

**【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31年2月7日提出
【計算期間】	第5期中(自 平成30年5月15日至 平成30年11月14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)

2018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	49,933,036,305	99.07
親投資信託受益証券	日本	7,758,445	0.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		460,633,109	0.91
合計(純資産総額)		50,401,427,859	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)

2018年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	バミューダ	8,945,023,494	99.42
親投資信託受益証券	日本	1,339,727	0.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		50,859,800	0.57
合計(純資産総額)		8,997,223,021	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4期 (2018年 5月14日)	58,537,704,233	58,537,704,233	10,869	10,869
2017年11月末日	48,631,114,002		11,080	
12月末日	55,951,062,336		11,051	
2018年 1月末日	57,393,225,619		10,993	
2月末日	57,419,310,738		10,938	
3月末日	58,611,603,439		10,953	
4月末日	58,645,037,938		10,887	

5月末日	58,167,580,703		10,856	
6月末日	57,935,098,090		10,801	
7月末日	57,860,393,439		10,845	
8月末日	56,371,605,135		10,764	
9月末日	55,126,072,364		10,787	
10月末日	52,681,602,507		10,737	
11月末日	50,401,427,859		10,680	

## 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4期 (2018年 5月14日)	10,106,718,653	10,106,718,653	12,194	12,194
2017年11月末日	7,085,758,492		12,589	
12月末日	8,196,918,629		12,687	
2018年 1月末日	9,014,272,172		12,189	
2月末日	8,983,906,269		12,007	
3月末日	9,756,936,682		11,920	
4月末日	10,102,898,301		12,203	
5月末日	9,978,897,991		12,139	
6月末日	10,228,837,097		12,268	
7月末日	10,055,872,120		12,406	
8月末日	9,755,425,686		12,385	
9月末日	9,780,816,623		12,644	
10月末日	9,394,268,410		12,560	
11月末日	8,997,223,021		12,580	

## 【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4期	2017年 5月13日～2018年 5月14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4期	2017年 5月13日～2018年 5月14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4期	0.4
第5期(中間期)	1.4

(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4期	2.3
第5期(中間期)	3.9

(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4期	57,016,151,592	4,338,943,642
第5期(中間期)	2,381,603,740	7,999,227,150

(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4期	8,393,218,371	954,734,368
第5期(中間期)	1,011,710,334	1,980,891,673

(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5期中間計算期間(平成30年 5月15日から平成30年11月14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4期 (平成30年 5月14日現在)	第5期中間計算期間 (平成30年11月14日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	1,187,526,816
コール・ローン	1,438,077,762	-
投資信託受益証券	57,668,073,620	51,282,627,300
親投資信託受益証券	9,994	7,759,220
流動資産合計	59,106,161,376	52,477,913,336
資産合計	59,106,161,376	52,477,913,336
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	61,951,442	282,435,992
未払受託者報酬	9,016,659	9,221,036
未払委託者報酬	495,916,445	507,157,050
未払利息	2,363	-
その他未払費用	1,570,234	1,612,134
流動負債合計	568,457,143	800,426,212
負債合計	568,457,143	800,426,212
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	53,856,842,521	48,239,219,111
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,680,861,712	3,438,268,013
元本等合計	58,537,704,233	51,677,487,124
純資産合計	58,537,704,233	51,677,487,124
負債純資産合計	59,106,161,376	52,477,913,336

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第5期中間計算期間 自 平成30年 5月15日 至 平成30年11月14日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	497,513,561	1,444,263,251
有価証券売買等損益	178,529,800	1,739,324,098
営業収益合計	318,983,761	295,060,847
<b>営業費用</b>		
支払利息	182,892	190,223
受託者報酬	2,963,078	9,221,036
委託者報酬	162,968,922	507,157,050
その他費用	528,455	1,708,862
営業費用合計	166,643,347	518,277,171
営業利益又は営業損失（ ）	152,340,414	813,338,018
経常利益又は経常損失（ ）	152,340,414	813,338,018
中間純利益又は中間純損失（ ）	152,340,414	813,338,018
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（ ）	1,547,963	71,043,886
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	107,130,423	4,680,861,712
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,965,223,691	193,729,668
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	3,965,223,691	193,729,668
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,163,017	694,029,235
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,163,017	694,029,235
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（ ）	4,191,983,548	3,438,268,013



## （ 3 ）【中間注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第5期中間計算期間	
	自 平成30年 5月15日	至 平成30年11月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成30年 5月15日から平成30年11月14日までとなっております。</p>	

## （ 中間貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第4期		第5期中間計算期間	
	（平成30年 5月14日現在）		（平成30年11月14日現在）	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	53,856,842,521口		48,239,219,111口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0869円	1口当たり純資産額	1.0713円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,869円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,713円)

## （ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

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	第5期中間計算期間 自 平成30年 5月15日 至 平成30年11月14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 59,999,951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 184,298,871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5期中間計算期間 (平成30年11月14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4期 (平成30年 5月14日現在)	第5期中間計算期間 (平成30年11月14日現在)
期首元本額	1,179,634,571円	53,856,842,521円
期中追加設定元本額	57,016,151,592円	2,381,603,740円
期中一部解約元本額	4,338,943,642円	7,999,227,150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4期 (平成30年5月14日現在)	第5期中間計算期間 (平成30年11月14日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	201,765,454
コール・ローン	236,970,294	-
投資信託受益証券	9,959,778,970	9,189,500,450
親投資信託受益証券	9,994	1,339,860
流動資産合計	10,196,759,258	9,392,605,764
資産合計	10,196,759,258	9,392,605,764
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,403,639	28,343,548
未払受託者報酬	1,417,668	1,619,534
未払委託者報酬	77,971,643	89,074,705
未払利息	389	-
その他未払費用	247,266	284,620
流動負債合計	90,040,605	119,322,407
負債合計	90,040,605	119,322,407
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,288,368,127	7,319,186,788
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,818,350,526	1,954,096,569
元本等合計	10,106,718,653	9,273,283,357
純資産合計	10,106,718,653	9,273,283,357
負債純資産合計	10,196,759,258	9,392,605,764

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第5期中間計算期間 自 平成30年 5月15日 至 平成30年11月14日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	105,119,282	357,232,523
有価証券売買等損益	80,661,702	113,669,874
営業収益合計	185,780,984	470,902,397
<b>営業費用</b>		
支払利息	17,801	34,826
受託者報酬	513,951	1,619,534
委託者報酬	28,267,469	89,074,705
その他費用	89,914	305,122
営業費用合計	28,889,135	91,034,187
営業利益又は営業損失（ ）	156,891,849	379,868,210
経常利益又は経常損失（ ）	156,891,849	379,868,210
中間純利益又は中間純損失（ ）	156,891,849	379,868,210
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（ ）	1,610,525	49,955,607
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	210,801,303	1,818,350,526
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,058,120,536	242,607,431
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	1,058,120,536	242,607,431
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,349,631	436,773,991
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	46,349,631	436,773,991
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（ ）	1,377,853,532	1,954,096,569

## （ 3 ）【中間注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第5期中間計算期間	
	自 平成30年 5月15日	至 平成30年11月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成30年 5月15日から平成30年11月14日までとなっております。</p>	

## （ 中間貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第4期		第5期中間計算期間	
	（平成30年 5月14日現在）		（平成30年11月14日現在）	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	8,288,368,127口		7,319,186,788口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2194円	1口当たり純資産額	1.2670円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,194円)	(10,000口当たりの純資産額)	12,670円)

## （ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第4期中間計算期間	第5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	自平成30年5月15日 至平成30年11月14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 10,371,148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 32,375,926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5期中間計算期間
	(平成30年11月14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4期	第5期中間計算期間
	(平成30年5月14日現在)	(平成30年11月14日現在)
期首元本額	849,884,124円	8,288,368,127円
期中追加設定元本額	8,393,218,371円	1,011,710,334円
期中一部解約元本額	954,734,368円	1,980,891,673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・

バミューダ・インカムファンドA クラスJ(JPY)」および「マネー・マーケット・マザーファンド」を、三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)は、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)」および「マネー・マーケット・マザーファンド」をそれぞれ主要投資対象としており、各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(2017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	363,808
関連ファンドに対する投資	7,757,222
金融デリバティブ商品	
OTC取引	9,266
現金	160
カウンターパーティー預け金	27,758
投資有価証券売却による未収入金	64
関連ファンド売却による未収入金	30
ファンド持分追加設定による未収入金	206,219
未収利息および未収配当金	7
	8,364,534

##### 負債：

金融デリバティブ商品	
OTC取引	66,780
関連ファンド購入による未払金	183,007
未払利息	6
ファンド持分一部解約による未払金	22,451
未払管理手数料	27
未払顧問費用	26
未払管理事務代行費	10
未払販売手数料	24
	272,331

##### 純資産

8,092,203

##### 投資有価証券(原価)

363,807

##### 関連ファンドに対する投資(原価)

7,491,408

##### 純資産：

Jクラス(円)	657,012
---------	---------

Jクラス(米ドル)

発行済口数:

Jクラス(円) 7,506

Jクラス(米ドル) 1,359

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) 87.53

(NAV報告通貨建て:円) 9,946

Jクラス(米ドル)

(機能通貨建て:米ドル) 99.15

(NAV報告通貨建て:円) 11,267

## 投資明細表(2017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				
4.5%	4.5%	4.2%	0.680% 期日 11/01/2017	USD	397	USD	397
			Bank of Nova Scotia				
			0.680% 期日 11/01/2017		34,117		34,117
			Brown Brothers Harriman & Co.				
			0.680% 期日 11/01/2017		69		69
			Citibank N.A.				
			0.680% 期日 11/01/2017		42,223		42,223
			DBS Bank Ltd.				
			0.680% 期日 11/01/2017		49,984		49,984
			Deutsche Bank AG				
			0.680% 期日 11/01/2017		31,371		31,371
			DnB NORBank ASA				
			0.680% 期日 11/01/2017		11,513		11,513
			JPMorgan Chase & Co.				
			0.680% 期日 11/01/2017		84,992		84,992
			Wells Fargo Bank				
			0.680% 期日 11/01/2017		85,255		85,255
							339,921
		米国短期国債	1.008% 期日 11/30/2017		9,200		9,193
		0.3%	1.033% 期日 11/16/2017		14,700		14,694
							23,887
							363,808
			短期証券合計				363,808
			(原価: 363,807米ドル)				
			投資有価証券合計				363,808
			(原価: 363,807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)				
95.9%	95.9%		(原価: 7,491,408米ドル)		611,286		7,757,222
			関連ファンドに対する投資合計				7,757,222
			(原価: 7,491,408米ドル)				
			投資合計 100.4%			USD	8,121,030
			(原価: 7,855,215米ドル)				
			金融デリバティブ商品(0.7%)				(57,514)
			(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)0.3%				28,687
			純資産 100.0%			USD	8,092,203



## 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(2017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\*

8,602,680

## 金融デリバティブ商品

市場取引又は中央清算機関決済

5,352

OTC取引

43,962

## 現金

1,437

カウンターパーティー預け金

42,522

外国通貨(時価)

3,339

投資有価証券売却による未収入金

24,470

TBA売却による未収入金

392,837

ファンド持分追加設定による未収入金

186,783

未収利息および未収配当金

31,528

---

9,334,910

---

## 負債：

## 金融デリバティブ商品

市場取引又は中央清算機関決済

1,163

OTC取引

53,409

投資有価証券購入による未払金

338,651

TBA購入による未払金

706,341

未払利息

9

カウンターパーティー預り金

18,290

ファンド持分一部解約による未払金

138

---

1,118,001

---

## 純資産

---

8,216,909

---

投資有価証券(原価)

---

8,447,486

---

外国通貨(原価)

---

3,353

---

金融デリバティブ商品による収益又は費用(純額)

---

(28,196)

---

\*レポ取引を含む：

---

227,400

---

## 投資明細表(2017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	1011778 B.C. Unlimited Liability Company				
	証券					
104.7%	3.6%	3.492% 期日 02/16/2024	USD	832	USD	833
		3.583% 期日 02/16/2024		532		533
		Accudyne Industries Borrower S.C.A.				
		5.083% 期日 08/02/2024		600		605
		Air Medical Group Holdings, Inc.				
		5.567% 期日 09/07/2024		1,200		1,202
		Albany Molecular Research, Inc.				
		4.583% 期日 08/30/2024		100		101

Alpha 3 BV			
4.333% 期日 01/31/2024	100		100
Alphabet Holding Co., Inc.			
4.833% 期日 09/26/2024	500		490
Altice Financing S.A.			
4.086% 期日 01/05/2026	700		701
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.			
3.742% 期日 10/31/2023	1,696		1,708
AmWINS Group, Inc.			
3.985% 期日 01/25/2024	64		64
3.992% 期日 01/25/2024	158		158
Ancestry.com Operations, Inc.			
4.490% 期日 10/19/2023	792		800
Avantor Performance Materials Holdings, Inc.			
5.312% 期日 09/07/2024	1,700		1,706
6.750% 期日 06/30/2018	23,700		23,869
Avolon Holdings Ltd.			
3.488% 期日 09/20/2020	352		354
3.488% 期日 04/03/2022	11,147		11,238
AWAS Leasing 2011- Ltd.			
4.299% 期日 10/02/2021	790		810
Beacon Roofing Supply, Inc.			
3.567% 期日 08/23/2024	490		493
BMC Software Finance, Inc.			
5.242% 期日 09/10/2022	216		218
BWay Holdings Co.			
4.522% 期日 04/03/2024	1		1
4.599% 期日 04/03/2024	388		390
Caesars Entertainment Operating Co. LLC			
3.742% 期日 10/06/2024	2,000		2,004
3.863% 期日 10/06/2024	300		301
Caesars Resort Collection LLC			
4.075% 期日 09/27/2024	5,000		5,027
Camelot U.S. Acquisition 1 Co.			
4.742% 期日 10/03/2023	198		200
Castlelake Aircraft Structured Trust			
3.967% 期日 09/15/2024	3,721		3,725
Centene Corp.			
4.500% 期日 09/13/2018	26,400		26,400
CenturyLink, Inc.			
2.750% 期日 01/31/2025	8,000		7,904
Charter Communications Operating LLC			
3.250% 期日 07/01/2020	658		662
3.250% 期日 01/03/2021	506		509
3.500% 期日 01/15/2024	1,296		1,307
Cheniere Energy Partners LP			
3.471% 期日 02/25/2020	1,350		1,350
CityCenter Holdings LLC			
3.742% 期日 04/18/2024	299		301
Cypress Intermediate Holdings , Inc.			
4.250% 期日 04/27/2024	100		100
DaVita, Inc.			
3.992% 期日 06/24/2021	194		195
Dell International LLC			
3.250% 期日 09/07/2023	2,523		2,532
Diamond BV			

3.250% 期日 09/06/2024	EUR	500	583
4.316% 期日 09/06/2024	USD	300	301
Diamond Resorts International, Inc.			
7.242% 期日 08/11/2023		2,077	2,093
Diaverum Holding S.a.r.l			
3.250% 期日 05/31/2024	EUR	1,300	1,516
Endo Luxembourg Finance Co. I S.a r.l.			
5.500% 期日 04/29/2024	USD	2,266	2,299
Energy Future Intermediate Holding Co. LLC			
4.239% 期日 06/30/2018		2,550	2,568
4.242% 期日 06/30/2018		68,855	69,329
FCA US LLC			
3.240% 期日 12/31/2018		758	762
FinCo LLC			
2.750% 期日 06/14/2022		1,300	1,319
First Data Corp.			
3.488% 期日 07/08/2022		3,000	3,012
Gartner, Inc.			
3.242% 期日 04/05/2024		128	129
Golden Entertainment, Inc.			
4.240% 期日 10/20/2024		700	700
H.B. Fuller Co.			
3.489% 期日 10/12/2024		1,100	1,108
HCA, Inc.			
3.242% 期日 03/17/2023		997	1,003
3.492% 期日 02/15/2024		3,002	3,025
HD Supply, Inc.			
3.833% 期日 10/17/2023		199	201
HD Supply Waterworks Ltd.			
4.455% 期日 08/01/2024		320	323
Hilton Worldwide Finance LLC			
3.238% 期日 10/25/2023		13,505	13,601
iHeartCommunications, Inc.			
8.083% 期日 01/30/2019		18,608	13,991
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
4.071% 期日 06/30/2019		3,800	3,796
KFC Holding Co.			
3.237% 期日 06/16/2023		1,089	1,096
Kinetic Concepts, Inc.			
4.583% 期日 02/02/2024		1,896	1,897
Klockner Pentaplast of America, Inc.			
4.750% 期日 06/30/2022	EUR	300	351
Las Vegas Sands LLC			
3.242% 期日 03/29/2024	USD	2,593	2,610
Mcafee LLC			
5.833% 期日 09/30/2024		1,200	1,209
MGM Growth Properties Operating Partnership LP			
3.492% 期日 04/25/2023		611	615
MH Sub LLC			
5.070% 期日 09/13/2024		1,010	1,007
8.820% 期日 08/15/2025		500	498
Mission Broadcasting, Inc.			
3.735% 期日 01/17/2024		59	59
Misys Ltd.			
4.817% 期日 06/13/2024		200	200
Multi-Color Corp.			

