Finance 4 PLC			
	5.801% 期日 10/13/2040		405	480
	Tesco Property Finance 6 PLC			
	5.411% 期日 07/13/2044		1,990	2,306
	TIG FINCO PLC			
	8.500% 期日 03/02/2020		2,266	2,841
	8.750% 期日 04/02/2020		1,724	1,926
	UBS AG			
	5.125% 期日 05/15/2024	USD	500	521
	7.250% 期日 02/22/2022		10,000	10,160
	7.625% 期日 08/17/2022		1,000	1,161
	UBS Group AG			
	5.750% 期日 02/19/2022	EUR	3,200	3,674
	7.000% 期日 02/19/2025	USD	200	214
	UBS Group Funding Jersey Ltd.			
	2.950% 期日 09/24/2020		310	317
	4.125% 期日 09/24/2025		2,470	2,578
	4.125% 期日 04/15/2026		2,500	2,615
	Ventas Realty LP			
	3.250% 期日 10/15/2026		200	199
	Wells Fargo & Co.			
	2.175% 期日 03/04/2021		500	510
	2.500% 期日 03/04/2021		600	607
	3.000% 期日 10/23/2026		3,910	3,888
				347,354
産業	Aetna, Inc.			
4.8%	2.400% 期日 06/15/2021		55	56
	3.200% 期日 06/15/2026		671	675
	4.250% 期日 06/15/2036		293	298
	4.375% 期日 06/15/2046		245	250
	Altice Luxembourg S.A.			
	7.250% 期日 05/15/2022	EUR	300	350
	Amgen, Inc.			
	4.400% 期日 05/01/2045	USD	200	204
	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.			
	4.700% 期日 02/01/2036		354	393

4.900% 期日 02/01/2046		553	634
BMC Software Finance, Inc.			
8.125% 期日 07/15/2021		37	34
Boston Scientific Corp.			
3.375% 期日 05/15/2022		2,260	2,361
3.850% 期日 05/15/2025		200	210
Boxer Parent Co., Inc.			
9.000% 期日 10/15/2019		519	480
Caesars Entertainment Operating Co., Inc.			
8.500% 期日 02/15/2020		5,726	5,912
9.000% 期日 02/15/2020		8,739	8,977
11.250% 期日 06/01/2017		9,816	9,963
California Resources Corp.			
8.000% 期日 12/15/2022		4,045	2,751
Charter Communications Operating LLC			
3.579% 期日 07/23/2020		441	458
4.464% 期日 07/23/2022		661	705
4.908% 期日 07/23/2025		992	1,072
6.384% 期日 10/23/2035		220	254
Chesapeake Energy Corp.			
4.130% 期日 04/15/2019		189	175
CNPC General Capital Ltd.			
1.720% 期日 11/25/2017		1,500	1,506
CVS Pass-Through Trust			
7.507% 期日 01/10/2032		782	995
Diamond Resorts International, Inc.			
7.750% 期日 09/01/2023		2,949	2,905
Enterprise Inns PLC			
6.375% 期日 02/15/2022	GBP	5,600	6,837
6.500% 期日 12/06/2018		6,560	8,791
6.875% 期日 02/15/2021		50	66
Express Scripts Holding Co.			
4.800% 期日 07/15/2046	USD	219	219
First Quantum Minerals Ltd.			
6.750% 期日 02/15/2020		900	866
7.000% 期日 02/15/2021		500	477
7.250% 期日 10/15/2019		300	297
HCA, Inc.			
3.750% 期日 03/15/2019		1,045	1,071
Hellenic Railways Organization S.A.			
4.028% 期日 03/17/2017	EUR	400	432
4.500% 期日 12/06/2016	JPY	26,000	246
5.014% 期日 12/27/2017	EUR	180	190
Hilton Domestic Operating Co., Inc.			
4.250% 期日 09/01/2024	USD	700	705
Hyatt Hotels Corp.			
4.850% 期日 03/15/2026		200	220
iHeartCommunications, Inc.			
9.000% 期日 03/01/2021		4,900	3,522
9.000% 期日 09/15/2022		966	690
IHO Verwaltungs GmbH			
3.750% 期日 09/15/2026	EUR	100	109
Intrepid Aviation Group Holdings LLC			
6.875% 期日 02/15/2019	USD	2,406	2,190
Kinder Morgan, Inc.			
7.250% 期日 06/01/2018		200	216
Kraft Heinz Foods Co.			
3.000% 期日 06/01/2026		300	297
3.950% 期日 07/15/2025		155	166
4.375% 期日 06/01/2046		326	332
Lennox International, Inc.			
3.000% 期日 11/15/2023		450	450
Norwegian Air Shuttle ASA 2016-1 Class A Pass-Through Trust			
4.875% 期日 05/10/2028		500	502
Perstorp Holding AB			
8.750% 期日 05/15/2017		7,370	7,390

	9.000% 期日 05/15/2017	EUR	3,600	3,963
	QVC, Inc.			
	5.450% 期日 08/15/2034	USD	50	46
	RCI Banque S.A.			
	3.500% 期日 04/03/2018		1,824	1,872
	Russian Railways via RZD Capital PLC			
	7.487% 期日 03/25/2031	GBP	6,300	8,726
	Sabine Pass LNG LP			
	7.500% 期日 11/30/2016	USD	1,240	1,246
	SBA Tower Trust			
	2.877% 期日 07/15/2021		1,500	1,521
	Sequa Corp.			
	7.000% 期日 12/15/2017		399	219
	SFR Group S.A.			
	5.625% 期日 05/15/2024	EUR	3,420	3,944
	7.375% 期日 05/01/2026	USD	5,025	5,082
	Spanish Broadcasting System, Inc.			
	12.500% 期日 04/15/2017		900	898
	Spirit Issuer PLC			
	3.076% 期日 12/28/2031	GBP	760	864
	6.582% 期日 12/28/2027		450	595
	Sprint Spectrum Co. LLC			
	3.360% 期日 09/20/2021	USD	300	302
	Times Square Hotel Trust			
	8.528% 期日 08/01/2026		2,178	2,563
	Transocean, Inc.			
	9.000% 期日 07/15/2023		280	275
	UAL 2009-1 Pass-Through Trust			
	10.400% 期日 11/01/2016		4,890	4,911
	Unique Pub Finance Co. PLC			
	5.659% 期日 06/30/2027	GBP	1,669	2,160
	6.542% 期日 03/30/2021		1,247	1,635
	United Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust			
	3.100% 期日 07/07/2028	USD	500	513
	Valeant Pharmaceuticals International, Inc.			
	4.500% 期日 05/15/2023	EUR	800	674
	Viacom, Inc.			
	2.750% 期日 12/15/2019	USD	400	407
	Volkswagen Bank GmbH			
	0.112% 期日 11/27/2017	EUR	200	218
	Volkswagen Group of America Finance LLC			
	1.650% 期日 05/22/2018	USD	300	299
	Westmoreland Coal Co.			
	8.750% 期日 01/01/2022		710	561
				121,393
公共事業	AT&T, Inc.			
2.9%	5.650% 期日 02/15/2047		264	292
	El Paso Natural Gas Co. LLC			
	8.625% 期日 01/15/2022		1,900	2,374
	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
	4.375% 期日 09/19/2022		5,950	5,887
	6.000% 期日 11/27/2023		12,200	12,948
	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.			
	4.950% 期日 02/06/2028		800	787
	5.999% 期日 01/23/2021		1,622	1,744
	6.510% 期日 03/07/2022		6,398	7,025
	6.605% 期日 02/13/2018	EUR	100	117
	7.288% 期日 08/16/2037	USD	937	1,068
	8.146% 期日 04/11/2018		300	323
	8.625% 期日 04/28/2034		2,622	3,376
	9.250% 期日 04/23/2019		7,200	8,231
	Illinois Power Generating Co.			
	6.300% 期日 04/01/2020		35	14
	7.000% 期日 04/15/2018		5,000	1,900
	Kinder Morgan Energy Partners LP			
	3.450% 期日 02/15/2023		100	100
	Petrobras Global Finance BV			