2.250% 期日 09/20/2024		175	176
Nexstar Broadcasting, Inc.			
3.735% 期日 01/17/2024		468	471
Nidda Healthcare Holding AG			
3.500% 期日 09/22/2024	EUR	168	197
3.750% 期日 09/19/2024		832	976
Nielsen Finance LLC			
3.238% 期日 10/04/2023	USD	398	400
Oxea Holding Vier GMBH			
3.750% 期日 10/11/2024	EUR	2,000	2,338
Pacific Investment Management Co. LLC			
3.597% 期日 02/19/2020	USD	1,700	1,670
Parexel International Corp.			
4.280% 期日 09/27/2024		400	404
Petrobras Netherlands BV			
3.257% 期日 06/14/2019		500	488
Post Holdings, Inc.			
3.492% 期日 05/24/2024		1,406	1,414
Prestige Brands, Inc.			
3.992% 期日 01/26/2024		89	90
Quintiles IMS, Inc.			
3.317% 期日 01/31/2025		10,200	10,274
Refresco Holding BV			
3.000% 期日 09/26/2024	EUR	2,600	3,052
Reynolds Group Holdings, Inc.			
3.992% 期日 02/05/2023	USD	198	199
RPI Finance Trust			
3.333% 期日 03/27/2023		7,253	7,289
Sequa Mezzanine Holdings LLC			
6.807% 期日 11/28/2021		4	4
6.874% 期日 11/28/2021		1,741	1,760
10.374% 期日 04/28/2022		650	664
Serta Simmons Bedding LLC			
4.812% 期日 11/08/2023		43	43
4.835% 期日 11/08/2023		155	154
SFR Group S.A.			
4.336% 期日 01/05/2026		1,400	1,403
Sprint Communications, Inc.			
3.750% 期日 02/02/2024		4,184	4,202
Team Health Holdings, Inc.			
3.992% 期日 02/06/2024		361	358
Transdigm, Inc.			
4.242% 期日 06/09/2023		1,099	1,105
4.333% 期日 06/09/2023		592	595
Traverse Midstream Partners LLC			
5.330% 期日 09/27/2024		454	461
Tronox Finance LLC			
4.323% 期日 09/22/2024		450	453
Unitymedia Finance LLC			
3.604% 期日 10/16/2024		1,000	999
Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG			
2.750% 期日 10/16/2024	EUR	2,900	3,394
Univision Communications, Inc.			
3.992% 期日 03/15/2024	USD	11,921	11,879
UPC Financing Partnership			
2.750% 期日 10/15/2026	EUR	1,000	1,170
3.732% 期日 01/15/2026	USD	1,500	1,507

Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	5.990% 期日 04/01/2022		695	710
Vertiv Group Corp.	5.242% 期日 11/30/2023		301	302
	7.250% 期日 11/30/2023		86	87
VFH Parent LLC	5.061% 期日 12/30/2021		165	167
VICI Properties 1 LLC	4.850% 期日 10/14/2022		3,800	3,808
Virgin Media Bristol LLC	3.989% 期日 01/31/2025		1,400	1,407
Vistra Operations Co. LLC	3.987% 期日 12/14/2023		225	227
	3.992% 期日 08/04/2023		341	342
	4.084% 期日 08/04/2023		188	188
	4.084% 期日 12/14/2023		73	73
West Corp.	5.242% 期日 10/10/2024		1,609	1,611
Wilsonart LLC	4.590% 期日 12/19/2023		199	200
銀行貸付債権証券合計				298,803
(原価：300,666米ドル)				

社債券等	銀行および金	ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance			
	融	PLC			
20.0%	11.0%	2.626% 期日 04/28/2020	EUR	3,028	3,576
		AerCap Ireland Capital DAC			
		3.750% 期日 05/15/2019	USD	1,850	1,893
		4.250% 期日 07/01/2020		1,405	1,471
		4.500% 期日 05/15/2021		800	850
		4.625% 期日 10/30/2020		3,150	3,348
		AGFC Capital Trust			
		3.109% 期日 01/15/2067		2,200	1,331
		Akelius Residential Property AB			
		3.375% 期日 09/23/2020	EUR	1,000	1,270
		Alliance Data Systems Corp.			
		4.500% 期日 03/15/2022		173	211
		Ally Financial, Inc.			
		3.250% 期日 02/13/2018	USD	630	632
		3.250% 期日 11/05/2018		850	859
		3.500% 期日 01/27/2019		737	748
		3.600% 期日 05/21/2018		6,600	6,650
		4.750% 期日 09/10/2018		2,450	2,505
		6.250% 期日 12/01/2017		6,248	6,268
		8.000% 期日 11/01/2031		2,740	3,637
		Altarea S.C.A.			
		2.250% 期日 07/05/2024	EUR	1,100	1,297
		Annington Funding PLC			
		1.650% 期日 07/12/2024		1,600	1,911
		2.646% 期日 07/12/2025	GBP	2,200	2,951
		3.184% 期日 07/12/2029		500	674
		3.935% 期日 07/12/2047		400	568
		Ardonagh Midco 3 PLC			
		8.375% 期日 07/15/2023		1,700	2,348
		Army Hawaii Family Housing Trust			
		Certificates			
		1.639% 期日 06/15/2050	USD	5,200	3,677

Aroundtown S.A.			
3.000% 期日 10/16/2029	GBP	1,700	2,209
ATF Netherlands BV			
1.875% 期日 01/19/2026	EUR	500	598
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6.750% 期日 02/18/2020		2,200	2,776
7.000% 期日 02/19/2019		1,600	1,972
9.000% 期日 05/09/2018	USD	2,400	2,484
Banco Espirito Santo S.A.			
2.625% 期日 05/08/2017	EUR	3,100	1,065
Banco Santander S.A.			
6.250% 期日 09/11/2021		1,500	1,913
Banistmo S.A.			
3.650% 期日 09/19/2022	USD	400	401
Bank of America Corp.			
3.875% 期日 08/01/2025		300	315
Barclays Bank PLC			
7.625% 期日 11/21/2022		6,740	7,756
7.750% 期日 04/10/2023		5,600	5,733
14.000% 期日 06/15/2019	GBP	9,970	15,606
Barclays PLC			
2.375% 期日 10/06/2023		1,700	2,273
2.975% 期日 01/10/2023	USD	1,000	1,027
3.125% 期日 01/17/2024	GBP	1,700	2,348
3.250% 期日 02/12/2027		10,400	14,331
3.684% 期日 01/10/2023	USD	500	510
4.337% 期日 01/10/2028		700	727
4.375% 期日 01/12/2026		2,900	3,044
5.875% 期日 09/15/2024	GBP	6,400	8,626
6.500% 期日 09/15/2019	EUR	4,400	5,523
7.000% 期日 09/15/2019	GBP	200	281
7.250% 期日 03/15/2023		12,000	17,485
7.875% 期日 03/15/2022	USD	1,200	1,341
7.875% 期日 09/15/2022	GBP	5,353	7,918
8.000% 期日 12/15/2020	EUR	600	812
8.250% 期日 12/15/2018	USD	900	958
BGC Partners, Inc.			
5.125% 期日 05/27/2021		400	425
5.375% 期日 12/09/2019		1,450	1,525
Blackstone CQP Holdco LP			
6.000% 期日 08/18/2021		1,300	1,302
6.500% 期日 03/20/2021		7,400	7,494
BNP Paribas S.A.			
7.625% 期日 03/30/2021		600	674
BOC Aviation Ltd.			
2.375% 期日 09/15/2021		570	560
BPCE S.A.			
12.500% 期日 09/30/2019		700	827
BRFkredit A/S			
1.000% 期日 01/01/2018	DKK	24,600	3,865
1.000% 期日 04/01/2018		180,500	28,434
4.000% 期日 01/01/2018		30,100	4,747
Brighthouse Financial, Inc.			
3.700% 期日 06/22/2027	USD	2,400	2,366
4.700% 期日 06/22/2047		682	678
Brixmor Operating Partnership LP			
3.250% 期日 09/15/2023		300	296

Brookfield Finance, Inc.			
4.700% 期日 09/20/2047		2,334	2,395
CBL & Associates LP			
5.950% 期日 12/15/2026		1,130	1,129
CIT Group, Inc.			
3.875% 期日 02/19/2019		5,342	5,435
5.000% 期日 08/01/2023		2,300	2,494
5.375% 期日 05/15/2020		400	430
5.500% 期日 02/15/2019		168	176
Cooperatieve Rabobank UA			
6.625% 期日 06/29/2021	EUR	1,800	2,441
Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.			
6.875% 期日 07/08/2020	GBP	2,230	3,305
7.500% 期日 07/08/2026		600	983
CPI Property Group S.A.			
2.125% 期日 10/04/2024	EUR	2,100	2,495
Credit Agricole S.A.			
7.500% 期日 06/23/2026	GBP	1,100	1,726
7.875% 期日 01/23/2024	USD	696	794
Credit Suisse AG			
6.500% 期日 08/08/2023		3,985	4,523
Credit Suisse Group AG			
2.519% 期日 12/14/2023		5,000	5,053
2.997% 期日 12/14/2023		3,600	3,595
4.282% 期日 01/09/2028		6,700	6,993
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.			
2.750% 期日 08/08/2025	GBP	600	819
3.750% 期日 03/26/2025	USD	1,800	1,852
Crown Castle International Corp.			
3.200% 期日 09/01/2024		604	601
3.650% 期日 09/01/2027		2,678	2,678
4.000% 期日 03/01/2027		255	262
CTR Partnership LP			
5.250% 期日 06/01/2025		504	519
Deutsche Bank AG			
2.329% 期日 07/13/2020		1,536	1,543
2.700% 期日 07/13/2020		1,552	1,558
3.219% 期日 05/10/2019		80	82
4.250% 期日 10/14/2021		15,720	16,460
Digital Euro Finco LLC			
2.625% 期日 04/15/2024	EUR	1,400	1,769
Digital Realty Trust LP			
2.750% 期日 02/01/2023	USD	142	142
3.700% 期日 08/15/2027		390	396
Digital Stout Holding LLC			
2.750% 期日 07/19/2024	GBP	400	540
3.300% 期日 07/19/2029		400	542
Emerald Bay S.A.			
0.000% 期日 10/08/2020	EUR	3,425	3,726
Equinix, Inc.			
2.875% 期日 10/01/2025		700	838
ERP Operating LP			
3.250% 期日 08/01/2027	USD	257	258
4.000% 期日 08/01/2047		153	153
Fastighets AB Balder			
1.125% 期日 03/14/2022	EUR	1,000	1,187
1.875% 期日 03/14/2025		1,100	1,319

1.875% 期日 01/23/2026		1,470	1,739
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2.875% 期日 06/20/2022		1,400	1,674
goeasy Ltd.			
7.875% 期日 11/01/2022	USD	594	613
Goodman Australia Finance Pty Ltd.			
1.375% 期日 09/27/2025	EUR	800	942
Goodman U.S. Finance Four LLC			
4.500% 期日 10/15/2037	USD	908	928
Goodman U.S. Finance Three LLC			
3.700% 期日 03/15/2028		1,724	1,721
Host Hotels & Resorts LP			
4.000% 期日 06/15/2025		200	205
Howard Hughes Corp.			
5.375% 期日 03/15/2025		3,085	3,178
HSBC Holdings PLC			
2.625% 期日 08/16/2028	GBP	360	484
3.262% 期日 03/13/2023	USD	800	818
4.041% 期日 03/13/2028		700	734
4.300% 期日 03/08/2026		500	537
4.750% 期日 07/04/2029	EUR	2,800	3,541
6.000% 期日 09/29/2023		7,210	9,935
Hudson Pacific Properties LP			
3.950% 期日 11/01/2027	USD	363	364
International Lease Finance Corp.			
3.875% 期日 04/15/2018		600	606
8.250% 期日 12/15/2020		7,590	8,858
Intesa Sanpaolo SpA			
7.750% 期日 01/11/2027	EUR	8,680	12,305
iStar, Inc.			
4.625% 期日 09/15/2020	USD	137	140
5.250% 期日 09/15/2022		515	529
Jefferies Finance LLC			
6.875% 期日 04/15/2022		1,000	1,015
7.250% 期日 08/15/2024		800	819
7.375% 期日 04/01/2020		2,875	2,979
7.500% 期日 04/15/2021		630	660
Jefferies LoanCore LLC			
6.875% 期日 06/01/2020		1,700	1,761
KBC Bank NV			
8.000% 期日 01/25/2023		2,200	2,233
Kennedy Wilson Europe Real Estate PLC			
3.950% 期日 06/30/2022	GBP	500	697
Kojamo OYJ			
1.500% 期日 06/19/2024	EUR	1,200	1,421
Lifestorage LP			
3.500% 期日 07/01/2026	USD	1,200	1,161
Lincoln Finance Ltd.			
6.875% 期日 04/15/2021	EUR	7,435	9,170
Lloyds Bank PLC			
12.000% 期日 12/16/2024	USD	200	271
Lloyds Banking Group PLC			
2.250% 期日 10/16/2024	GBP	900	1,200
2.907% 期日 11/07/2028	USD	3,500	3,500
3.574% 期日 11/07/2028		5,600	5,600
7.000% 期日 06/27/2019	GBP	8,800	12,460
7.500% 期日 06/27/2024	USD	2,700	3,088



7.625% 期日 06/27/2023	GBP	7,511	11,384
7.875% 期日 06/27/2029		1,700	2,733
Merlin Properties Socimi S.A.			
1.750% 期日 05/26/2025	EUR	1,910	2,271
1.875% 期日 11/02/2026		900	1,057
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.			
2.652% 期日 09/19/2022	USD	2,100	2,078
Mizuho Financial Group, Inc.			
2.197% 期日 09/11/2022		10,200	10,241
2.601% 期日 09/11/2022		4,700	4,664
National Australia Bank Ltd.			
1.375% 期日 07/12/2019		600	595
Navient Corp.			
4.875% 期日 06/17/2019		1,500	1,547
5.000% 期日 10/26/2020		3,070	3,170
5.500% 期日 01/15/2019		8,304	8,584
5.625% 期日 08/01/2033		4,640	4,025
5.875% 期日 03/25/2021		383	404
6.500% 期日 06/15/2022		1,926	2,046
7.250% 期日 01/25/2022		5,490	5,977
8.000% 期日 03/25/2020		9,405	10,393
8.450% 期日 06/15/2018		600	624
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
2.000% 期日 04/01/2018	DKK	67,500	10,679
2.000% 期日 10/01/2047		2,849	447
Nykredit Realkredit A/S			
1.000% 期日 01/01/2018		41,700	6,541
1.000% 期日 04/01/2018		329,700	51,910
1.000% 期日 07/01/2018		24,100	3,809
2.000% 期日 01/01/2018		64,400	10,123
2.000% 期日 04/01/2018		23,100	3,654
2.500% 期日 10/01/2047		12,380	2,012
OneMain Financial Holdings LLC			
6.750% 期日 12/15/2019	USD	4,340	4,508
7.250% 期日 12/15/2021		3,320	3,457
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust			
3.125% 期日 03/20/2022		696	708
3.875% 期日 03/20/2027		472	484
Oppenheimer Holdings, Inc.			
6.750% 期日 07/01/2022		320	327
Preferred Term Securities X Ltd.			
1.700% 期日 09/23/2035		652	583
Preferred Term Securities XX Ltd.			
1.620% 期日 03/22/2037		1,369	1,184
1.700% 期日 03/22/2037		5,019	3,538
Preferred Term Securities XX Ltd.			
1.610% 期日 06/22/2037		31,070	26,410
Preferred Term Securities XX Ltd.			
1.620% 期日 09/22/2037		51,843	44,845
Prologis LP			
2.250% 期日 06/30/2029	GBP	200	256
Provident Funding Associates LP			
6.375% 期日 06/15/2025	USD	206	218
QNB Finance Ltd.			
1.796% 期日 06/06/2018		400	400
Realkredit Danmark A/S			

1.000% 期日 01/01/2018	DKK	78,500	12,317
1.000% 期日 04/01/2018		188,030	29,621
2.000% 期日 01/01/2018		105,300	16,546
2.000% 期日 04/01/2018		110,500	17,476
2.500% 期日 07/01/2047		10,823	1,759
3.000% 期日 07/01/2046		6,103	1,015
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1			
9.250% 期日 07/06/2024	USD	1,361	1,479
Royal Bank of Scotland Group PLC			
2.000% 期日 03/08/2023	EUR	1,900	2,326
2.500% 期日 03/22/2023		6,700	8,428
2.785% 期日 05/15/2023	USD	3,074	3,103
3.498% 期日 05/15/2023		2,214	2,234
3.875% 期日 09/12/2023		5,500	5,648
4.800% 期日 04/05/2026		2,300	2,481
7.500% 期日 08/10/2020		1,700	1,826
8.000% 期日 08/10/2025		1,400	1,604
8.625% 期日 08/15/2021		2,200	2,497
Royal Bank of Scotland PLC			
6.934% 期日 04/09/2018	EUR	6,180	7,413
Santander Holdings USA, Inc.			
3.700% 期日 03/28/2022	USD	366	375
4.400% 期日 07/13/2027		926	953
4.500% 期日 07/17/2025		3,000	3,133
Santander UK Group Holdings PLC			
2.875% 期日 08/05/2021		1,800	1,811
3.625% 期日 01/14/2026	GBP	1,900	2,725
6.750% 期日 06/24/2024		6,690	9,764
7.375% 期日 06/24/2022		1,900	2,766
SBA Communications Corp.			
4.000% 期日 10/01/2022	USD	722	736
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
3.352% 期日 11/15/2019	EUR	5,600	6,863
5.180% 期日 06/28/2019	USD	1,400	1,455
5.717% 期日 06/16/2021		900	976
6.125% 期日 02/07/2022		10,400	11,398
SL Green Operating Partnership LP			
3.250% 期日 10/15/2022		234	235
SL Green Realty Corp.			
4.500% 期日 12/01/2022		970	1,028
7.750% 期日 03/15/2020		500	557
Societe Generale S.A.			
8.250% 期日 11/29/2018		600	636
Society of Lloyd's			
4.750% 期日 10/30/2024	GBP	400	593
Springleaf Finance Corp.			
5.250% 期日 12/15/2019	USD	1,850	1,915
6.000% 期日 06/01/2020		300	316
6.125% 期日 05/15/2022		8,583	9,077
6.900% 期日 12/15/2017		200	201
8.250% 期日 12/15/2020		16,479	18,621
State Bank of India			
2.297% 期日 04/06/2020		8,000	8,022
Stearns Holdings LLC			
9.375% 期日 08/15/2020		1,580	1,651
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
1.764% 期日 09/19/2019		3,040	3,043

	1.950% 期日 09/19/2019		2,490	2,480
	Tesco Property Finance 2 PLC			
	6.052% 期日 10/13/2039	GBP	3,596	5,773
	Tesco Property Finance 3 PLC			
	5.744% 期日 04/13/2040		167	264
	Tesco Property Finance 4 PLC			
	5.801% 期日 10/13/2040		403	642
	Tesco Property Finance 6 PLC			
	5.411% 期日 07/13/2044		2,363	3,631
	UBS AG			
	4.750% 期日 05/22/2023	USD	1,800	1,828
	5.125% 期日 05/15/2024		900	961
	7.625% 期日 08/17/2022		6,800	7,095
	UBS Group AG			
	5.750% 期日 02/19/2022	EUR	3,200	4,344
	7.000% 期日 02/19/2025	USD	200	230
	UBS Group Funding Switzerland AG			
	3.491% 期日 05/23/2023		2,000	2,052
	4.125% 期日 09/24/2025		2,470	2,608
	4.125% 期日 04/15/2026		2,500	2,640
	4.253% 期日 03/23/2028		2,200	2,323
	Ventas Realty LP			
	3.250% 期日 10/15/2026		100	98
	VEREIT Operating Partnership LP			
	3.950% 期日 08/15/2027		380	380
	VICI Properties 1 LLC			
	4.847% 期日 10/15/2022		987	996
	8.000% 期日 10/15/2023		3,591	4,013
	Washington Prime Group LP			
	5.950% 期日 08/15/2024		4,771	4,907
	Wells Fargo & Co.			
	2.125% 期日 12/20/2023	GBP	2,100	2,831
	2.239% 期日 02/11/2022	USD	6,670	6,743
	2.500% 期日 03/04/2021		300	301
	2.656% 期日 03/04/2021		100	103
	3.000% 期日 10/23/2026		2,810	2,757
	Westfield America Management Ltd.			
	2.125% 期日 03/30/2025	GBP	400	518
				906,024
産業	AA Bond Co. Ltd.			
6.0%	2.750% 期日 07/31/2023		400	529
	2.875% 期日 01/31/2022		200	269
	Adecoagro S.A.			
	6.000% 期日 09/21/2027	USD	600	606
	Allegion U.S. Holding Co., Inc.			
	3.200% 期日 10/01/2024		463	465
	3.550% 期日 10/01/2027		563	563
	Allergan Funding SCS			
	0.020% 期日 06/01/2019	EUR	144	168
	Altice Financing S.A.			
	7.500% 期日 05/15/2026	USD	1,000	1,099
	Altice Luxembourg S.A.			
	7.250% 期日 05/15/2022	EUR	28,087	34,929
	7.750% 期日 05/15/2022	USD	13,650	14,469
	American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust			
	3.350% 期日 10/15/2029		480	484

American Honda Finance Corp.			
1.669% 期日 11/05/2021		5,700	5,717
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.			
4.900% 期日 02/01/2046		553	624
Anheuser-Busch InBev S.A.			
1.750% 期日 03/07/2025	GBP	635	829
2.250% 期日 05/24/2029		755	974
2.850% 期日 05/25/2037		687	896
AP Moller - Maersk A/S			
2.875% 期日 09/28/2020	USD	200	202
Arrow Electronics, Inc.			
3.250% 期日 09/08/2024		479	477
Avantor, Inc.			
6.000% 期日 10/01/2024		1,396	1,426
BAT Capital Corp.			
1.905% 期日 08/14/2020		2,044	2,056
2.195% 期日 08/15/2022		822	830
3.222% 期日 08/15/2024		3,278	3,305
Beacon Escrow Corp.			
4.875% 期日 11/01/2025		368	374
BMC Software Finance, Inc.			
8.125% 期日 07/15/2021		18,615	19,150
Boston Scientific Corp.			
3.375% 期日 05/15/2022		2,260	2,324
Boxer Parent Co., Inc.			
9.000% 期日 10/15/2019		26,119	26,201
Broadcom Corp.			
3.000% 期日 01/15/2022		2,026	2,056
3.625% 期日 01/15/2024		133	138
3.875% 期日 01/15/2027		700	722
Caesars Growth Properties Holdings LLC			
9.375% 期日 05/01/2022		1,770	1,908
Catalent Pharma Solutions, Inc.			
4.875% 期日 01/15/2026		570	580
Central Nippon Expressway Co. Ltd.			
1.853% 期日 08/04/2020		7,800	7,829
Charter Communications Operating LLC			
3.579% 期日 07/23/2020		318	327
4.200% 期日 03/15/2028		1,393	1,382
4.464% 期日 07/23/2022		661	699
4.908% 期日 07/23/2025		992	1,057
5.375% 期日 05/01/2047		177	180
6.384% 期日 10/23/2035		320	370
6.484% 期日 10/23/2045		300	345
Cheniere Energy Partners LP			
5.250% 期日 10/01/2025		1,710	1,766
Chesapeake Energy Corp.			
4.609% 期日 04/15/2019		189	188
Chester Downs & Marina LLC			
9.250% 期日 02/01/2020		1,750	1,794
Cimarex Energy Co.			
3.900% 期日 05/15/2027		261	269
CMA CGM S.A.			
5.250% 期日 01/15/2025	EUR	500	597
CNPC General Capital Ltd.			
2.212% 期日 11/25/2017	USD	1,500	1,500
CommScope Technologies LLC			

5.000% 期日 03/15/2027		12	12
Community Health Systems, Inc.			
6.250% 期日 03/31/2023		1,678	1,621
Conagra Brands, Inc.			
1.857% 期日 10/09/2020		180	180
CRC Escrow Issuer LLC			
5.250% 期日 10/15/2025		722	729
CSN Resources S.A.			
6.500% 期日 07/21/2020		100	93
CVS Pass-Through Trust			
7.507% 期日 01/10/2032		753	930
DAE Funding LLC			
4.000% 期日 08/01/2020		530	539
4.500% 期日 08/01/2022		720	732
5.000% 期日 08/01/2024		1,300	1,331
Dell International LLC			
4.420% 期日 06/15/2021		2,400	2,526
Delta Air Lines, Inc.			
2.875% 期日 03/13/2020		1,720	1,738
Diamond Resorts International, Inc.			
7.750% 期日 09/01/2023		3,899	4,230
Discovery Communications LLC			
2.036% 期日 09/20/2019		730	735
2.200% 期日 09/20/2019		231	231
2.500% 期日 09/20/2024	GBP	300	391
2.950% 期日 03/20/2023	USD	362	361
3.950% 期日 03/20/2028		476	473
DR Horton, Inc.			
4.000% 期日 02/15/2020		290	300
DXC Technology Co.			
2.266% 期日 03/01/2021		5,400	5,419
4.750% 期日 04/15/2027		379	408
Eastern Creation Investment Holdings Ltd.			
2.750% 期日 09/26/2020		800	805
eBay, Inc.			
2.248% 期日 01/30/2023		410	413
2.750% 期日 01/30/2023		1,574	1,576
EI Group PLC			
6.375% 期日 02/15/2022	GBP	5,600	8,032
6.500% 期日 12/06/2018		1,051	1,469
6.875% 期日 02/15/2021		50	74
EMC Corp.			
2.650% 期日 06/01/2020	USD	1,868	1,847
EQT Corp.			
2.106% 期日 10/01/2020		1,493	1,497
2.500% 期日 10/01/2020		259	259
4.875% 期日 11/15/2021		200	215
Eurofins Scientific SE			
2.125% 期日 07/25/2024	EUR	800	960
Exela Intermediate LLC			
10.000% 期日 07/15/2023	USD	880	847
Fidelity National Information Services, Inc.			
1.700% 期日 06/30/2022	GBP	200	265
First Quantum Minerals Ltd.			
7.000% 期日 02/15/2021	USD	200	208
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			

6.750% 期日 03/15/2022		2,100	2,210
Fresenius Medical Care US Finance , Inc.			
5.625% 期日 07/31/2019		374	395
Greene King Finance PLC			
5.106% 期日 03/15/2034	GBP	150	237
5.702% 期日 12/15/2034		4,156	5,198
Harland Clarke Holdings Corp.			
8.375% 期日 08/15/2022	USD	1,088	1,145
Harvest Operations Corp.			
2.330% 期日 04/14/2021		2,884	2,790
HCA, Inc.			
3.750% 期日 03/15/2019		1,045	1,063
5.500% 期日 06/15/2047		688	702
Heathrow Finance PLC			
3.875% 期日 03/01/2027	GBP	300	396
Hellenic Railways Organization S.A.			
5.014% 期日 12/27/2017	EUR	180	209
Hologic, Inc.			
4.375% 期日 10/15/2025	USD	296	301
Hyatt Hotels Corp.			
4.850% 期日 03/15/2026		100	109
iHeartCommunications, Inc.			
9.000% 期日 12/15/2019		9,760	7,247
9.000% 期日 03/01/2021		4,900	3,546
9.000% 期日 09/15/2022		1,476	1,074
10.625% 期日 03/15/2023		1,400	1,011
IHO Verwaltungs GmbH			
3.750% 期日 09/15/2026	EUR	100	125
Ingenico Group S.A.			
1.625% 期日 09/13/2024		1,700	2,005
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
7.250% 期日 10/15/2020	USD	42,049	40,670
9.750% 期日 07/15/2025		3,076	3,103
Intrepid Aviation Group Holdings LLC			
6.875% 期日 02/15/2019		3,156	3,132
Kinder Morgan, Inc.			
7.250% 期日 06/01/2018		200	206
7.750% 期日 01/15/2032		2,500	3,219
Komatsu Finance America, Inc.			
2.437% 期日 09/11/2022		400	397
Kraft Heinz Foods Co.			
3.000% 期日 06/01/2026		100	97
3.950% 期日 07/15/2025		155	161
4.375% 期日 06/01/2046		76	75
Martin Marietta Materials, Inc.			
1.965% 期日 05/22/2020		570	574
Melco Resorts Finance Ltd.			
4.875% 期日 06/06/2025		900	910
Miller Homes Group Holdings PLC			
5.500% 期日 10/15/2024	GBP	600	825
Molina Healthcare, Inc.			
4.875% 期日 06/15/2025	USD	130	129
Molnlycke Holding AB			
1.875% 期日 02/28/2025	EUR	1,130	1,374
Multi-Color Corp.			
4.875% 期日 11/01/2025	USD	315	319
NetApp, Inc.			