	3.250% 期日 04/01/2019	EUR	320	355
	3.737% 期日 03/17/2020	USD	2,899	2,858
	4.250% 期日 10/02/2023	EUR	1,400	1,470
	4.375% 期日 05/20/2023	USD	600	545
	4.875% 期日 03/17/2020		1,269	1,281
	5.375% 期日 01/27/2021		1,203	1,194
	5.625% 期日 05/20/2043		75	59
	5.750% 期日 01/20/2020		825	853
	5.875% 期日 03/07/2022	EUR	1,000	1,154
	6.250% 期日 03/17/2024	USD	30	30
	6.250% 期日 12/14/2026	GBP	1,600	1,872
	6.625% 期日 01/16/2034		900	999
	6.750% 期日 01/27/2041	USD	710	633
	6.850% 期日 06/05/2115		2,144	1,833
	6.875% 期日 01/20/2040		464	418
	7.875% 期日 03/15/2019		2,500	2,694
	8.375% 期日 05/23/2021		1,620	1,796
	8.750% 期日 05/23/2026		540	610
	Sprint Communications, Inc.			
	6.000% 期日 12/01/2016		305	306
	7.000% 期日 08/15/2020		500	521
	8.375% 期日 08/15/2017		5,478	5,711
	9.125% 期日 03/01/2017		1,400	1,432
	Sprint Corp.			
	7.125% 期日 06/15/2024		270	254
	Verizon Communications, Inc.			
	4.125% 期日 08/15/2046		270	259
	5.150% 期日 09/15/2023		100	115
				75,438
	社債券等合計			544,185
	(原価: 554,144米ドル)			
地方債	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			
0.1%	6.630% 期日 02/01/2035		655	699
	6.725% 期日 04/01/2035		90	96
	7.350% 期日 07/01/2035		400	449
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015			
	7.375% 期日 01/01/2033		440	474
	7.750% 期日 01/01/2042		780	828
	地方債合計			2,546
	(原価: 2,434米ドル)			
米国政府機 関債	Fannie Mae			
12.3%	2.500% 期日 10/01/2022		765	788
	3.000% 期日 03/01/2031		8,592	8,999
	3.500% 期日 08/01/2042		85	89
	3.500% 期日 02/01/2045		8,531	8,971
	3.500% 期日 07/01/2045		206	217
	3.500% 期日 12/01/2045		862	907
	3.500% 期日 02/01/2046	USD	20,023	21,026
	4.534% 期日 05/25/2025		180	186
	Fannie Mae, TBA			
	2.500% 期日 12/01/2031		3,000	3,082
	3.000% 期日 12/01/2031		3,000	3,136
	3.000% 期日 12/01/2046		107,200	110,160
	3.000% 期日 01/01/2047		5,000	5,128
	3.500% 期日 12/01/2046		22,000	23,075
	Freddie Mac			
	3.000% 期日 08/01/2046		4,941	5,093
	3.784% 期日 05/25/2025		250	258
	6.015% 期日 06/15/2042		116	28
	Freddie Mac, TBA			
	3.000% 期日 12/01/2046		83,000	85,282
	Ginnie Mae			
	4.000% 期日 02/20/2046		330	353

	4.000% 期日 03/20/2046		34,000	36,447
		米国政府機関債合計		313,225
		(原価: 313,905米ドル)		
米国財務省証券	Treasury Inflation Protected Securities			
9.4%	0.125% 期日 04/15/2020		1,131	1,153
	0.625% 期日 07/15/2021		85	90
	2.375% 期日 01/15/2025		25,325	30,004
	U.S. Treasury Bonds			
	3.125% 期日 02/15/2043		78	87
	3.625% 期日 08/15/2043		263	320
	3.625% 期日 02/15/2044		300	365
	3.750% 期日 11/15/2043		120	149
	U.S. Treasury Notes			
	1.125% 期日 09/30/2021		37,390	37,038
	1.250% 期日 10/31/2021		21,800	21,735
	1.375% 期日 08/31/2023		56,200	55,368
	1.500% 期日 01/31/2022		6,300	6,333
	1.625% 期日 02/15/2026		106	104
	1.875% 期日 08/31/2022		12,600	12,870
	2.000% 期日 02/15/2025		13,421	13,680
	2.000% 期日 08/15/2025		10,100	10,275
	2.125% 期日 08/15/2021		42,900	44,465
	2.250% 期日 11/15/2025		6,000	6,224
		米国財務省証券合計		240,260
		(原価: 240,871米ドル)		
モーゲージ証券	Accredited Mortgage Loan Trust			
45.1%	0.794% 期日 09/25/2036		1,600	1,419
	1.164% 期日 07/25/2035		9,806	7,829
	ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
	0.689% 期日 08/25/2036		6,510	5,703
	1.434% 期日 08/25/2035		5,023	4,062
	ALESCO Preferred Funding Ltd.			
	1.313% 期日 12/23/2036		5,000	2,475
	Alternative Loan Trust			
	0.704% 期日 01/25/2037		23,219	21,394
	0.704% 期日 07/25/2046		18,779	16,621
	0.714% 期日 07/25/2036		17,799	13,628
	0.716% 期日 09/20/2046		3,767	2,766
	0.736% 期日 03/20/2046		13,814	10,331
	0.784% 期日 12/25/2046		27,787	17,097
	2.959% 期日 08/25/2035		1,327	1,081
	3.173% 期日 09/25/2034		3,106	3,047
	5.500% 期日 08/25/2035		171	165
	5.500% 期日 02/25/2036		37	32
	6.000% 期日 07/25/2037		93	89
	Ameriquest Mortgage Securities Trust			
	0.944% 期日 03/25/2036	USD	27,500	20,247
	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
	1.596% 期日 09/25/2032		833	773
	2.289% 期日 10/25/2034		9,000	6,661
	Argent Securities Trust			
	0.714% 期日 04/25/2036		9,708	3,949
	Argent Securities, Inc.			
	3.234% 期日 09/25/2033		2,992	2,895
	Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
	1.194% 期日 06/25/2035		456	456
	Asset-Backed Funding Certificates Trust			
	1.269% 期日 06/25/2035		12,354	10,682
	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust			
	1.335% 期日 06/15/2028		5,000	4,995
	Banc of America Alternative Loan Trust			