2.000%	期日 09/27/2019		283	282
3.300%	期日 09/29/2024		585	586
Netflix, Inc.				
3.625%	期日 05/15/2027	EUR	8,727	10,457
4.875%	期日 04/15/2028	USD	2,030	2,020
New Red Finance, Inc.				
4.250%	期日 05/15/2024		6,073	6,132
Nidda Healthcare Holding AG				
3.500%	期日 09/30/2024	EUR	800	956
Nielsen Co. Luxembourg Sarl				
5.000%	期日 02/01/2025	USD	83	86
Nissan Motor Acceptance Corp.				
1.721%	期日 09/28/2020		1,118	1,120
2.021%	期日 09/28/2022		2,500	2,505
2.150%	期日 09/28/2020		1,100	1,097
2.600%	期日 09/28/2022		2,500	2,493
Nokia OYJ				
4.375%	期日 06/12/2027		175	175
Norwegian Air Shuttle ASA 2016-1 Class A				
Pass-Through Trust				
4.875%	期日 05/10/2028		488	498
Ooredoo Tamweel Ltd.				
3.039%	期日 12/03/2018		200	202
Park Aerospace Holdings Ltd.				
3.625%	期日 03/15/2021		859	859
4.500%	期日 03/15/2023		2,063	2,071
5.250%	期日 08/15/2022		2,306	2,407
5.500%	期日 02/15/2024		2,000	2,080
Petroleos Mexicanos				
3.750%	期日 02/21/2024	EUR	2,100	2,619
4.875%	期日 01/24/2022	USD	1,930	2,014
5.125%	期日 03/15/2023	EUR	2,100	2,850
6.500%	期日 03/13/2027	USD	4,822	5,272
6.500%	期日 06/02/2041		1,410	1,431
6.750%	期日 09/21/2047		2,170	2,242
Petronas Capital Ltd.				
5.250%	期日 08/12/2019		2,800	2,950
PetSmart, Inc.				
5.875%	期日 06/01/2025		674	591
Phillips 66				
2.009%	期日 04/15/2019		1,000	1,001
2.109%	期日 04/15/2020		900	902
Pitney Bowes, Inc.				
3.625%	期日 09/15/2020		300	300
4.700%	期日 04/01/2023		634	620
Plastipak Holdings, Inc.				
6.250%	期日 10/15/2025		184	189
Priceline Group, Inc.				
2.750%	期日 03/15/2023		254	254
3.550%	期日 03/15/2028		730	737
QGOG Constellation S.A.				
9.500%	期日 11/09/2024		450	343
QUALCOMM, Inc.				
2.900%	期日 05/20/2024		290	291
Quintiles IMS, Inc.				
2.875%	期日 09/15/2025	EUR	400	474
3.250%	期日 03/15/2025		500	605

QVC, Inc.				
4.375% 期日 03/15/2023	USD	900	939	
4.450% 期日 02/15/2025		800	820	
4.850% 期日 04/01/2024		2,190	2,307	
5.125% 期日 07/02/2022		3,400	3,648	
5.450% 期日 08/15/2034		50	50	
5.950% 期日 03/15/2043		8,100	8,017	
RCI Banque S.A.				
1.875% 期日 11/08/2022	GBP	470	626	
3.500% 期日 04/03/2018	USD	1,824	1,836	
Russian Railways via RZD Capital PLC				
7.487% 期日 03/25/2031	GBP	6,300	10,416	
SBA Tower Trust				
2.877% 期日 07/09/2021	USD	1,500	1,496	
Scientific Games International, Inc.				
5.000% 期日 10/15/2025		313	318	
SFR Group S.A.				
5.625% 期日 05/15/2024	EUR	3,420	4,343	
6.250% 期日 05/15/2024	USD	5,000	5,256	
7.375% 期日 05/01/2026		10,583	11,416	
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC				
2.400% 期日 09/23/2021		3,750	3,728	
Simmons Foods, Inc.				
5.750% 期日 11/01/2024		504	507	
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
2.650% 期日 07/15/2021		400	395	
3.000% 期日 07/15/2022		300	300	
SoftBank Group Corp.				
3.125% 期日 09/19/2025	EUR	9,400	11,093	
4.000% 期日 09/19/2029		1,700	1,984	
4.750% 期日 09/19/2024	USD	6,800	6,786	
5.125% 期日 09/19/2027		6,000	5,978	
Spanish Broadcasting System, Inc.				
12.500% 期日 04/15/2017		852	882	
Spectra Energy Partners LP				
2.016% 期日 06/05/2020		5,100	5,138	
Spirit Issuer PLC				
3.034% 期日 12/28/2031	GBP	760	984	
6.582% 期日 12/28/2027		450	639	
Sprint Spectrum Co. LLC				
3.360% 期日 09/20/2021	USD	4,500	4,577	
Tech Data Corp.				
3.700% 期日 02/15/2022		147	148	
4.950% 期日 02/15/2027		903	950	
Tenet Healthcare Corp.				
4.625% 期日 07/15/2024		1,842	1,819	
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				
1.400% 期日 07/20/2018		2,980	2,965	
Time Warner, Inc.				
3.800% 期日 02/15/2027		384	385	
Times Square Hotel Trust				
8.528% 期日 08/01/2026		2,031	2,412	
Transocean, Inc.				
7.500% 期日 01/15/2026		1,016	1,049	
Unique Pub Finance Co. PLC				
5.659% 期日 06/30/2027	GBP	1,826	2,755	



	6.542% 期日 03/30/2021		1,000	1,441
	7.395% 期日 03/28/2024		1,886	2,877
	United Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust			
	3.100% 期日 07/07/2028	USD	500	503
	United Group BV			
	4.375% 期日 07/01/2022	EUR	600	736
	4.875% 期日 07/01/2024		1,100	1,347
	UPCB Finance Ltd.			
	3.625% 期日 06/15/2029		8,151	9,565
	Valeant Pharmaceuticals International, Inc.			
	4.500% 期日 05/15/2023		800	794
	6.500% 期日 03/15/2022	USD	469	498
	7.000% 期日 03/15/2024		901	978
	Verizon Communications, Inc.			
	2.875% 期日 01/15/2038	EUR	980	1,178
	ViaSat, Inc.			
	5.625% 期日 09/15/2025	USD	760	772
	Viking Cruises Ltd.			
	5.875% 期日 09/15/2027		162	164
	Virgin Media Secured Finance PLC			
	5.000% 期日 04/15/2027	GBP	3,760	5,204
	VMware, Inc.			
	2.300% 期日 08/21/2020	USD	760	759
	2.950% 期日 08/21/2022		640	642
	3.900% 期日 08/21/2027		540	542
	Volkswagen Bank GmbH			
	0.081% 期日 11/27/2017	EUR	200	233
	Volkswagen Group of America Finance LLC			
	1.650% 期日 05/22/2018	USD	300	300
	Westmoreland Coal Co.			
	8.750% 期日 01/01/2022		685	415
	Wind Acquisition Finance S.A.			
	4.750% 期日 07/15/2020		4,997	5,069
	7.375% 期日 04/23/2021		9,600	9,996
	Wind Tre SpA			
	2.467% 期日 01/20/2024	EUR	2,400	2,813
	2.625% 期日 01/20/2023		2,400	2,811
	3.125% 期日 01/20/2025		1,200	1,403
	5.000% 期日 01/20/2026	USD	1,000	1,008
	Wyndham Worldwide Corp.			
	4.150% 期日 04/01/2024		179	182
	4.500% 期日 04/01/2027		203	208
	Wynn Las Vegas LLC			
	5.250% 期日 05/15/2027		62	63
	Wynn Macau Ltd.			
	4.875% 期日 10/01/2024		600	611
	5.500% 期日 10/01/2027		800	813
	Xerox Corp.			
	3.625% 期日 03/15/2023		838	828
				492,499
公共事業	AT&T, Inc.			
3.0%	2.309% 期日 07/15/2021		6,910	6,998
	2.850% 期日 02/14/2023		1,700	1,690
	3.150% 期日 09/04/2036	EUR	600	723
	3.400% 期日 08/14/2024	USD	3,390	3,392
	3.900% 期日 08/14/2027		3,080	3,074

4.900% 期日 08/14/2037		3,020	3,023
5.150% 期日 02/14/2050		5,750	5,690
5.300% 期日 08/14/2058		3,454	3,434
5.650% 期日 02/15/2047		44	47
BG Energy Capital PLC			
6.500% 期日 11/30/2072		1,400	1,405
British Transco International Finance BV			
0.000% 期日 11/04/2021		400	362
El Paso Natural Gas Co. LLC			
8.625% 期日 01/15/2022		1,900	2,309
Enbridge, Inc.			
1.750% 期日 01/10/2020		10,400	10,391
2.020% 期日 06/15/2020		6,170	6,223
Energy Transfer LP			
4.150% 期日 10/01/2020		100	104
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
4.375% 期日 09/19/2022		5,550	5,673
6.000% 期日 11/27/2023		11,600	12,814
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.			
4.950% 期日 02/06/2028		600	615
5.999% 期日 01/23/2021		1,622	1,747
6.510% 期日 03/07/2022		6,398	7,098
6.605% 期日 02/13/2018	EUR	100	119
7.288% 期日 08/16/2037	USD	937	1,140
8.146% 期日 04/11/2018		300	308
8.625% 期日 04/28/2034		2,622	3,547
9.250% 期日 04/23/2019		7,200	7,855
Global Switch Holdings Ltd.			
1.500% 期日 01/31/2024	EUR	1,100	1,321
2.250% 期日 05/31/2027		1,000	1,228
Kinder Morgan Energy Partners LP			
6.850% 期日 02/15/2020	USD	2,750	3,029
NorteGas Energia Distribucion SAU			
2.065% 期日 09/28/2027	EUR	400	478
Petrobras Global Finance BV			
3.000% 期日 01/15/2019	USD	40	40
4.201% 期日 03/17/2020		440	452
4.250% 期日 10/02/2023	EUR	1,469	1,885
5.299% 期日 01/27/2025	USD	6,883	6,914
5.375% 期日 01/27/2021		7,068	7,448
5.750% 期日 01/20/2020		400	421
5.875% 期日 03/07/2022	EUR	1,100	1,490
5.999% 期日 01/27/2028	USD	12,889	13,067
6.125% 期日 01/17/2022		19,307	20,919
6.250% 期日 03/17/2024		400	430
6.250% 期日 12/14/2026	GBP	2,831	4,082
6.625% 期日 01/16/2034		2,900	4,120
6.750% 期日 01/27/2041	USD	710	717
6.850% 期日 06/05/2115		2,144	2,061
6.875% 期日 01/20/2040		464	474
7.250% 期日 03/17/2044		1,562	1,642
7.375% 期日 01/17/2027		13,182	14,665
8.375% 期日 12/10/2018		1,000	1,071
8.375% 期日 05/23/2021		900	1,039
8.750% 期日 05/23/2026		2,340	2,840
Regency Energy Partners LP			
5.750% 期日 09/01/2020		2,140	2,307

	Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			
	9.750% 期日 01/06/2027		549	596
	Sempra Energy			
	1.732% 期日 03/15/2021		9,400	9,426
	Sinopec Group Overseas Development 2016 Ltd.			
	2.125% 期日 05/03/2019		200	199
	Sprint Capital Corp.			
	6.900% 期日 05/01/2019		24,690	26,110
	Sprint Communications, Inc.			
	7.000% 期日 08/15/2020		13,198	14,250
	Sprint Corp.			
	7.125% 期日 06/15/2024		118	128
	Terraform Global Operating LLC			
	9.750% 期日 08/15/2022		1,120	1,246
	Transocean Phoenix 2 Ltd.			
	7.750% 期日 10/15/2024		1,890	2,046
	Transocean Proteus Ltd.			
	6.250% 期日 12/01/2024		51	54
	Verizon Communications, Inc.			
	3.375% 期日 10/27/2036	GBP	680	893
	4.125% 期日 03/16/2027	USD	2,540	2,656
	4.125% 期日 08/15/2046		270	247
	5.250% 期日 03/16/2037		1,690	1,852
	5.500% 期日 03/16/2047		960	1,064
				244,688
				1,643,211
				社債券等合計
				(原価：1,577,801米ドル)
転換社債及び 短期証券	Caesars Entertainment Corp.			
0.1%	5.000% 期日 10/01/2024		2,906	5,718
				転換社債及び短期証券合計
				(原価：5,043米ドル)
地方債	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			
0.4%	6.630% 期日 02/01/2035		655	737
	6.725% 期日 04/01/2035		280	316
	7.350% 期日 07/01/2035		545	638
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2003			
	5.100% 期日 06/01/2033		1,740	1,758
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2011			
	5.665% 期日 03/01/2018		195	197
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2014			
	6.314% 期日 01/01/2044		220	236
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015			
	7.375% 期日 01/01/2033		440	510
	7.750% 期日 01/01/2042		780	853
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017			
	7.045% 期日 01/01/2029		370	411
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2006			
	5.250% 期日 07/01/2026		1,000	295

Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2007		
5.000% 期日 07/01/2028	75	22
5.250% 期日 07/01/2037	410	121
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2008		
5.125% 期日 07/01/2028	130	38
5.700% 期日 07/01/2023	685	202
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2009		
5.750% 期日 07/01/2038	310	91
6.000% 期日 07/01/2039	215	63
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2011		
5.375% 期日 07/01/2030	685	202
5.750% 期日 07/01/2041	600	177
6.500% 期日 07/01/2040	120	35
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2012		
4.125% 期日 07/01/2022	500	143
5.000% 期日 07/01/2021	1,010	296
5.000% 期日 07/01/2041	3,260	962
5.125% 期日 07/01/2037	800	236
5.500% 期日 07/01/2026	1,900	561
5.500% 期日 07/01/2039	4,215	1,243
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2014		
8.000% 期日 07/01/2035	3,500	1,050
Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010		
6.050% 期日 07/01/2032	800	269
Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2016		
0.000% 期日 09/25/2056	1,522	1,527
Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2017		
0.000% 期日 01/25/2057	13,982	14,026
Travis, Texas, Texas Public Finance Authority Revenue Bonds, Series 2014		
8.250% 期日 07/01/2024	500	521
		27,736
地方債合計		27,736
		27,736

(原価：27,248米ドル)