5.768% 期日 04/25/2022		484	469
6.000% 期日 07/25/2046		4,672	4,099
BCAP LLC Trust			
0.685% 期日 03/26/2037		968	961
0.732% 期日 07/26/2036		1,107	1,052
1.045% 期日 11/26/2035		657	648
1.265% 期日 01/26/2036		70	70
BCRR Trust			
5.858% 期日 07/17/2040		14,720	14,792
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
3.154% 期日 11/25/2034		680	654
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
0.734% 期日 04/25/2037		11,411	12,147
0.774% 期日 02/25/2037		12,309	10,795
0.894% 期日 04/25/2036		12,900	12,134
0.964% 期日 12/25/2035		9,109	8,551
1.034% 期日 12/25/2035		6,400	6,015
1.234% 期日 11/25/2035		7,344	6,495
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
0.794% 期日 10/25/2036		9,606	9,261
2.550% 期日 06/25/2035		3,853	3,514
Blackstone CQP Holdco LP			
9.625% 期日 03/19/2019		9,304	9,409
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage			
5.540% 期日 01/25/2039		3,004	2,239
Celtic Residential Irish Mortgage Securitisation No.12 Ltd.			
0.000% 期日 03/18/2049	EUR	8,647	9,277
Centex Home Equity Loan Trust			
1.179% 期日 03/25/2035	USD	5,514	4,821
CGCMT Trust			
5.858% 期日 07/17/2040		1,028	1,028
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
0.894% 期日 03/25/2035		1,176	1,061
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
0.097% 期日 03/10/2047		25,400	457
Citigroup Mortgage Loan Trust			
0.874% 期日 01/25/2036		197	194
1.154% 期日 12/25/2035		15,398	14,773
2.789% 期日 08/25/2036		8,912	7,439
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
0.794% 期日 01/25/2037		1,860	1,630
1.114% 期日 07/25/2035		3,174	3,063
Commercial Mortgage Trust			
0.151% 期日 04/10/2047		33,000	388
Conseco Financial Corp.			
7.500% 期日 03/01/2030		68,771	57,424
7.700% 期日 09/15/2026		3,881	4,240
Countrywide Asset-Backed Certificates			
0.674% 期日 06/25/2035		1,942	1,510
0.674% 期日 07/25/2037	USD	4,552	3,815
0.704% 期日 06/25/2047		5,255	4,979
1.034% 期日 08/26/2033		36	32
2.139% 期日 01/25/2034		1,500	1,433
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
0.684% 期日 04/25/2046		1,562	1,536
0.774% 期日 03/25/2037		33,000	26,114
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2.954% 期日 06/25/2034		4	4
3.032% 期日 11/25/2034		30	29
5.500% 期日 11/25/2035		8,810	8,282
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
5.695% 期日 10/26/2036		633	466
CWABS Asset-Backed Certificates Trust			
1.659% 期日 12/25/2034		3,150	3,064
Deco 10 - Pan Europe 4 PLC			

0.000% 期日 10/27/2019	EUR	838	915
DECO 12-UK 4 PLC			
0.595% 期日 01/27/2020	GBP	3,655	4,432
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
0.662% 期日 11/27/2036	USD	8,706	8,017
EMC Mortgage Loan Trust			
1.534% 期日 04/25/2042		2,475	2,402
Eurosail PLC			
0.550% 期日 09/10/2044	GBP	1,987	2,391
Eurosail-UK PLC			
1.149% 期日 09/13/2045		8,260	9,130
1.329% 期日 06/13/2045		20,854	23,683
FBR Securitization Trust			
1.209% 期日 10/25/2035	USD	13,418	6,371
1.214% 期日 10/25/2035		19,913	18,641
1.299% 期日 09/25/2035		7,500	5,932
First Franklin Mortgage Loan Trust			
0.684% 期日 07/25/2036		2,167	2,092
0.694% 期日 04/25/2036		10,934	9,690
FORT CRE LLC			
2.025% 期日 05/21/2036		10,299	10,303
GE Business Loan Trust			
0.715% 期日 11/15/2034		5,007	4,644
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
0.814% 期日 11/25/2045		129	93
Grifonas Finance PLC			
0.088% 期日 08/28/2039	EUR	1,435	1,185
GS Mortgage Securities Trust			
5.794% 期日 08/10/2045	USD	16,093	16,287
GSAA Home Equity Trust			
6.500% 期日 11/25/2037		31	22
GSAMP Trust			
0.684% 期日 06/25/2036		8,421	8,043
0.694% 期日 05/25/2046		2,103	1,974
0.964% 期日 11/25/2035		8,032	5,028
HarborView Mortgage Loan Trust			
0.768% 期日 12/19/2036		2,304	1,729
Hawksmoor Mortgages PLC			
1.796% 期日 05/25/2053	GBP	9,800	12,057
Home Equity Asset Trust			
0.844% 期日 07/25/2036	USD	785	773
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
0.714% 期日 06/25/2036		7,769	7,293
1.194% 期日 08/25/2035		5,750	4,816
Jefferies Resecuritization Trust			
6.503% 期日 06/25/2047		1,503	1,399
JPMorgan Alternative Loan Trust			
2.991% 期日 03/25/2036		1,029	811
5.730% 期日 03/25/2036		1,391	1,356
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.			
1.985% 期日 01/15/2033		1,900	1,906
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
5.336% 期日 05/15/2047		955	954
5.431% 期日 06/12/2047	USD	17,149	17,204
5.882% 期日 02/12/2051		5,830	6,018
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			
0.714% 期日 03/25/2036		18,762	17,279
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
0.704% 期日 04/25/2036		1,472	1,454
0.734% 期日 05/25/2036		20,379	19,712
0.804% 期日 05/25/2036		12,851	10,508
0.804% 期日 08/25/2036		8,600	6,282
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			
0.000% 期日 06/15/2045	EUR	8,030	6,752
LB-UBS Commercial Mortgage Trust			
6.114% 期日 07/15/2040	USD	1,500	1,539
6.832% 期日 06/15/2036		1,307	1,307

Long Beach Mortgage Loan Trust			
0.724% 期日 02/25/2036		9,295	6,255
0.724% 期日 03/25/2046		20,393	10,362
0.774% 期日 01/25/2046		1,541	1,463
2.634% 期日 06/25/2034		2,390	2,310
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
3.784% 期日 03/25/2032		3,600	3,660
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
2.705% 期日 04/25/2034		6	6
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
0.754% 期日 11/25/2036		44	29
1.684% 期日 08/25/2037		21,789	17,173
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
0.914% 期日 08/25/2035		66	64
2.625% 期日 02/25/2033		40	39
Merrill Lynch-CFC Commercial Mortgage Trust			
5.485% 期日 03/12/2051		3,450	3,477
Morgan Stanley ABS Capital , Inc. Trust			
1.269% 期日 07/25/2035		5,512	4,566
1.534% 期日 03/25/2033		176	169
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital , Inc. Trust			
1.239% 期日 07/25/2035		4,400	4,224
Morgan Stanley Capital Trust			
5.422% 期日 02/12/2044		1,495	1,496
5.642% 期日 06/11/2042		5,418	5,562
Morgan Stanley Dean Witter Capital Trust			
7.562% 期日 07/15/2033		6,431	6,853
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
0.954% 期日 12/25/2035		27,533	23,504
Morgan Stanley Re-REMIC Trust			
5.794% 期日 08/15/2045		4,519	4,544
Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates			
6.450% 期日 01/22/2026		1,046	1,048
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
1.044% 期日 05/25/2035		7,400	6,100
5.745% 期日 10/25/2036		28,246	14,094
Nomura Resecuritization Trust			
2.880% 期日 11/26/2036		9,970	9,824
NovaStar Mortgage Funding Trust			
0.694% 期日 10/25/2036		8,492	4,708
1.014% 期日 10/25/2035		2,500	2,175
Oncilla Mortgage Funding PLC			
1.780% 期日 12/12/2043	GBP	14,321	17,537
Option One Mortgage Loan Trust			
0.634% 期日 02/25/2037	USD	7,523	4,477
Paragon Mortgages No.13 PLC			
0.641% 期日 01/15/2039	GBP	4,624	5,164
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
0.694% 期日 09/25/2036	USD	30,743	9,897
Quest Trust			
1.484% 期日 03/25/2035		6,060	5,257
RBSCF Trust			
5.509% 期日 04/16/2047		25	25
RBSGC Mortgage Loan Trust			
6.000% 期日 01/25/2037	USD	22	20
RBSSP Resecuritization Trust			
1.022% 期日 04/26/2037		294	277
Renaissance Home Equity Loan Trust			
0.894% 期日 11/25/2034		73	64
1.534% 期日 09/25/2037		81	63
5.612% 期日 04/25/2037		9,461	4,634
5.675% 期日 06/25/2037		3,971	1,925
Residential Accredited Securities Corporation Trust			
0.684% 期日 01/25/2037		3,520	3,301

0.694% 期日 11/25/2036		11,396	10,350
0.825% 期日 01/25/2037		39,641	22,337
1.299% 期日 03/25/2034		4,782	4,523
Residential Asset Mortgage Products Trust			
0.745% 期日 10/25/2034		8,974	8,492
0.974% 期日 10/25/2035		5,000	4,828
0.984% 期日 11/25/2035		13,000	10,382
1.034% 期日 09/25/2035		12,591	9,734
Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC			
0.620% 期日 06/12/2036	GBP	5,859	6,537
Rochester Financing No.2 PLC			
1.679% 期日 06/20/2045		11,153	13,716
Saxon Asset Securities Trust			
1.329% 期日 03/25/2035	USD	1,532	1,416
1.584% 期日 06/25/2033		1,895	1,798
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
0.804% 期日 03/25/2036		12,226	9,963
Sequoia Mortgage Trust			
1.046% 期日 06/20/2034		87	81
Slate No.1 PLC			
1.851% 期日 01/24/2051	GBP	7,819	9,407
2.251% 期日 01/24/2051		2,600	3,075
Soundview Home Loan Trust			
0.814% 期日 06/25/2036	USD	5,975	2,568
0.844% 期日 06/25/2036		47,590	21,728
1.184% 期日 03/25/2036		8,102	4,814
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
1.509% 期日 12/25/2035		4,017	3,653
SRERS Funding Ltd.			
0.780% 期日 05/09/2046		4,215	4,199
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
0.854% 期日 10/25/2035		14,543	12,196
1.942% 期日 05/25/2035		183	128
Structured Asset Investment Loan Trust			
0.684% 期日 06/25/2036		19,626	17,558
1.254% 期日 04/25/2035		4,440	3,897
1.734% 期日 12/25/2034		12,273	11,649
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
1.188% 期日 09/19/2032		101	99
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			
0.794% 期日 04/25/2036		1,462	1,431
1.034% 期日 04/25/2031		8,945	7,793
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates			
5.500% 期日 07/25/2033		28	29
Taurus CMBS UK Ltd.			
1.893% 期日 05/01/2022	GBP	1,790	2,194
Theatre Hospitals No.1 PLC			
3.401% 期日 10/15/2031		1,519	1,783
Theatre Hospitals No.2 PLC			
3.401% 期日 10/15/2031		716	830
Titan Europe Ltd.			
0.000% 期日 04/23/2017	EUR	227	241
Trinity Square PLC			
1.551% 期日 07/15/2051	GBP	869	1,061
Ulysses European Loan Conduit No.27 PLC			
0.561% 期日 07/25/2017		15,550	18,890
VOLT LLC			
3.500% 期日 02/25/2055		1,782	1,788
Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust			
5.500% 期日 04/15/2047		9,750	9,859
Waldorf Astoria Boca Raton Trust			
1.885% 期日 06/15/2029		6,100	6,104
WalMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
1.254% 期日 01/25/2045		219	200

Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust			
1.373% 期日 10/25/2046		28,949	17,365
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
0.744% 期日 03/25/2037		4,140	3,558
0.804% 期日 07/25/2036		10,000	9,058
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
3.066% 期日 10/25/2036		60	56
WF-RBS Commercial Mortgage Trust			
0.430% 期日 03/15/2047		8,800	272
	モーゲージ証券合計		1,149,171
	(原価1,159,142米ドル)		

資産担保証券

12.9%

ACA Euro CLO PLC			
0.542% 期日 06/15/2024	EUR	906	994
Aircraft Certificate Owner Trust			
7.001% 期日 09/20/2022	USD	1,718	1,823
Ares European CLO BV			
2.302% 期日 03/14/2025	EUR	6,000	6,604
Attentus CDO Ltd.			
1.116% 期日 10/09/2041	USD	1,924	1,790
AVANT Loans Funding Trust			
3.920% 期日 08/15/2019		227	228
Business Loan Express Business Loan Trust			
0.824% 期日 09/25/2038		3,271	2,865
1.084% 期日 09/25/2038		1,586	1,360
1.634% 期日 09/25/2038		115	97
Cadogan Square CLO BV			
0.360% 期日 01/17/2023	EUR	1,500	1,621
Capitalsource Real Estate Loan Trust			
1.266% 期日 01/20/2037	USD	4,722	4,390
CVP Cascade CLO-1 Ltd.			
2.330% 期日 01/16/2026		12,000	11,952
DT Auto Owner Trust			
1.440% 期日 11/15/2019		1,500	1,500
Eastland CLO Ltd.			
1.087% 期日 05/01/2022		8,000	7,922
Egret Funding CLO PLC			
0.290% 期日 12/20/2022	EUR	288	316
0.490% 期日 12/20/2022		1,400	1,535
Finn Square CLO Ltd.			
2.052% 期日 12/24/2023	USD	4,500	4,501
Flatiron CLO Ltd.			
2.430% 期日 01/15/2023		4,464	4,472
Gallatin CLO Ltd.			
2.150% 期日 07/15/2023		1,809	1,809
Galleria CDO Ltd.			
1.377% 期日 09/19/2037		3,725	3,561
Gramercy Real Estate CDO Ltd.			
1.332% 期日 07/25/2035		135	135
1.582% 期日 07/25/2035		24,500	24,003
Harbourmaster CLO 7 BV			
0.299% 期日 09/22/2022	EUR	329	361
Harbourmaster CLO 9 BV			
0.127% 期日 05/08/2023		5,000	5,353
Harbourmaster Pro-rata CLO 2 BV			
0.049% 期日 10/15/2022		5,461	5,935
Harvest CLO PLC			
0.037% 期日 04/05/2024		2,473	2,707
Jubilee CDO BV			
0.169% 期日 08/21/2021		6,000	6,551
LNR CDO Ltd.			
6.727% 期日 07/24/2037		470	471
Lockwood Grove CLO LTD			
2.330% 期日 04/25/2025		13,025	13,025

Mariner CLO LLC			
2.221% 期日 07/23/2026		4,800	4,805
MKP CBO Ltd.			
1.788% 期日 05/08/2039		3,323	3,227
MMcapS Funding Ltd.			
1.192% 期日 12/01/2035		2,381	1,928
National Collegiate Commutation Trust			
3.705% 期日 03/25/2038		2,909	2,873
National Collegiate Student Loan Trust			
0.664% 期日 06/26/2028		1,494	1,473
Navient Private Education Loan Trust 2016-A			
2.685% 期日 12/15/2045		10,000	10,568
Navient Student Loan Trust			
1.670% 期日 03/25/2066		4,552	4,558
1.775% 期日 06/25/2065		2,857	2,899
Nelnet Student Loan Trust			
1.377% 期日 09/25/2065		8,000	8,007
OCP CLO Ltd.			
2.330% 期日 07/17/2026		5,000	4,997
OHA Credit Partners Ltd.			
2.038% 期日 05/15/2023		7,505	7,510
OZLM Ltd.			
2.430% 期日 04/17/2026		17,000	17,002
Palmer Square CLO Ltd.			
2.280% 期日 10/17/2025		1,900	1,898
Pangaea ABS SPV			
0.000% 期日 12/28/2096	EUR	1,237	1,316
Panther CDO BV			
0.082% 期日 10/15/2084		2,881	3,103
Progress Residential Trust			
2.035% 期日 09/17/2033	USD	10,000	10,131
Putnam Structured Product CDO Ltd.			
1.209% 期日 01/10/2038		7,318	7,248
2.030% 期日 01/10/2038		11,236	10,899
RAIT Preferred Funding Ltd.			
0.824% 期日 06/25/2045		818	815
Santander Drive Auto Receivables Trust			
1.340% 期日 11/15/2019		8,700	8,704
Shackleton CLO Ltd.			
2.064% 期日 10/20/2023		4,300	4,300
Silver Arrow S.A. 7			
0.000% 期日 07/15/2024	EUR	4,045	4,450
SLM Private Education Loan Trust			
1.850% 期日 06/17/2030	USD	9,895	9,887
SMB Private Education Loan Trust			
1.235% 期日 02/15/2023		557	558
1.435% 期日 07/15/2022		1,262	1,265
Sorin Real Estate CDO Ltd.			
1.043% 期日 10/28/2046		7,770	7,614
SpringCastle America Funding LLC			
3.050% 期日 04/25/2029		4,000	4,040
Telos CLO Ltd.			
2.530% 期日 04/17/2025		2,909	2,915
THL Credit Wind River CLO Ltd.			
2.330% 期日 01/15/2026		10,000	10,017
TICC CLO LLC			
2.575% 期日 08/25/2023		9,307	9,332
Tralee CLO Ltd.			
2.231% 期日 07/20/2026		7,000	6,983
Tropic CDO Ltd.			
1.200% 期日 07/15/2036		18,465	13,295
Utah State Board of Regents			
1.281% 期日 09/25/2056		1,900	1,886
VERTICAL BRIDGE CC LLC			
5.193% 期日 10/15/2046		400	399
Voya CLO Ltd.			
2.056% 期日 03/14/2022		6,075	6,082