米国政府機関  
債

4.1%

Fannie Mae		
2.500% 期日 10/01/2022	563	569
3.000% 期日 03/01/2031	6,920	7,097
3.500% 期日 08/01/2042	73	75
3.500% 期日 12/01/2045	660	679
4.000% 期日 07/01/2040	159	167
4.000% 期日 12/01/2041	229	239
4.000% 期日 07/01/2042	374	389
4.000% 期日 08/01/2042	93	96
4.000% 期日 09/01/2042	358	373
4.500% 期日 05/01/2033	21	21
4.500% 期日 07/01/2033	39	41
4.500% 期日 05/01/2034	11	11
4.500% 期日 05/01/2035	8	8

4.500% 期日 09/01/2035	9	9
4.500% 期日 02/01/2038	11	12
4.500% 期日 01/01/2041	608	638
4.750% 期日 06/01/2033	225	231
5.000% 期日 01/01/2032	30	31
5.000% 期日 10/01/2035	81	83
5.000% 期日 12/01/2035	436	462
5.000% 期日 10/01/2036	8	9
5.000% 期日 05/01/2038	6	6
5.000% 期日 11/01/2039	13	14
5.000% 期日 10/01/2051	548	586
5.500% 期日 07/01/2033	58	63
5.500% 期日 06/01/2035	878	938
5.500% 期日 04/01/2036	4	4
5.500% 期日 11/01/2036	14	15
5.500% 期日 03/01/2037	34	37
5.500% 期日 09/01/2037	32	33
5.500% 期日 02/01/2038	4	4
5.500% 期日 04/01/2038	75	79
6.000% 期日 08/01/2031	32	33
6.000% 期日 06/01/2032	8	9
6.000% 期日 09/01/2039	436	469
6.000% 期日 10/01/2047	35	38
6.500% 期日 01/01/2037	7	7
6.500% 期日 10/01/2037	26	30
7.000% 期日 09/01/2031	39	40
7.000% 期日 09/01/2036	0	0
7.000% 期日 05/01/2037	3	3
7.500% 期日 09/01/2032	14	14
8.500% 期日 09/01/2031	13	13
Fannie Mae, TBA		
2.500% 期日 12/01/2032	3,000	3,010
3.000% 期日 12/01/2032	3,000	3,070
3.000% 期日 11/01/2047	16,800	16,811
3.000% 期日 12/01/2047	5,000	4,995
3.500% 期日 12/01/2047	18,400	18,883
4.000% 期日 12/01/2047	88,000	92,233
Freddie Mac		
4.000% 期日 09/01/2033	8	8
4.500% 期日 12/01/2019	9	9
4.500% 期日 05/01/2036	6	6
5.000% 期日 06/01/2034	510	541
5.000% 期日 08/01/2035	129	136
5.000% 期日 01/01/2037	4	5
5.000% 期日 02/01/2037	143	147
5.000% 期日 01/01/2038	5	5
5.311% 期日 06/15/2042	99	22
5.500% 期日 01/01/2035	2,422	2,653
5.500% 期日 05/01/2037	7	8
5.500% 期日 06/01/2037	279	300
5.500% 期日 07/01/2037	43	44
5.750% 期日 05/01/2037	683	766
6.000% 期日 07/01/2037	54	56
Freddie Mac, TBA		
3.000% 期日 11/01/2047	28,000	28,026
3.000% 期日 12/01/2047	69,000	68,956
3.500% 期日 12/01/2047	75,000	76,967

## Ginnie Mae

4.500% 期日 01/20/2040	339	350
4.500% 期日 03/20/2040	66	68
5.000% 期日 08/20/2030	1,042	1,130
5.000% 期日 05/20/2040	949	1,006
5.000% 期日 11/20/2040	64	66
5.000% 期日 04/20/2041	27	28
5.500% 期日 05/20/2038	22	23
5.500% 期日 06/20/2038	225	235
5.500% 期日 07/20/2038	166	176
5.500% 期日 08/20/2038	800	838
5.500% 期日 09/20/2038	645	676
5.500% 期日 10/20/2038	79	83
5.500% 期日 01/20/2039	21	22
5.500% 期日 02/20/2039	103	108
5.500% 期日 07/20/2039	182	190
5.500% 期日 09/20/2039	215	225
5.500% 期日 10/20/2039	446	467
5.500% 期日 11/20/2039	446	466
5.500% 期日 12/20/2039	339	354
5.500% 期日 01/20/2040	373	390
5.500% 期日 06/20/2040	700	761
5.500% 期日 07/20/2040	556	580

米国政府機関債合計

339,574

(原価：339,299米ドル)

## 米国財務省証券

## Treasury Inflation Protected Securities

19.2%	0.125% 期日 04/15/2020	1,153	1,158
	0.375% 期日 01/15/2027	5	5
	0.625% 期日 07/15/2021	76	78
	2.375% 期日 01/15/2025	25,816	29,429
	U.S. Treasury Bonds		
	2.125% 期日 08/15/2021	65,100	65,729
	2.250% 期日 08/15/2046	100	88
	2.750% 期日 08/15/2047	13,900	13,554
	U.S. Treasury Notes		
	1.125% 期日 09/30/2021	37,390	36,321
	1.375% 期日 08/31/2023	56,200	53,906
	1.500% 期日 01/31/2022	200	196
	1.625% 期日 02/15/2026	2,200	2,085
	1.750% 期日 11/30/2021	26,400	26,240
	1.750% 期日 03/31/2022	9,300	9,220
	1.750% 期日 05/15/2022	5,400	5,354
	1.750% 期日 09/30/2022	11,500	11,357
	1.875% 期日 08/31/2022	24,200	24,053
	1.875% 期日 08/31/2024	26,700	26,129
	2.000% 期日 10/31/2021	2,700	2,711
	2.000% 期日 07/31/2022	7,400	7,403
	2.000% 期日 05/31/2024	36,300	35,865
	2.000% 期日 06/30/2024	142,800	141,012
	2.000% 期日 02/15/2025	11,021	10,832
	2.000% 期日 08/15/2025	1,400	1,371
	2.000% 期日 11/15/2026	800	777
	2.125% 期日 12/31/2021	30,200	30,451
	2.125% 期日 06/30/2022	19,600	19,720
	2.125% 期日 07/31/2024	49,000	48,742
	2.125% 期日 09/30/2024	117,000	116,276

2.250% 期日 12/31/2023	89,100	89,599
2.250% 期日 10/31/2024	551,050	551,846
2.250% 期日 11/15/2024	63,300	63,366
2.250% 期日 02/15/2027	28,000	27,734
2.375% 期日 05/15/2027	25,836	25,852
2.500% 期日 05/15/2024	98,000	99,836
		1,578,295

米国財務省証券合計

(原価：1,583,895米ドル)

## モーゲージ証

券

33.5%

## Accredited Mortgage Loan Trust

2.183% 期日 07/25/2035	9,806	9,575
2.933% 期日 07/25/2035	715	623

## ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust

1.393% 期日 08/25/2036	9,566	9,302
2.138% 期日 08/25/2035	5,023	4,360

## ALESCO Preferred Funding Ltd.

1.778% 期日 12/23/2036	5,000	3,675
----------------------	-------	-------

## Alternative Loan Trust

1.408% 期日 01/25/2037	15,781	15,417
1.408% 期日 07/25/2046	14,153	13,701
1.418% 期日 07/25/2036	15,840	14,256
1.428% 期日 08/25/2046	23,958	18,822
1.429% 期日 09/20/2046	3,128	2,600
1.438% 期日 05/25/2036	25,627	21,944
1.449% 期日 03/20/2046	12,428	10,659
1.488% 期日 12/25/2046	26,854	19,777
1.538% 期日 01/25/2036	4,412	4,235
3.403% 期日 08/25/2035	1,025	869
3.649% 期日 09/25/2034	2,192	2,164
5.500% 期日 08/25/2035	139	135
5.500% 期日 02/25/2036	31	27
6.000% 期日 07/25/2037	58	56

## Ameriquest Mortgage Securities Trust

1.578% 期日 04/25/2036	10,400	10,236
1.648% 期日 03/25/2036	27,500	24,470

## Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates

2.308% 期日 09/25/2032	685	678
2.993% 期日 10/25/2034	9,000	7,520

## Argent Mortgage Loan Trust

1.718% 期日 05/25/2035	39,820	36,070
----------------------	--------	--------

## Argent Securities Trust

1.418% 期日 04/25/2036	9,254	4,156
----------------------	-------	-------

## Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates

3.938% 期日 09/25/2033	2,669	2,641
----------------------	-------	-------

## Asset-Backed Funding Certificates Trust

1.898% 期日 03/25/2035	9,929	9,854
1.973% 期日 06/25/2035	12,354	12,195

## BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust

2.039% 期日 06/15/2028	5,000	5,008
----------------------	-------	-------

## Banc of America Alternative Loan Trust

5.772% 期日 04/25/2022	364	367
6.000% 期日 07/25/2046	3,922	3,499

## Banc of America Commercial Mortgage Trust

5.819% 期日 09/10/2045	8,787	9,146
----------------------	-------	-------

Bayview Opportunity Master Fund b Trust		
3.475% 期日 04/28/2032	3,440	3,457
BCAP LLC Trust		
1.436% 期日 07/26/2036	804	771
1.496% 期日 01/26/2037	1,915	1,846
2.567% 期日 11/26/2035	44	44
6.600% 期日 04/26/2036	8,942	7,601
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
3.615% 期日 11/25/2034	512	501
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
1.438% 期日 04/25/2037	7,898	9,524
1.478% 期日 02/25/2037	10,280	10,932
1.598% 期日 04/25/2036	12,900	12,803
1.638% 期日 02/25/2036	7,436	7,331
1.638% 期日 05/25/2036	15,624	9,384
1.668% 期日 12/25/2035	9,109	9,125
1.738% 期日 12/25/2035	6,400	6,397
1.938% 期日 11/25/2035	6,538	6,827
5.362% 期日 05/25/2036	15,624	1,257
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
1.498% 期日 10/25/2036	8,166	8,161
3.262% 期日 06/25/2035	3,853	3,753
BX Trust		
2.119% 期日 07/15/2034	9,500	9,534
2.159% 期日 07/15/2034	8,250	8,285
2.389% 期日 07/15/2034	2,500	2,507
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage		
5.540% 期日 01/25/2039	2,525	2,143
Centex Home Equity Loan Trust		
1.883% 期日 03/25/2035	5,514	5,417
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates		
1.598% 期日 03/25/2035	1,079	1,032
CIT Mortgage Loan Trust		
2.588% 期日 10/25/2037	25,886	26,080
Citigroup Commercial Mortgage Trust		
0.096% 期日 03/10/2047	25,400	422
Citigroup Mortgage Loan Trust		
1.578% 期日 01/25/2036	101	102
1.638% 期日 03/25/2037	15,986	15,852
1.858% 期日 12/25/2035	6,252	6,280
3.291% 期日 08/25/2036	8,860	8,269
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
1.498% 期日 01/25/2037	1,860	1,833
1.818% 期日 07/25/2035	3,174	3,203
2.273% 期日 05/25/2035	6,300	5,711
Commercial Mortgage Trust		
0.151% 期日 04/10/2047	33,000	341
Conseco Financial Corp.		
6.870% 期日 04/01/2030	6,684	7,179
7.500% 期日 03/01/2030	64,312	51,329
7.700% 期日 09/15/2026	2,941	3,162
Countrywide Asset-Backed Certificates		
1.378% 期日 06/25/2035	1,732	1,578
1.378% 期日 06/25/2037	25,851	23,640



1.378% 期日 07/25/2037		3,884	3,453
1.388% 期日 04/25/2047		7,173	6,997
1.398% 期日 05/25/2037		32,455	31,398
1.408% 期日 06/25/2047		3,886	3,840
1.458% 期日 08/25/2037		25,800	22,228
1.518% 期日 01/25/2045		7,700	7,662
1.740% 期日 08/26/2033		552	513
1.968% 期日 06/25/2035		7,000	6,388
1.988% 期日 02/25/2034		11,194	11,189
2.393% 期日 06/25/2033		1,231	1,181
2.843% 期日 01/25/2034		784	762
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
3.459% 期日 11/25/2034		25	25
3.527% 期日 06/25/2034		3	3
5.500% 期日 11/25/2035		11,649	10,668
6.000% 期日 11/25/2037		8,864	7,954
Credit Suisse Mortgage Capital			
1.407% 期日 11/27/2036		8,353	8,419
3.000% 期日 01/29/2036		3,516	3,533
3.475% 期日 08/28/2036		5,960	5,965
5.315% 期日 10/26/2036		493	427
Credit Suisse Mortgage Capital Commercial Mortgage Trust			
2.035% 期日 07/15/2030		8,618	8,630
2.339% 期日 07/15/2030		24,700	24,664
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
1.989% 期日 07/15/2032		5,200	5,215
2.239% 期日 07/15/2032		4,000	4,012
2.439% 期日 07/15/2032		2,400	2,407
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
1.388% 期日 07/25/2036		7,108	6,946
CWABS Asset-Backed Certificates Trust			
1.478% 期日 03/25/2037		33,000	27,170
1.478% 期日 03/25/2047		26,535	23,127
2.363% 期日 12/25/2034		3,011	3,071
4.718% 期日 06/25/2035		8,644	7,955
Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust			
1.398% 期日 03/25/2037		16,726	11,950
1.568% 期日 08/25/2037		49,734	40,108
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
0.000% 期日 11/27/2036		8,343	8,254
Dragon Finance BV			
1.554% 期日 07/13/2023	GBP	255	329
DSL A Mortgage Loan Trust			
1.538% 期日 10/19/2045	USD	6,334	6,303
Dutch Property Finance BV			
0.349% 期日 01/28/2048	EUR	27,494	32,253
EMC Mortgage Loan Trust			
2.288% 期日 04/25/2042	USD	10,016	8,387
2.737% 期日 04/25/2042		1,544	1,521
Eurosail PLC			
0.457% 期日 09/10/2044	GBP	1,472	1,944
Eurosail-UK PLC			
1.072% 期日 09/13/2045		7,418	9,349