	WhiteHorse Ltd.				
	2.078% 期日 02/03/2025		10,000	9,993	
	Wood Street CLO BV				
	0.208% 期日 08/27/2022	EUR	2,700	2,938	
				<u>327,796</u>	
				資産担保証券合計 (原価：327,260米ドル)	
ソブリン債	Argentina Government International Bond				
1.8%	3.875% 期日 01/15/2022		3,400	3,671	
	5.000% 期日 01/15/2027		3,800	3,963	
	6.250% 期日 04/22/2019	USD	500	531	
	Autonomous Community of Catalonia				
	4.300% 期日 11/15/2016	EUR	150	164	
	4.900% 期日 09/15/2021		1,250	1,467	
	Brazil Government International Bond				
	5.625% 期日 02/21/2047	USD	13,200	12,672	
	Corp. Andina de Fomento				
	3.950% 期日 10/15/2021	MXN	659	35	
	Costa Rica Government International Bond				
	7.000% 期日 04/04/2044	USD	200	208	
	Greece Government International Bond				
	3.800% 期日 08/08/2017	JPY	5,000	47	
	4.500% 期日 11/08/2016		120,000	1,143	
	4.500% 期日 07/03/2017		20,000	186	
	Indonesia Government International Bond				
	2.625% 期日 06/14/2023	EUR	3,500	3,994	
	3.750% 期日 06/14/2028		1,200	1,414	
	KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds				
	0.000% 期日 01/14/2032		2,800	2,744	
	Mexico Government International Bond				
	4.000% 期日 03/15/2115		200	199	
	Russia Government International Bond				
	5.625% 期日 04/04/2042	USD	2,000	2,213	
	Saudi Government International Bond				
	2.375% 期日 10/26/2021		1,000	998	
	3.250% 期日 10/26/2026		1,000	987	
	4.500% 期日 10/26/2046		6,600	6,499	
	South Africa Government International Bond				
	10.500% 期日 12/21/2026	ZAR	43,100	3,544	
				<u>46,679</u>	
				ソブリン債合計 (原価：46,405米ドル)	
				株式数	
普通株式	Eurobank Ergasias S.A.		10,169,333	5,998	
0.2%	National Bank of Greece S.A.		1,025,700	209	
	Towergate Finance PLC		296,778	268	
				<u>6,475</u>	
				普通株式合計 (原価：11,543米ドル)	
優先証券	GMAC Capital Trust				
0.0%	6.602% 期日 02/15/2040		11,800	301	
	Stichting AK Rabobank Certificaten				
	6.500%		4,870	603	
				<u>904</u>	
				優先証券合計 (原価：900米ドル)	
短期証券	銀行引受手形				
	Bank of Montreal			元本金額	
5.5%	1.7%	0.757% 期日 11/07/2016	CAD	12,700	9,475
		0.757% 期日 11/02/2016		22,300	16,638
	Bank of Nova Scotia				
	0.772% 期日 11/03/2016		11,100	8,279	
	TD Bank				
	0.777% 期日 11/04/2016		12,700	9,474	
				<u>43,866</u>	

定期預金証書
Barclays Bank PLC

2.5%	1.641% 期日 09/08/2017	USD	4,000	4,003
	1.745% 期日 11/06/2017		4,440	4,441
	Credit Suisse AG			
	1.645% 期日 09/12/2017		10,800	10,815
	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.			
	1.577% 期日 09/19/2017		2,500	2,505
	Natixis S.A.			
	1.553% 期日 09/25/2017		7,000	7,022
	Norinchukin Bank			
	1.589% 期日 10/12/2017		27,500	27,529
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
	1.550% 期日 09/15/2017		4,300	4,309
	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
	1.574% 期日 10/06/2017		2,670	2,674
				<u>63,298</u>
定期性預金	ANZ National Bank			
1.2%	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	163	200
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	6,207	6,207
	Brown Brothers Harriman & Co.			
	(0.568%) 期日 11/01/2016	EUR	1	1
	(0.500%) 期日 11/01/2016	DKK	1	0
	(0.420%) 期日 11/01/2016	JPY	212	2
	0.050% 期日 11/01/2016	CAD	6	4
	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	3	4
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	9	9
	0.728% 期日 11/01/2016	AUD	22	17
	6.550% 期日 11/01/2016	ZAR	8	1
	Citibank N.A.			
	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	1	1
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	4,930	4,930
	DBS Bank Ltd.			
	0.150% 期日 11/01/2016		9,782	9,782
	Deutsche Bank AG			
	(0.568%) 期日 11/01/2016	EUR	415	455
	DnB NORBank ASA			
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	344	344
	0.728% 期日 11/01/2016	AUD	1,640	1,248
	JPMorgan Chase & Co.			
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	15	15
	National Australia Bank Ltd.			
	0.728% 期日 11/01/2016	AUD	284	216
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
	(0.568%) 期日 11/01/2016	EUR	224	246
	(0.420%) 期日 11/01/2016	JPY	47,759	454
	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	989	1,207
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	5,311	5,311
	Wells Fargo Bank			
	6.550% 期日 11/01/2016	ZAR	504	37
				<u>30,691</u>
米国財務省証券	0.471% 期日 03/09/2017	USD	2,670	2,666
0.1%				<u>140,521</u>
	短期証券合計			
	(原価: 141,046米ドル)			
	投資有価証券合計 112.1%			2,859,830
	(原価: 2,888,092米ドル)			
	金融デリバティブ商品 0.4%			9,398
	(原価またはプレミアム(純額))(17,983)米ドル)			
	その他の資産および負債(純額)(12.5%)			(318,425)
	純資産 100.0%			<u>2,550,803</u>

マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

	(平成29年 5月12日現在)	(平成29年11月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	46,637,740	38,663,179
特殊債券	90,725,570	76,544,100
未収利息	146,434	226,635
前払費用	77,829	7,758
流動資産合計	137,587,573	115,441,672
資産合計	137,587,573	115,441,672
負債の部		
流動負債		
未払利息	125	105
その他未払費用	1,255	1,367
流動負債合計	1,380	1,472
負債合計	1,380	1,472
純資産の部		
元本等		
元本	137,153,307	115,126,345
剰余金		
剰余金又は欠損金()	432,886	313,855
元本等合計	137,586,193	115,440,200
純資産合計	137,586,193	115,440,200
負債純資産合計	137,587,573	115,441,672

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年 5月13日 至平成29年11月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、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29年 5月12日現在)	(平成29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	137,153,307口	115,126,345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) 1.0032円 10,032円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.0027円 10,027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29年11月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(特殊債券) 「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)

(平成29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	316,969,929円
同期中における追加設定元本額	39,864円
同期中における一部解約元本額	179,856,486円
平成29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

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
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
グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジあり)	9,969円
グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジなし)	9,969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>	44,798,374円
合計	137,153,307円

(平成29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	137,153,307円
同期中における追加設定元本額	9,970円
同期中における一部解約元本額	22,036,932円
平成29年11月12日現在における元本の内訳	
日興ワールドCBファンド(通貨アルファ戦略コース)	70,000,000円
日興ワールドCBファンド(円ヘッジありコース)	9,500,000円