1.252% 期日 06/13/2045		19,616	25,619
FBR Securitization Trust			
1.913% 期日 10/25/2035	USD	13,418	8,252
1.918% 期日 10/25/2035		17,906	17,328
2.003% 期日 09/25/2035		7,500	6,454
First Franklin Mortgage Loan Trust			
1.388% 期日 07/25/2036		1,601	1,593
1.398% 期日 04/25/2036		9,070	8,633
FORT CRE LLC			
2.739% 期日 05/21/2036		2,608	2,610
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes			
4.488% 期日 05/25/2025		250	280
Fremont Home Loan Trust			
1.378% 期日 02/25/2037		12,376	10,137
GE Business Loan Trust			
1.420% 期日 11/15/2034		3,814	3,698
GMACM Home Equity Loan Trust			
5.952% 期日 08/25/2037		9,947	10,367
Great Wolf Trust			
0.000% 期日 12/15/2018		104,500	0
2.089% 期日 09/15/2034		8,400	8,406
2.339% 期日 09/15/2034		13,900	13,935
Greenpoint Manufactured Housing			
7.270% 期日 06/15/2029		40,026	41,100
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
1.518% 期日 11/25/2045		119	96
Grifonas Finance PLC			
0.088% 期日 08/28/2039	EUR	1,299	1,294
GS Mortgage Securities Corp.			
3.419% 期日 11/10/1932	USD	3,300	3,398
4.744% 期日 11/10/1932		6,100	5,931
GSAA Home Equity Trust			
6.500% 期日 11/25/2037		29	21
GSAMP Trust			
1.388% 期日 06/25/2036		6,235	6,185
1.398% 期日 01/25/2037		26,229	17,157
1.398% 期日 05/25/2046		1,762	1,742
1.498% 期日 06/25/2036		20,000	18,137
1.883% 期日 11/25/2035		7,949	5,384
GSR Mortgage Loan Trust			
1.538% 期日 03/25/2037		12,806	5,806
5.462% 期日 03/25/2037		12,806	3,147
HarborView Mortgage Loan Trust			
1.478% 期日 12/19/2036		2,001	1,769
1.558% 期日 08/19/2045		16,007	15,402
Hawksmoor Mortgages PLC			
1.680% 期日 05/25/2053	GBP	8,426	11,315
Home Equity Asset Trust			
1.478% 期日 10/25/2036	USD	23,475	10,290
1.548% 期日 07/25/2036		576	578
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
1.378% 期日 11/25/2036		24,246	22,752
1.418% 期日 06/25/2036		6,489	6,226
1.898% 期日 08/25/2035		5,750	5,417
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
1.488% 期日 05/25/2037		7,197	6,486

Hyatt Hotel Portfolio Trust		
1.897% 期日 08/09/2020	2,900	2,899
3.093% 期日 08/09/2020	1,967	1,965
Impac CMB Trust		
1.918% 期日 01/25/2035	27,330	26,922
IMT Trust		
1.939% 期日 06/15/2034	2,400	2,403
2.189% 期日 06/15/2034	1,800	1,802
2.339% 期日 06/15/2034	1,100	1,101
IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust		
3.412% 期日 06/25/2037	17,511	15,601
IndyMac INDA Mortgage Loan Trust		
3.302% 期日 03/25/2036	9,200	8,592
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
1.418% 期日 02/25/2037	49,558	46,608
1.428% 期日 10/25/2036	9,258	6,590
3.330% 期日 07/25/2037	37,653	35,671
3.437% 期日 04/25/2037	14,443	13,643
3.475% 期日 04/25/2037	28,455	26,555
3.514% 期日 11/25/2036	24,262	21,314
IXIS Real Estate Capital Trust		
2.003% 期日 12/25/2035	10,353	10,193
Jefferies Resecuritization Trust		
6.919% 期日 06/25/2047	1,270	1,224
JPMorgan Alternative Loan Trust		
1.518% 期日 04/25/2047	6,043	5,921
3.389% 期日 03/25/2036	853	791
5.730% 期日 03/25/2036	813	855
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
2.090% 期日 10/15/2032	22,300	22,328
2.340% 期日 10/15/2032	7,000	7,009
2.640% 期日 10/15/2032	7,200	7,209
3.380% 期日 10/15/2032	11,000	10,959
5.337% 期日 05/15/2047	332	334
JP Morgan Chase Commercial Re-REMIC Trust		
2.689% 期日 01/15/2033	1,187	1,190
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.		
0.000% 期日 03/25/2036	15,779	14,840
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust		
1.408% 期日 04/25/2036	775	776
1.438% 期日 05/25/2036	17,692	17,697
1.488% 期日 07/25/2036	11,062	10,864
1.508% 期日 05/25/2036	12,851	12,269
1.508% 期日 08/25/2036	8,600	6,676
1.508% 期日 06/25/2037	34,606	31,535
JP Morgan Mortgage Trust		
1.538% 期日 10/25/2035	10,903	9,402
3.443% 期日 01/25/2037	1,477	1,456
JP Morgan Resecuritization Trust		
3.551% 期日 02/26/2037	7,176	6,986
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC		
0.000% 期日 06/15/2045	EUR 7,113	7,517
LB-UBS Commercial Mortgage Trust		
6.114% 期日 07/15/2040	USD 456	456
Lehman XS Trust		
1.428% 期日 12/25/2036	11,995	8,281

1.498% 期日 02/25/2047	25,088	21,829
Long Beach Mortgage Loan Trust		
1.428% 期日 02/25/2036	8,791	6,207
1.428% 期日 03/25/2046	19,688	10,267
1.478% 期日 01/25/2046	1,184	1,187
3.338% 期日 06/25/2034	2,120	2,076
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust		
4.488% 期日 03/25/2032	3,600	3,716
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust		
3.080% 期日 04/25/2034	5	5
MASTR Asset-Backed Securities Trust		
1.458% 期日 11/25/2036	41	29
2.388% 期日 08/25/2037	20,304	16,426
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
1.618% 期日 08/25/2035	47	46
3.107% 期日 02/25/2033	38	37
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital , Inc. Trust		
1.508% 期日 03/25/2036	11,250	11,072
1.943% 期日 07/25/2035	3,820	3,821
1.973% 期日 07/25/2035	5,512	4,953
2.153% 期日 11/25/2034	7,262	7,239
2.238% 期日 03/25/2033	150	148
Morgan Stanley Capital , Inc. Trust		
1.598% 期日 02/25/2036	19,249	14,299
Morgan Stanley Dean Witter Capital Trust		
7.579% 期日 07/15/2033	5,305	5,481
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
1.658% 期日 12/25/2035	27,533	27,280
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital		
1.468% 期日 07/25/2036	13,861	8,155
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		
3.387% 期日 11/25/2037	2,754	2,597
Mortgage Loan Trust		
4.870% 期日 03/25/2034	3,310	3,233
Motel 6 Trust		
2.159% 期日 08/15/2034	30,800	30,949
2.429% 期日 08/15/2034	27,012	27,092
3.389% 期日 08/15/2034	2,791	2,803
Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates		
6.450% 期日 01/22/2026	462	477
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust		
1.748% 期日 05/25/2035	7,400	6,468
5.745% 期日 10/25/2036	26,927	11,975
Nomura Resecuritization Trust		
1.363% 期日 03/26/2037	9,314	5,255
3.277% 期日 11/26/2036	6,293	6,268
NovaStar Mortgage Funding Trust		
1.398% 期日 05/25/2036	20,560	20,411
1.398% 期日 10/25/2036	7,805	4,483
1.718% 期日 10/25/2035	2,500	2,394
Oncilla Mortgage Funding PLC		
1.692% 期日 12/12/2043	GBP 12,530	16,914
Option One Mortgage Loan Trust		

1.338% 期日 02/25/2037	USD	7,038	5,168
1.358% 期日 03/25/2037		21,608	20,087
Paragon Mortgages No.13 PLC			
0.520% 期日 01/15/2039	GBP	4,282	5,461
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
1.728% 期日 09/25/2035	USD	4,713	4,704
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
1.398% 期日 09/25/2036		29,643	9,617
PFP Ltd.			
2.117% 期日 07/14/2035		6,771	6,772
2.487% 期日 07/14/2035		3,229	3,230
Quest Trust			
2.663% 期日 03/25/2035		6,060	5,709
RAAC Trust			
1.988% 期日 06/25/2047		23,049	18,187
RBSGC Mortgage Loan Trust			
6.000% 期日 01/25/2037		14	13
RBSSP Resecuritization Trust			
1.738% 期日 04/26/2037		240	227
Renaissance Home Equity Loan Trust			
1.598% 期日 11/25/2034		64	60
2.238% 期日 09/25/2037		75	61
5.612% 期日 04/25/2037		9,308	4,966
5.675% 期日 06/25/2037		3,930	1,931
Renoir CDO BV			
0.521% 期日 10/07/2095	EUR	4,300	4,762
1.571% 期日 10/07/2095		5,408	6,239
5.184% 期日 10/07/2095		4,911	5,888
Residential Accredited Securities Corporation Trust			
1.388% 期日 01/25/2037	USD	2,907	2,839
1.398% 期日 11/25/2036		8,820	8,398
1.458% 期日 02/25/2037		14,000	12,726
1.537% 期日 01/25/2037		37,572	22,106
1.568% 期日 04/25/2036		17,500	17,067
2.003% 期日 03/25/2034		4,807	4,824
Residential Asset Mortgage Products Trust			
1.457% 期日 10/25/2034		5,907	5,679
1.577% 期日 12/25/2035		17,756	15,020
1.678% 期日 10/25/2035		5,000	5,014
1.688% 期日 11/25/2035		13,000	12,292
1.738% 期日 09/25/2035		12,591	11,665
Residential Asset Securitization Trust			
5.500% 期日 10/25/2035		5,223	4,975
Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC			
0.532% 期日 06/12/2036	GBP	5,319	6,866
Residential Mortgage Securities 29 PLC			
1.277% 期日 12/20/2046		12,376	16,545
Residential Mortgage Securities 30 PLC			
1.165% 期日 03/20/2050		15,260	20,322
Ripon Mortgages PLC			
1.082% 期日 08/20/2056		24,010	32,029
Rochester Financing No.2 PLC			
1.633% 期日 06/20/2045		9,470	12,734

Saxon Asset Securities Trust					
2.033%	期日	03/25/2035	USD	2,077	2,040
2.288%	期日	06/25/2033		1,555	1,529
2.988%	期日	12/25/2037		7,275	7,461
Securitized Asset-Backed Receivables LLC					
Trust					
1.508%	期日	03/25/2036		11,011	9,909
2.288%	期日	03/25/2035		8,650	8,135
Sequoia Mortgage Trust					
1.439%	期日	05/20/2035		4,837	4,746
1.759%	期日	06/20/2034		71	68
Sestante Finance Srl					
0.000%	期日	07/23/2046	EUR	15,283	15,187
SG Mortgage Securities Trust					
1.418%	期日	02/25/2036	USD	6,657	4,521
Slate No.1 PLC					
1.854%	期日	01/24/2051	GBP	7,819	10,456
2.254%	期日	01/24/2051		2,600	3,471
Soundview Home Loan Trust					
1.518%	期日	06/25/2036	USD	5,975	2,715
1.548%	期日	06/25/2036		45,587	24,505
1.888%	期日	03/25/2036		8,102	5,190
Specialty Underwriting & Residential Finance					
Trust					
2.213%	期日	12/25/2035		3,239	3,239
2.218%	期日	10/25/2035		3,677	3,619
Stonemont Portfolio Trust					
2.085%	期日	08/20/2030		26,300	26,390
2.335%	期日	08/20/2030		11,300	11,332
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan					
Trust					
1.558%	期日	10/25/2035		12,034	11,743
2.401%	期日	05/25/2035		151	125
3.626%	期日	06/25/2037		14,007	13,697
4.123%	期日	07/25/2035		4,562	3,761
Structured Asset Investment Loan Trust					
1.388%	期日	06/25/2036		16,216	15,839
1.958%	期日	04/25/2035		4,440	4,394
2.038%	期日	02/25/2034		37,463	37,512
2.438%	期日	12/25/2034		12,273	12,130
Structured Asset Mortgage Investments					
Trust					
1.913%	期日	04/19/2035		5,147	5,001
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
1.898%	期日	09/19/2032		75	74
Structured Asset Securities Corporation					
Mortgage Loan Trust					
1.368%	期日	05/25/2036		18,742	17,865
1.498%	期日	04/25/2036		1,242	1,228
1.738%	期日	04/25/2031		8,945	8,007
1.858%	期日	11/25/2035		19,865	19,674
Sutherland Commercial Mortgage Loans					
3.192%	期日	05/25/2037		3,853	3,892
Taurus CMBS UK Ltd.					
1.685%	期日	05/01/2022	GBP	1,066	1,421
Theatre Hospitals No.1 PLC					
3.379%	期日	10/15/2031		1,456	1,897

	Theatre Hospitals No.2 PLC			
	3.379% 期日 10/15/2031		685	893
	Trinity Square PLC			
	1.529% 期日 07/15/2051		719	967
	Twin Bridges PLC			
	1.143% 期日 09/12/2044		20,100	26,747
	VOLT LIX LLC			
	3.250% 期日 05/25/2047	USD	4,567	4,608
	VOLT LX LLC			
	3.250% 期日 04/25/2059		31,177	31,415
	VOLT LLC			
	3.500% 期日 02/25/2055		1,177	1,184
	Waldorf Astoria Boca Raton Trust			
	2.589% 期日 06/15/2029		6,100	6,111
	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
	1.958% 期日 01/25/2045		188	181
	Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC			
	0.000% 期日 12/21/2049	GBP	1	509
	0.000% 期日 12/21/2049		1	4,082
	1.286% 期日 12/21/2049		56,240	74,722
	1.986% 期日 12/21/2049		4,921	6,546
	2.486% 期日 12/21/2049		2,460	3,276
	2.986% 期日 12/21/2049		1,406	1,873
	3.486% 期日 12/21/2049		1,406	1,874
	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust			
	1.794% 期日 10/25/2046	USD	22,961	15,809
	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
	1.448% 期日 03/25/2037		3,402	2,940
	1.508% 期日 07/25/2036		10,000	9,663
	Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
	1.538% 期日 04/25/2034		8,609	8,539
	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
	3.624% 期日 10/25/2036		747	710
	WFCG Commercial Mortgage Trust			
	4.959% 期日 11/15/2029		3,455	3,466
	WFRBS Commercial Mortgage Trust			
	0.431% 期日 03/15/2047		8,800	240
				2,752,132
	モーゲージ証券合計			
	(原価2,681,526米ドル)			
資産担保証券	AASET Trust			
12.2%	3.967% 期日 05/16/2042		485	487
	Aircraft Certificate Owner Trust			
	7.001% 期日 09/20/2022		867	926
	American Homes 4 Rent Trust			
	6.231% 期日 10/17/2036		1,150	1,287
	AmeriCredit Automobile Receivables Trust			
	1.650% 期日 09/18/2020		9,200	9,195
	Anchorage Capital CLO 4 Ltd.			
	2.518% 期日 07/28/2026		1,600	1,608
	3.058% 期日 07/28/2026		14,500	14,572
	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.			