日興ワールド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
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
グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジあり)	9,969円
グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジなし)	9,969円
グローイング・フロンティア株式ファンド	9,970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>	24,856,206円
合計	115,126,345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

2017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。

2017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。

(2017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	78 (30)	220,595 (126,184)
	追加型	452 (191)	5,558,804 (2,836,082)
	計	530 (221)	5,779,399 (2,962,265)
公社債投資信託	単位型	107 (107)	384,131 (384,131)
	追加型	1 (0)	31,332 (0)
	計	108 (107)	415,463 (384,131)
合計		638 (328)	6,194,862 (3,346,397)

()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

2017年6月27日付で、定款について以下の変更を行いました。

- (イ) 監査体制の見直しにより監査役の員数を1名減員し5名以内とする定款の変更
- (ロ) 公告の方法を日本経済新聞に掲載する方法から、電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由が生じた場合は、日本経済新聞に掲載）とする2018年2月1日付効力発生の定款の変更
- 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32期（平成28年4月1日から平成29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33期中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	2	10,857,507
顧客分別金信託		20,006
前払費用		324,934
未収入金		81,347
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
未収収益		28,813
繰延税金資産		494,032
その他の流動資産		6,226
流動資産合計		19,249,357
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	154,246
器具備品		240,748
有形固定資産合計		394,995
無形固定資産		
ソフトウェア		449,034
ソフトウェア仮勘定		146,452
電話加入権		79
商標権		60
無形固定資産合計		595,627
投資その他の資産		
投資有価証券		13,115,106
関係会社株式		10,412,523
長期差入保証金		603,625
長期前払費用		32,533
会員権		17,299
繰延税金資産		750,481
投資その他の資産合計		24,931,569
		21,352,691
		459,864
		634,903
		12,098,372
		10,412,523
		677,681
		61,282
		7,819
		871,577
		24,129,257

固定資産合計	25,922,192	25,224,025
資産合計	45,171,549	46,576,717

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	0	304
その他の預り金	73,103	80,380
未払金		
未払収益分配金	154	655
未払償還金	141,808	140,124
未払手数料	2,479,778	2,424,318
その他未払金	58,453	52,903
未払費用	2,092,669	2,564,625
未払消費税等	317,444	160,571
未払法人税等	992,491	661,467
賞与引当金	982,654	1,001,068
その他の流動負債	-	445
流動負債合計	7,138,557	7,086,864
固定負債		
退職給付引当金	3,028,212	3,177,131
賞与引当金	51,310	40,167
その他の固定負債	693	2,174
固定負債合計	3,080,216	3,219,473
負債合計	10,218,774	10,306,337
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	21,984,811	23,493,074
利益剰余金合計	23,806,015	25,314,279
株主資本計	34,434,999	35,943,263
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,775	327,116
評価・換算差額等合計	517,775	327,116
純資産合計	34,952,774	36,270,379
負債・純資産合計	45,171,549	46,576,717

(2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,339,255	31,628,014
運用受託報酬	7,401,835	5,649,190
投資助言報酬	1,909,892	1,726,511
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	8,546	-
サービス支援手数料	74,038	61,268
その他	55,319	54,261
営業収益計	41,793,887	39,124,246
営業費用		
支払手数料	16,006,652	14,908,517
広告宣伝費	615,596	366,227
公告費	4,507	1,140
調査費		
調査費	1,624,477	1,325,978
委託調査費	4,106,366	4,343,104
営業雑経費		
通信費	43,662	46,030
印刷費	399,236	338,254
協会費	23,328	21,669
諸会費	22,650	20,054
情報機器関連費	2,557,200	2,516,497
販売促進費	31,271	24,896
その他	161,974	149,177
営業費用合計	25,596,925	24,061,549
一般管理費		
給料		
役員報酬	181,739	225,885
給料・手当	5,824,767	6,121,741
賞与	609,597	610,533
賞与引当金繰入額	1,033,964	989,925
交際費	26,912	23,136
寄付金	23	-
事務委託費	540,251	317,928
旅費交通費	277,212	229,248
租税公課	161,628	268,527
不動産賃借料	595,051	622,662
退職給付費用	701,070	423,954
固定資産減価償却費	334,024	384,068
諸経費	354,884	335,840
一般管理費合計	10,641,129	10,553,451
営業利益	5,555,832	4,509,246
営業外収益		
受取配当金	1	36,102
受取利息	1	3,728
時効成立分配金・償還金		1,394
原稿・講演料		1,766

雑収入		19,472	12,592
営業外収益合計		62,465	123,184
営業外費用			
為替差損		51,385	9,737
雑損失		-	1,084
営業外費用合計		51,385	10,821
経常利益		5,566,912	4,621,608
特別利益			
投資有価証券償還益		13,036	353,462
投資有価証券売却益		38,823	2,579
投資有価証券清算益		29,214	-
特別利益合計		81,075	356,041
特別損失			
固定資産除却損	2	5,300	8,157
投資有価証券償還損		2,313	43,644
投資有価証券売却損		8,184	15,012
ゴルフ会員権売却損		-	3,894
事務所移転費用		-	21,175
特別損失合計		15,798	91,884
税引前当期純利益		5,632,188	4,885,765
法人税、住民税及び事業税		1,598,176	1,391,996
法人税等調整額		41,999	25,454
法人税等合計		1,556,177	1,366,541
当期純利益		4,076,011	3,519,223

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位:千円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当		-	2,010,960
当期純利益		-	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(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)を当事業年度に適用し、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ2,218千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)を当事業年度から適用しております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	281,421千円	291,976千円
器具備品	758,541千円	651,918千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
現金及び預金	4,716,352千円	-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28年3月31日)	当事業年度 (平成29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	296,815千円	256,031千円

(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27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
受取配当金	-	106,640千円
受取利息	1,423千円	18千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	6,952千円
器具備品	5,300千円	1,204千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
平成29年6月27日開催の第32回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1年以内	579,592	626,698
1年超	756,470	191,491
合計	1,336,063	818,190

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確

保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成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	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成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	-	-

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位：千円)

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

(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。

当事業年度(平成29年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(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。

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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

当事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

(単位:千円)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,633,080	3,028,212
勤務費用	225,881	280,524
利息費用	19,247	-
数理計算上の差異の発生額	285,510	15,494
退職給付の支払額	135,507	116,111
退職給付債務の期末残高	3,028,212	3,177,131

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,028,212	3,177,131
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,028,212	3,177,131