2.349% 期日 08/15/2027		7,960	7,967
Avant Loans Funding Trust			
2.290% 期日 06/15/2020		10,200	10,202
2.410% 期日 03/15/2021		288	288
Avery Point CLO Ltd.			
2.474% 期日 01/18/2025		4,660	4,678
Babson Euro CLO BV			
1.300% 期日 04/15/2027	EUR	17,350	20,388
Bavarian Sky S.A.			
0.027% 期日 05/20/2024		8,070	9,439
0.029% 期日 10/20/2024		3,500	4,094
Black Diamond CLO Ltd.			
2.403% 期日 02/06/2026	USD	11,600	11,614
Bowman Park CLO Ltd.			
2.494% 期日 11/23/2025		6,700	6,738
Bsprt Issuer Ltd.			
2.665% 期日 06/15/2027		4,100	4,118
3.715% 期日 06/15/2027		1,300	1,308
Business Loan Express Business Loan Trust			
1.528% 期日 09/25/2038		2,774	2,553
1.788% 期日 09/25/2038		1,345	1,246
2.338% 期日 09/25/2038		97	92
Cadogan Square CLO BV			
0.277% 期日 01/17/2023	EUR	1,500	1,751
Capitalsource Real Estate Loan Trust			
1.740% 期日 01/20/2037	USD	17,204	16,428
2.000% 期日 01/20/2037		13,400	12,661
2.100% 期日 01/20/2037		4,800	4,522
2.200% 期日 01/20/2037		2,700	2,462
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
2.565% 期日 05/15/2025		8,400	8,468
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
0.659% 期日 08/15/2027	EUR	7,400	8,637
Cavendish Square Funding PLC			
0.612% 期日 02/11/2055		1,500	1,673
CELF Loan Partners PLC			
1.202% 期日 11/01/2023		3,010	3,505
CPS Auto Receivables Trust			
1.780% 期日 09/15/2020	USD	9,123	9,121
CPS Auto Trust			
1.870% 期日 03/15/2021		1,470	1,470
Crestline Denali CLO Ltd.			
0.000% 期日 10/26/2027		11,000	10,997
Crown Point CLO Ltd.			
1.949% 期日 12/31/2023		5,000	5,000
Dekania Europe CDO PLC			
0.271% 期日 09/07/2035	EUR	192	222
Denali Capital CLO Ltd.			
2.513% 期日 04/20/2027	USD	23,000	23,003
Drive Auto Receivables Trust			
1.650% 期日 08/15/2019		4,000	4,000
Dryden 32 Euro CLO BV			
0.659% 期日 08/23/2026	EUR	20,200	23,577
Dryden 35 Euro CLO BV			
0.699% 期日 05/17/2027		17,285	20,162
DT Auto Owner Trust			



1.720% 期日 05/15/2020	USD	5,248	5,248
1.730% 期日 08/17/2020		6,941	6,938
Emerson Park CLO Ltd.			
2.559% 期日 07/15/2025		13,030	13,076
Euromax ABS Ltd.			
0.000% 期日 04/18/2097	EUR	172	195
FAB CBO BV			
0.471% 期日 12/31/2078		148	172
0.729% 期日 08/20/2080		500	546
Finn Square CLO Ltd.			
2.538% 期日 12/24/2023	USD	1,697	1,705
Flatiron CLO Ltd.			
2.513% 期日 01/17/2026		13,400	13,478
2.533% 期日 07/17/2026		9,600	9,628
Galleria CDO Ltd.			
1.844% 期日 09/19/2037		1,059	1,048
GM Financial Automobile Leasing Trust			
1.539% 期日 01/21/2020		37,000	37,059
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.			
2.463% 期日 10/22/2025		5,800	5,800
2.511% 期日 08/01/2025		5,600	5,622
Harbourmaster CLO 9 BV			
0.111% 期日 05/08/2023	EUR	1,126	1,316
0.321% 期日 05/08/2023		7,150	8,333
Harbourmaster Pro-Rata CLO 2 BV			
0.121% 期日 10/15/2022		893	1,041
Highlander Euro CDO BV			
0.041% 期日 05/01/2023		3,210	3,740
Ivory CDO Ltd.			
0.121% 期日 10/31/2099		1,577	1,837
Jubilee CDO -R BV			
0.278% 期日 07/30/2024		12,565	14,671
Jubilee CDO BV			
0.089% 期日 08/21/2021		261	304
0.329% 期日 08/21/2021		10,312	12,021
Lime Street CLO Ltd.			
1.565% 期日 06/20/2021	USD	5,329	5,335
Lockwood Grove CLO Ltd.			
2.837% 期日 04/25/2025		13,025	13,107
METAL LLC			
4.581% 期日 10/15/2042		19,000	19,000
MMcapS Funding Ltd.			
1.666% 期日 12/01/2035		2,072	1,844
National Collegiate Commutation Trust			
3.705% 期日 03/25/2038		928	917
National Collegiate Student Loan Trust			
1.367% 期日 06/26/2028		1,238	1,236
1.447% 期日 11/25/2027		5,148	5,062
1.477% 期日 07/25/2030		4,618	4,518
1.507% 期日 03/26/2029		38,076	37,361
1.528% 期日 10/25/2033		24,247	22,315
1.708% 期日 06/25/2029		8,299	8,138
Navient Private Education Loan Trust			
3.389% 期日 12/15/2045		10,000	10,403
Navient Student Loan Trust			
2.388% 期日 03/25/2066		4,089	4,155
2.488% 期日 06/25/2065		2,531	2,588

Nelnet Student Loan Trust				
1.837% 期日 03/25/2030			10,019	10,069
2.038% 期日 09/25/2065			6,766	6,866
2.147% 期日 07/27/2048			5,516	5,579
OCP CLO Ltd.				
2.203% 期日 04/17/2027			16,800	16,800
OZLM Ltd.				
2.653% 期日 04/17/2026			19,000	19,114
Pallas CDO BV				
0.000% 期日 07/16/2082	EUR		3,885	4,458
Palmer Square CLO Ltd.				
2.573% 期日 10/17/2027	USD		1,900	1,913
Pangaea ABS SPV				
0.000% 期日 12/28/2096	EUR		1,922	2,236
Panther CDO BV				
0.490% 期日 12/12/2080			2,190	2,546
1.590% 期日 12/12/2080			1,505	1,747
Penta CLO 1 S.A.				
1.096% 期日 06/04/2024			200	232
Penta Clo 2 B.V.				
0.790% 期日 08/04/2028			16,600	19,430
Phoenix Park CLO DAC				
0.769% 期日 07/29/2027			4,400	5,153
Progress Residential Trust				
2.737% 期日 09/17/2033	USD		9,913	10,047
SCF RC Funding LLC				
4.100% 期日 06/25/2047			4,677	4,701
Securitized Term Auto Receivables Trust				
1.775% 期日 01/27/2020			1,700	1,700
Silver Arrow Compartment Silver Arrow UK				
0.638% 期日 07/20/2023	GBP		26,800	35,619
Silver Arrow SA Compartment 7				
0.000% 期日 07/15/2024	EUR		2,435	2,844
SLC Student Loan Trust				
1.430% 期日 03/15/2027	USD		19,148	19,137
SLM Private Credit Student Loan Trust				
1.520% 期日 06/15/2023			8,555	8,543
SLM Student Loan Trust				
1.487% 期日 01/25/2027			7,522	7,493
Sofi Consumer Loan Program LLC				
2.770% 期日 05/25/2026			3,540	3,551
SoFi Professional Loan Program LLC				
1.720% 期日 09/25/2040			12,101	12,080
1.860% 期日 11/26/2040			6,500	6,490
2.650% 期日 09/25/2040			3,200	3,203
Sorrento Park CLO DAC				
0.621% 期日 11/16/2027	EUR		21,650	25,229
SpringCastle America Funding LLC				
3.050% 期日 04/25/2029	USD		2,855	2,874
Springleaf Funding Trust				
2.680% 期日 07/15/2030			22,700	22,664
Starwood Waypoint Homes Trust				
2.187% 期日 01/17/2035			11,757	11,802
2.405% 期日 01/17/2035			1,400	1,393
2.637% 期日 01/17/2035			4,727	4,690
3.187% 期日 01/17/2035			8,600	8,592

Stichting	Halcyon	Structured	Asset			
Management	European		CLO			
0.146%	期日	07/24/2023		EUR	2,832	3,308
Symphony			CLO Ltd.			
2.639%	期日	07/14/2026		USD	33,900	34,162
Telos			CLO Ltd.			
2.623%	期日	01/17/2027			17,200	17,236
THL Credit			Wind River CLO Ltd.			
2.809%	期日	01/15/2026			10,000	10,105
Tropic			CDO Ltd.			
1.478%	期日	07/15/2036			16,608	14,034
TruPS Financials			Note Securitization Ltd.			
0.000%	期日	09/20/2039			7,000	6,860
3.040%	期日	04/20/2038			6,658	6,658
Venture			CLO Ltd.			
2.439%	期日	07/15/2026			36,720	36,723
Vertical			Bridge CC LLC			
5.193%	期日	10/15/2046			395	400
WhiteHorse			Ltd.			
2.513%	期日	07/17/2026			3,800	3,800
WhiteHorse			Ltd.			
2.511%	期日	02/03/2025			6,232	6,258
Wood Street			CLO BV			
0.008%	期日	09/14/2023		EUR	5,300	6,177
Zoo			Abs 4 PLC			
0.091%	期日	11/10/2096			442	516
0.451%	期日	11/10/2096			5,470	6,242
1.601%	期日	11/10/2096			6,877	7,911
						<u>999,401</u>
						資産担保証券合計
						(原価：982,930米ドル)
ソブリン債						
3.1%			Abu Dhabi Government International Bond			
2.500%	期日	10/11/2022		USD	9,700	9,645
3.125%	期日	10/11/2027			30,800	30,435
4.125%	期日	10/11/2047			8,500	8,437
			Argentina Government International Bond			
2.260%	期日	12/31/2038		EUR	8,800	7,327
3.875%	期日	01/15/2022			9,800	11,843
5.000%	期日	01/15/2027			1,100	1,297
7.820%	期日	12/31/2033			18,165	24,376
23.743%	期日	04/03/2022		ARS	730,720	43,675
24.756%	期日	03/01/2020			25,700	1,596
			Argentina POM Politica Monetaria			
27.146%	期日	06/21/2020			466,146	29,154
			Autonomous Community of Catalonia			
4.750%	期日	06/04/2018		EUR	417	493
4.900%	期日	09/15/2021			1,350	1,657
4.950%	期日	02/11/2020			250	307
6.350%	期日	11/30/2041			250	313
			Corp. Andina de Fomento			
3.950%	期日	10/15/2021		MXN	700	36
			KSA Sukuk Ltd.			
2.894%	期日	04/20/2022		USD	5,200	5,213
3.628%	期日	04/20/2027			3,300	3,356
			Kuwait International Government Bond			
2.750%	期日	03/20/2022			4,460	4,507
3.500%	期日	03/20/2027			13,800	14,110
			Mexico Government International Bond			

	4.000% 期日 03/15/2115	EUR	200	219
	Peru Government International Bond			
	5.700% 期日 08/12/2024	PEN	13,000	4,252
	6.150% 期日 08/12/2032		35,505	11,485
	8.200% 期日 08/12/2026		12,400	4,687
	Russia Government International Bond			
	5.625% 期日 04/04/2042	USD	600	663
	Saudi Government International Bond			
	2.875% 期日 03/04/2023		8,200	8,175
	3.250% 期日 10/26/2026		1,000	985
	3.625% 期日 03/04/2028		9,200	9,143
	4.500% 期日 10/26/2046		6,200	6,224
	4.625% 期日 10/04/2047		11,000	11,280
	Sri Lanka Government International Bond			
	6.200% 期日 05/11/2027		800	852
	Venezuela Government International Bond			
	9.250% 期日 09/15/2027		3,319	1,236
	ソブリン債合計			256,978
	(原価：252,444米ドル)			
				株式数
普通株式	Caesars Entertainment Corp.		1,078,632	13,968
0.4%	Eurobank Ergasias S.A.		10,169,333	8,307
	National Bank of Greece S.A.		1,025,700	339
	Towergate Finance PLC		1,237,781	1,644
	VICI Properties, Inc.		537,058	9,936
	普通株式合計			34,194
	(原価：26,772米ドル)			
株式リンク証券	Dynegy, Inc.			
0.0%	02/02/2024		14,798	4
	Sequa Corp.			
	04/28/2024		42,000	15
	株絡み証券合計			19
	(原価：0米ドル)			
転換優先証券	VICI Properties, Inc.		22,919	1,828
0.0%	転換優先証券合計			1,828
	(原価：753米ドル)			
優先証券	Nationwide Building Society			
0.2%	10.250%		55,000	11,485
	Sequa Corp.		760	722
	Stichting AK Rabobank Certificaten			
	6.500%		17,310	2,537
	VICI Properties, Inc.		29,208	2,329
	優先証券合計			17,073
	(原価：15,151米ドル)			
短期証券	銀行引受手形			元本金額
7.9%	Bank of Montreal			
3.7%	1.191% 期日 11/14/2017	CAD	18,800	14,577
	1.207% 期日 11/22/2017		8,700	6,744
	1.219% 期日 11/30/2017		7,800	6,045
	1.228% 期日 11/27/2017		34,900	27,050
	Bank of Nova Scotia			
	1.181% 期日 12/01/2017		29,600	22,939
	1.238% 期日 12/04/2017		18,256	14,147
	1.264% 期日 11/27/2017		5,100	3,953

	1.273% 期日 12/29/2017		29,000	22,452
	Canadian Imperial Bank of Commerce			
	1.203% 期日 11/24/2017		47,200	36,587
	1.214% 期日 12/04/2017		65,100	50,446
	HSBC Bank Canada			
	(0.059%) 期日 11/21/2017		2,900	2,248
	1.252% 期日 12/01/2017		38,500	29,837
	1.280% 期日 11/06/2017		5,200	4,033
	Royal Bank of Canada			
	1.203% 期日 11/14/2017		10,200	7,909
	1.220% 期日 11/27/2017		41,300	32,011
	1.237% 期日 11/30/2017		3,200	2,480
	TD Bank			
	1.202% 期日 11/20/2017		26,900	20,854
				304,312
				304,312
定期預金証書	Barclays Bank PLC			
0.7%	1.781% 期日 03/16/2018	USD	4,000	4,005
	1.827% 期日 05/17/2018		44,800	44,840
	Mizuho Bank Ltd.			
	2.010% 期日 12/12/2017		6,800	6,806
				55,651
手形	Federal Home Loan Bank			
0.2%	1.037% 期日 11/17/2017		3,200	3,199
	Ford Motor Credit Co.			
	1.845% 期日 04/02/2018		9,000	8,933
	1.920% 期日 05/02/2018		2,900	2,874
				15,006
レボ取引				
2.8%				227,400
				227,400
定期性預金	ANZ National Bank			
0.2%	0.680% 期日 11/01/2017		13	13
	Bank of Nova Scotia			
	0.680% 期日 11/01/2017		1,097	1,097
	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.			
	(0.240%) 期日 11/01/2017	JPY	222,109	1,955
	Brown Brothers Harriman & Co.			
	(0.650%) 期日 11/01/2017	DKK	1,847	289
	(0.568%) 期日 11/01/2017	EUR	18	21
	(0.240%) 期日 11/01/2017	JPY	174	2
	0.050% 期日 11/01/2017	GBP	11	14
	0.680% 期日 11/01/2017	USD	2	2
	0.741% 期日 11/01/2017	AUD	19	15
	7.250% 期日 11/01/2017	ZAR	30	2
	Citibank N.A.			
	0.680% 期日 11/01/2017	USD	1,357	1,357
	DBS Bank Ltd.			
	0.680% 期日 11/01/2017		1,607	1,607
	Deutsche Bank AG			
	(0.568%) 期日 11/01/2017	EUR	3,305	3,850
	0.680% 期日 11/01/2017	USD	1,008	1,008
	DnB NORBank ASA			
	0.680% 期日 11/01/2017		370	370

HSBC Bank				
0.050%	期日 11/01/2017	GBP	638	848
JPMorgan Chase & Co.				
0.680%	期日 11/01/2017	USD	2,732	2,732
National Australia Bank Ltd.				
0.741%	期日 11/01/2017	AUD	1,556	1,193
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
(0.568%)	期日 11/01/2017	EUR	199	231
(0.240%)	期日 11/01/2017	JPY	54	0
Wells Fargo Bank				
0.680%	期日 11/01/2017	USD	2,741	2,741
7.250%	期日 11/01/2017	ZAR	41	3
				19,350
アルゼンチン				
短期国債	2.780% 期日 03/16/2018	USD	5,800	5,737
0.3%	2.780% 期日 09/28/2018		10,100	9,820
	2.825% 期日 01/26/2018		5,747	5,709
	2.850% 期日 02/09/2018		1,308	1,298
	3.163% 期日 12/15/2017		3,446	3,435
				25,999
短期証券合計				647,718
(原価：653,958米ドル)				
投資有価証券合計 104.7%				8,602,680
(原価：8,447,486米ドル)				
金融デリバティブ商品 (0.1%)				(5,258)
(原価またはプレミアム(純額)(28,196)米ドル)				
その他の資産および負債(純額)(4.6%)				(380,513)
純資産 100.0%				8,216,909

## 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30年 5月14日現在)	(平成30年11月14日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	20,220,580
コール・ローン	20,528,709	-
特殊債券	69,659,350	69,385,560
未収利息	216,060	231,726
前払費用	67,955	-
流動資産合計	90,472,074	89,837,866
資産合計	90,472,074	89,837,866
負債の部		
流動負債		
未払利息	33	-
その他未払費用	2,081	1,829
流動負債合計	2,114	1,829
負債合計	2,114	1,829
純資産の部		
元本等		
元本	90,260,179	89,650,363
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	209,781	185,674

	（平成30年 5月14日現在）	（平成30年11月14日現在）
元本等合計	90,469,960	89,836,037
純資産合計	90,469,960	89,836,037
負債純資産合計	90,472,074	89,837,866

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 5月15日 至 平成30年11月14日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 5月14日現在）	（平成30年11月14日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	90,260,179口	89,650,363口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0023円 (10,000口当たりの純資産額 10,023円)	1口当たり純資産額 1.0021円 (10,000口当たりの純資産額 10,021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30年11月14日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	(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30年 5月14日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	137,153,307円
同期中における追加設定元本額	19,944円
同期中における一部解約元本額	46,913,072円
平成30年 5月14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・ブラジルレアル	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
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
高成長インド・中型株式ファンド(年1回決算型)	9,974円
合計	90,260,179円

## (平成30年11月14日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	90,260,179円
同期中における追加設定元本額	76,811,023円
同期中における一部解約元本額	77,420,839円
平成30年11月14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)	8,495,310円
日興ワールドC Bファンド(円ヘッジありコース)	2,445,519円
日興ワールドC Bファンド(円ヘッジなしコース)	1,548,154円
インド内需関連株式ファンド	119,759円
高成長インド・中型株式ファンド	17,711,132円
アジア好利回りリート・ファンド	99,971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)	7,742,960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)	1,337,053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)	4,909,194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)	1,456,790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)	14,208,735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)	1,237,272円
三井住友・ニュー・アジア・ファンド	369,177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)	1,187,376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)	389,132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)	209,527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)	179,593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)	289,352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)	419,066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)	4,140,881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)	11,065,647円
グローイング・フロンティア株式ファンド	2,185,185円

高成長インド・中型株式ファンド(年1回決算型)	7,882,655円
合計	89,650,363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

2018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	60,000,000株
発行済株式総数	17,640,000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。

2018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。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	461	5,871,209
単位型株式投資信託	91	389,325
追加型公社債投資信託	1	29,051
単位型公社債投資信託	112	301,391
合計	665	6,590,976

## (3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 三井住友アセットマネジメント株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

(ロ) 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。

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33期(平成29年4月1日から平成30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34期中間会計期間(平成30年4月1日から平成30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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託	20,008	20,010
前払費用	351,526	402,249
未収入金	40,544	39,030
未収委託者報酬	5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬	1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬	343,523	316,407
未収収益	20,789	50,321
繰延税金資産	482,535	715,988
その他の流動資産	5,560	10,891
流動資産合計	21,352,691	30,486,188
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	198,767	185,371
器具備品	261,096	300,694
有形固定資産合計	459,864	486,065
無形固定資産		
ソフトウェア	493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定	141,025	5,755
電話加入権	68	56
商標権	3	-
無形固定資産合計	634,903	415,576
投資その他の資産		
投資有価証券	12,098,372	10,616,594
関係会社株式	10,412,523	10,412,523
長期差入保証金	677,681	658,505
長期前払費用	61,282	69,423
会員権	7,819	7,819

繰延税金資産	871,577	678,459
投資その他の資産合計	24,129,257	22,443,325
固定資産合計	25,224,025	23,344,968
資産合計	46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
<b>未払費用</b>		
未払消費税等	2,564,625	3,433,641
未払法人税等	160,571	547,706
賞与引当金	661,467	1,785,341
その他の流動負債	1,001,068	1,507,256
	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
<b>その他利益剰余金</b>		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		31,628,014		36,538,981
運用受託報酬		5,649,190		8,362,118
投資助言報酬		1,726,511		1,440,233
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
サービス支援手数料		61,268		128,324
その他		54,261		55,820
営業収益計		39,124,246		46,530,479
営業費用				
支払手数料		14,908,517		16,961,384
広告宣伝費		366,227		353,971
公告費		1,140		1,140
調査費				
調査費		1,325,978		1,654,233
委託調査費		4,343,104		5,972,473
営業雑経費				
通信費		46,030		40,066
印刷費		338,254		339,048
協会費		21,669		-
諸会費		20,054		45,465
情報機器関連費		2,516,497		2,582,734
販売促進費		24,896		34,333
その他		149,177		136,669
営業費用合計		24,061,549		28,121,520
一般管理費				
給料				
役員報酬		225,885		196,529
給料・手当		6,121,741		6,190,716
賞与		610,533		601,375
賞与引当金繰入額		989,925		1,566,810
交際費		23,136		25,709
事務委託費		317,928		256,413
旅費交通費		229,248		220,569
租税公課		268,527		282,036
不動産賃借料		622,662		654,286
退職給付費用		423,954		419,884
固定資産減価償却費		384,068		329,756
諸経費		335,840		285,490
一般管理費合計		10,553,451		11,029,580
営業利益		4,509,246		7,379,378
営業外収益				
受取配当金	1	106,651		51,335
受取利息	1	745		520

時効成立分配金・償還金		1,721	2,622
原稿・講演料		1,474	894
雑収入		12,592	10,669
営業外収益合計		123,184	66,042
営業外費用			
為替差損		9,737	5,125
雑損失		1,084	913
営業外費用合計		10,821	6,038
経常利益		4,621,608	7,439,383
特別利益			
投資有価証券償還益		353,462	61,842
投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
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		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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	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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

	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
当期変動額			
剰余金の配当			1,887,480
当期純利益			4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

## [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。

## (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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	291,976千円	312,784千円
器具備品	651,918千円	768,929千円

### 2 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30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
借入金実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

### 3 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	256,031千円	204,923千円

(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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
受取配当金	106,640千円	- 千円
受取利息	18千円	- 千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	6,952千円	- 千円
器具備品	1,204千円	0 千円
ソフトウェア	- 千円	9,000千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	345,695千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自平成29年4月1日 至平成30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

## (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30年6月26日開催の第33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30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

## (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	-

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

（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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
其他有価証券 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

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

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

(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	-	-

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

(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。

当事業年度(平成30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。

当事業年度(平成30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	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(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	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

(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. 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

当事業年度(自平成29年4月1日 至平成30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
532,099	30,980	9,634

(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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,028,212	3,177,131
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の発生額	15,494	51,212
退職給付の支払額	116,111	94,727
退職給付債務の期末残高	3,177,131	3,319,830

## (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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,177,131	3,319,830
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	3,177,131	3,319,830

## (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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の費用処理額	15,494	51,212
その他	158,924	182,458
確定給付制度に係る退職給付費用	423,954	419,884

(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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	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137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

## (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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		

賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.1	-
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	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	2.2	1.9
その他	0.0	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9	29.4

(セグメント情報等)

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

### (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	SumitomoMitsui AssetManagement (HongKong)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	㈱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㈱	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. ㈱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㈱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)

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 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	㈱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	2,761,066	未払手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	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	5,685,815	未払手数料	953,752

(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

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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,519,223	4,955,483
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	3,519,223	4,955,483
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

## (重要な後発事象)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)
----------------------------

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,085,678
顧客分別金信託		20,010
前払費用		414,616
未収委託者報酬		7,225,367
未収運用受託報酬		1,541,190
未収投資助言報酬		306,565
未収収益		51,614
その他		53,465
流動資産合計		28,698,508
固定資産		
有形固定資産	1	508,186
無形固定資産		437,397
投資その他の資産		
投資有価証券		9,519,317
関係会社株式		10,412,523
繰延税金資産		1,364,662
その他		1,500,406
投資その他の資産合計		22,796,910
固定資産合計		23,742,493
資産合計		52,441,002
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		649
その他の預り金		116,730
未払金		3,491,463
未払費用		3,428,351
未払法人税等		1,080,277
前受収益		8,509
賞与引当金		1,233,571
その他	2	228,340
流動負債合計		9,587,893
固定負債		
退職給付引当金		3,435,254
賞与引当金		41,631
その他		1,383
固定負債合計		3,478,268
負債合計		13,066,162
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	26,222,740
利益剰余金合計	28,043,944
株主資本合計	38,672,928
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	701,911
評価・換算差額等合計	701,911
純資産合計	39,374,840
負債純資産合計	52,441,002

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			20,003,107
運用受託報酬			3,216,910
投資助言報酬			696,543
その他の営業収益			117,677
営業収益計			24,034,239
営業費用			15,495,987
一般管理費	1		5,200,633
営業利益			3,337,618
営業外収益	2		13,622
営業外費用	3		10,296
経常利益			3,340,944
特別利益	4		293,441
特別損失	5		35,355
税引前中間純利益			3,599,031
法人税、住民税及び事業税			1,010,764
法人税等調整額			104,205
法人税等合計			1,114,969
中間純利益			2,484,061

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,822,400	2,822,400	2,822,400
中間純利益							2,484,061	2,484,061	2,484,061
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	-	-	-	-	-	-	338,338	338,338	338,338
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,222,740	28,043,944	38,672,928

	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	870,535	870,535	39,881,802
当中間期変動額			
剰余金の配当			2,822,400
中間純利益			2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	168,624	168,624	168,624
当中間期変動額合計	168,624	168,624	506,962
当中間期末残高	701,911	701,911	39,374,840

## 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

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。

（表示方法の変更）

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

（中間貸借対照表関係）

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	1,162,157千円
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、金額の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198,989千円の支払保証を行っております。	

（中間損益計算書関係）

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
1. 減価償却実施額 有形固定資産 80,772千円 無形固定資産 84,457千円	
2. 営業外収益のうち主要なもの 雑益 13,281千円	
3. 営業外費用のうち主要なもの 為替差損 10,293千円	
4. 特別利益のうち主要なもの 投資有価証券償還益 289,451千円 投資有価証券売却益 3,990千円	
5. 特別損失のうち主要なもの 合併関連費用 23,103千円 合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等 あります。 投資有価証券売却損 12,101千円	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30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30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

## (リース取引関係)

第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30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	595,231千円
1年超	3,853,814千円
合 計	4,449,045千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第34期中間会計期間(平成30年9月30日)

平成30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	19,085,678	19,085,678	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	7,225,367	7,225,367	-
(4)未収運用受託報酬	1,541,190	1,541,190	-
(5)未収投資助言報酬	306,565	306,565	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	9,519,019	9,519,019	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	1,434,365	1,434,365	-
資産計	39,132,197	39,132,197	-
(1)顧客からの預り金	649	649	-
(2)未払金			
未払手数料	3,310,988	3,310,988	-
負債計	3,311,637	3,311,637	-

## (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)



区分	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34期中間会計期間（平成30年9月30日）

1. 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、記載していません。

2. その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの 投資信託等	6,621,299	5,533,700	1,087,599
小計	6,621,299	5,533,700	1,087,599
(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	2,897,719	2,973,628	75,908
小計	2,897,719	2,973,628	75,908
合計	9,519,019	8,507,328	1,011,691

（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、記載していません。

（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34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30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	20,003,107	3,216,910	696,543	117,677	24,034,239

(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34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,232円13銭
1株当たり中間純利益	140円81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>	
<p>(注) 当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、当事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益を算定しております。</p>	
<p>1株当たり純資産額の算定上の基礎</p>	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	39,374,840千円
普通株式に係る純資産額	39,374,840千円
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	17,640,000株
<p>1株当たり中間純利益の算定上の基礎</p>	
中間損益計算書上の中間純利益	2,484,061千円
普通株式に係る中間純利益	2,484,061千円
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
1株当たり中間純利益の算定に用いられた普通株式の期中平均株式数	17,640,000株

## (追加情報)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間での合併契約の締結について

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社(以下「大和住銀」と)の間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。また、平成30年10月31日に当社臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ております。

## 1. 企業結合の概要

## (1) 被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社  
事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

## (2) 企業結合を行う主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化し

ております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

### (3)企業結合日

平成31年4月1日(予定)

### (4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀を消滅会社とする吸収合併方式であります。

### (5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

### (6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方にに基づき、当社を取得企業としております。

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

### (1)合併比率

大和住銀の普通株式1株に対し、当社の普通株式4.2156株を割当て交付いたします。

### (2)合併比率の算定方法

当社はEYトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀はPwCアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であるとの判断し、合意に至ったものであります。

### (3)交付予定の株式数

普通株式：16,230,060株

## (重要な後発事象)

### 株式分割

当社は、平成30年9月28日開催の取締役会決議に基づき、平成30年11月1日付で株式分割を行っております。

### 1. 株式分割の目的

合併に伴い株主の議決権割合が変更となる見込みであり、円滑に変更手続きを行うために株式分割を行っております。

### 2. 株式分割の概要

#### (1)分割の方法

平成30年10月31日を基準日として、同日最終の株主名簿に記載された株主の所有する普通株式1株につき、1,000株の割合をもって分割しております。

#### (2)分割により増加した株式数

株式分割前の発行済株式総数	17,640株
今回の分割により増加した株式数	17,622,360株
株式分割後の発行済株式数	17,640,000株
株式分割後の発行可能株式総数	60,000,000株

#### (3)株式分割の日程

基準日公告日	平成30年10月12日
基準日	平成30年10月31日
効力発生日	平成30年11月1日

## (4) 1 株当たり情報に及ぼす影響

1 株当たり情報に及ぼす影響については、当該箇所に記載しております。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月14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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付で会社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主が、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年11月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員  
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、「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30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30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な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30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30年4月1日から平成30年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**強調事項**

追加情報に記載されているとおり、会社は、平成30年9月28日開催の会社の取締役会において、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結した。また、平成30年10月31日に会社の臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ている。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

(注) 1. 上記は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30年12月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 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30年5月15日から平成30年11月14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30年11月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年5月15日から平成30年11月14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30年12月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 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30年5月15日から平成30年11月14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30年11月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(平成30年5月15日から平成30年11月14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。