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
勤務費用	225,881	280,524
利息費用	19,247	-
数理計算上の差異の費用処理額	285,510	15,494
その他	170,430	158,924
確定給付制度に係る退職給付費用	701,070	423,954

(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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
割引率	0.000%	0.092%

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125,210千円、当事業年度137,310千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
--	------------------------	------------------------

流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	303,247	308,929
調査費	74,734	79,381
未払金	44,028	45,745
未払事業税	67,598	46,406
その他	7,369	2,071
繰延税金資産小計	496,977	482,535
評価性引当額	2,945	-
繰延税金資産合計	494,032	482,535
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	927,238	972,837
特定外国子会社留保金額	205,413	-
ソフトウェア償却	35,707	18,718
賞与引当金	15,834	12,299
投資有価証券評価損	95	95
その他	5,971	14,592
繰延税金資産小計	1,190,261	1,018,544
評価性引当額	211,267	2,597
繰延税金資産合計	978,994	1,015,946
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	228,513	144,368
繰延税金負債合計	228,513	144,368
繰延税金資産の純額	1,244,513	1,354,113

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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率	33.0%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	5.5	0.1
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.0	0.8
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.5	2.2
その他	1.3	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6	27.9

(注)前事業年度において、独立掲記しておりました「税率変更による期末繰延税金資産の減額修正」は、重要性が乏しくなったため、当事業年度より「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の内訳の組替えを行っております。この結果、前事業年度の「税率変更による期末繰延税金資産の減額修正」として表示していた1.3%は「その他」として組み替えております。

(セグメント情報等)

前事業年度(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 営業収益	32,339,255	7,401,835	1,909,892	142,903	41,793,887

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(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	1,770,986,505	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

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	SMBC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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等の所 有 (被所有)割合	関連当事者と の 関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残 高
子会社	Sunitomo Mitsui Asset Management (Hong Kong) Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコンド ル)	投資運用業	% (所有) 直接100	投信の助言業 務 役員の兼任	剰余金の配 当	106,640	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

(2) 兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

3. (株)三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付けで、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付けで「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。

4. SMBC日興証券(株)の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より

「親会社の子会社」に異動となりました。

なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

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

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
1株当たり純資産額	1,981,449.82円	2,056,143.98円
1株当たり当期純利益金額	231,066.40円	199,502.47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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,076,011	3,519,223
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)	4,076,011	3,519,223
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33期中間会計期間 (平成29年 9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		14,667,306
顧客分別金信託		20,009
前払費用		398,529
未収委託者報酬		5,467,704
未収運用受託報酬		1,390,552
未収投資助言報酬		331,978
未収収益		30,823
繰延税金資産		484,857
その他		20,343
流動資産合計		22,812,104
固定資産		
有形固定資産	1	449,121
無形固定資産		689,045

投資その他の資産		
投資有価証券		11,924,034
関係会社株式		10,412,523
その他		1,439,858
投資その他の資産合計		23,776,417
固定資産合計		24,914,583
資産合計		47,726,688
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		243
その他の預り金		18,672
未払金		2,563,327
未払費用		3,141,458
未払法人税等		908,285
前受収益		8,531
賞与引当金		977,049
その他	2	255,033
流動負債合計		7,872,601
固定負債		
退職給付引当金		3,313,253
賞与引当金		20,083
その他		995
固定負債合計		3,334,332
負債合計		11,206,933
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		23,341,758
利益剰余金合計		25,162,963
株主資本合計		35,791,947
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		727,807
評価・換算差額等合計		727,807
純資産合計		36,519,754
負債純資産合計		47,726,688

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		17,308,525
運用受託報酬		2,835,650
投資助言報酬		727,606
その他の営業収益		74,834
営業収益計		20,946,618
営業費用		13,255,417
一般管理費	1	5,122,317
営業利益		2,568,883
営業外収益	2	49,201
営業外費用	3	8,278
経常利益		2,609,805
特別利益	4	31,986
特別損失	5	106,330
税引前中間純利益		2,535,462
法人税、住民税及び事業税		827,642
法人税等調整額		28,344
法人税等合計		799,298
中間純利益		1,736,163

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当中間期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
中間純利益							1,736,163	1,736,163	1,736,163
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	-	-	-	-	-	-	151,316	151,316	151,316
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,341,758	25,162,963	35,791,947

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	327,116	327,116	36,270,379
当中間期変動額			
剰余金の配当			1,887,480

中間純利益			1,736,163
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	400,690	400,690	400,690
当中間期変動額合計	400,690	400,690	249,374
当中間期末残高	727,807	727,807	36,519,754

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）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。

(中間貸借対照表関係)

第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,008,543千円
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237,363千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日至平成29年9月30日)	
1.減価償却実施額	
有形固定資産	64,918千円
無形固定資産	99,520千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	42,925千円
雑益	6,025千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	8,278千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	30,103千円
5.特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	106,200千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間（自 平成29年 4月 1日 至 平成29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29年 6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

(リース取引関係)

第33期中間会計期間 (自 平成29年 4月 1日 至 平成29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	477,255千円
1年超	28,771千円
合 計	506,027千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第33期中間会計期間（平成29年 9月30日）

平成29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	14,667,306	14,667,306	-
(2)顧客分別金信託	20,009	20,009	-
(3)未収委託者報酬	5,467,704	5,467,704	-
(4)未収運用受託報酬	1,390,552	1,390,552	-
(5)未収投資助言報酬	331,978	331,978	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	11,923,736	11,923,736	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	656,670	656,670	-
資産計	34,457,958	34,457,958	-
(1)顧客からの預り金	243	243	-
(2)未払金 未払手数料	2,365,135	2,365,135	-
負債計	2,365,378	2,365,378	-

(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

その他有価証券

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

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

(7) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

負債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	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33期中間会計期間（平成29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	8,658,097	7,538,725	1,119,372
小計	8,658,097	7,538,725	1,119,372
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,265,638	3,335,995	70,356
小計	3,265,638	3,335,995	70,356
合計	11,923,736	10,874,721	1,049,015

(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33期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	17,308,525	2,835,650	727,606	74,834	20,946,618

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

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33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,070,280円85銭
1株当たり中間純利益	98,421円97銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。</p>	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	36,519,754千円
普通株式に係る純資産額	36,519,754千円
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	1,736,163千円
普通株式に係る中間純利益	1,736,163千円
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29年6月16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29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29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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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29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29年4月1日から平成29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. XBR 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29年12月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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29年5月13日から平成29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29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29年5月13日から平成29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29年12月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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29年5月13日から平成29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29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29年5月13日から平成29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。