

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和2年2月6日提出
【計算期間】	第6期中(自 令和1年5月14日至 令和1年11月13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D S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】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0784
【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)

2019年11月29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	39,700,214,598	99.38
親投資信託受益証券	日本	7,754,574	0.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		241,059,417	0.60
合計(純資産総額)		39,949,028,589	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)

2019年11月29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	6,504,920,468	99.22
親投資信託受益証券	日本	1,339,058	0.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		50,064,933	0.76
合計(純資産総額)		6,556,324,459	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5期 (2019年 5月13日)	47,323,141,148	47,323,141,148	11,031	11,031
2018年11月末日	50,401,427,859		10,680	
12月末日	48,806,931,781		10,681	
2019年 1月末日	48,345,015,025		10,849	
2月末日	47,389,881,052		10,914	
3月末日	47,191,911,866		10,975	
4月末日	47,309,213,956		11,023	

5月末日	46,219,838,859		11,050	
6月末日	45,435,247,395		11,172	
7月末日	45,004,124,487		11,176	
8月末日	43,699,083,902		11,077	
9月末日	42,547,806,520		11,100	
10月末日	41,000,314,580		11,130	
11月末日	39,949,028,589		11,130	

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5期 (2019年 5月13日)	8,895,682,172	8,895,682,172	12,740	12,740
2018年11月末日	8,997,223,021		12,580	
12月末日	8,803,010,375		12,336	
2019年 1月末日	8,797,219,818		12,427	
2月末日	9,039,070,989		12,676	
3月末日	9,092,356,707		12,739	
4月末日	9,030,689,280		12,925	
5月末日	8,706,423,395		12,809	
6月末日	8,076,827,518		12,738	
7月末日	7,919,721,232		12,874	
8月末日	7,527,795,007		12,537	
9月末日	7,465,431,572		12,789	
10月末日	6,797,138,382		12,935	
11月末日	6,556,324,459		13,019	

【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5期	2018年 5月15日 ~ 2019年 5月13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5期	2018年 5月15日 ~ 2019年 5月13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5期	1.5
第6期(中間期)	1.0

(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5期	4.5
第6期(中間期)	1.9

(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5期	4,608,346,151	15,564,471,171
第6期(中間期)	1,786,601,685	8,224,016,124

(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5期	2,294,676,442	3,600,666,484
第6期(中間期)	270,380,821	2,121,958,649

(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6期中間計算期間(令和 1年 5月 14日から令和 1年11月13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5期 (令和1年5月13日現在)	第6期中間計算期間 (令和1年11月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	902,004,796
コール・ローン	1,060,346,889	-
投資信託受益証券	46,752,689,494	40,181,665,108
親投資信託受益証券	7,756,897	7,754,574
流動資産合計	47,820,793,280	41,091,424,478
資産合計	47,820,793,280	41,091,424,478
負債の部		
流動負債		
未払解約金	63,632,357	79,395,785
未払受託者報酬	7,726,149	7,222,363
未払委託者報酬	424,937,607	397,229,966
未払利息	2,539	-
その他未払費用	1,353,480	1,227,503
流動負債合計	497,652,132	485,075,617
負債合計	497,652,132	485,075,617
純資産の部		
元本等		
元本	42,900,717,501	36,463,303,062
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,422,423,647	4,143,045,799
元本等合計	47,323,141,148	40,606,348,861
純資産合計	47,323,141,148	40,606,348,861
負債純資産合計	47,820,793,280	41,091,424,478

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	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	第6期中間計算期間 自 令和 1年 5月14日 至 令和 1年11月13日
営業収益		
受取配当金	1,444,263,251	905,956,190
有価証券売買等損益	1,739,324,098	68,233,207
その他収益	-	925,866
営業収益合計	295,060,847	838,648,849
営業費用		
支払利息	190,223	184,740
受託者報酬	9,221,036	7,222,363
委託者報酬	507,157,050	397,229,966
その他費用	1,708,862	1,286,619
営業費用合計	518,277,171	405,923,688
営業利益又は営業損失（ ）	813,338,018	432,725,161
経常利益又は経常損失（ ）	813,338,018	432,725,161
中間純利益又は中間純損失（ ）	813,338,018	432,725,161
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（ ）	71,043,886	66,397,509
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,680,861,712	4,422,423,647
剰余金増加額又は欠損金減少額	193,729,668	204,378,713
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	193,729,668	204,378,713
剰余金減少額又は欠損金増加額	694,029,235	850,084,213
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	694,029,235	850,084,213
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（ ）	3,438,268,013	4,143,045,799

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第6期中間計算期間	
	自 令和 1年 5月14日	至 令和 1年11月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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。 (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。 (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。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、令和 1年 5月14日から令和 1年11月13日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第5期		第6期中間計算期間	
	(令和 1年 5月13日現在)		(令和 1年11月13日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	42,900,717,501口		36,463,303,062口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.1031円	1口当たり純資産額	1.1136円
	(10,000口当たりの純資産額)	11,031円)	(10,000口当たりの純資産額)	11,136円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期中間計算期間	第6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	自令和1年5月14日 至令和1年11月13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 184,298,871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 144,723,036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6期中間計算期間 (令和1年11月13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5期 (令和1年5月13日現在)	第6期中間計算期間 (令和1年11月13日現在)
期首元本額	53,856,842,521円	42,900,717,501円
期中追加設定元本額	4,608,346,151円	1,786,601,685円
期中一部解約元本額	15,564,471,171円	8,224,016,124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5期 （令和 1年 5月13日現在）	第6期中間計算期間 （令和 1年11月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	153,207,988
コール・ローン	225,777,939	-
投資信託受益証券	8,721,961,248	6,599,902,530
親投資信託受益証券	1,339,459	1,339,058
未収入金	88,589,856	-
流動資産合計	9,037,668,502	6,754,449,576
資産合計		
	9,037,668,502	6,754,449,576
負債の部		
流動負債		
未払解約金	61,285,452	20,759,338
未払受託者報酬	1,436,491	1,270,437
未払委託者報酬	79,006,968	69,873,553
未払利息	540	-
その他未払費用	256,879	216,311
流動負債合計	141,986,330	92,119,639
負債合計		
	141,986,330	92,119,639
純資産の部		
元本等		
元本	6,982,378,085	5,130,800,257
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,913,304,087	1,531,529,680
元本等合計	8,895,682,172	6,662,329,937
純資産合計		
	8,895,682,172	6,662,329,937
負債純資産合計		
	9,037,668,502	6,754,449,576

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第6期中間計算期間 自 令和 1年 5月14日 至 令和 1年11月13日
営業収益		
受取配当金	357,232,523	263,856,207
有価証券売買等損益	113,669,874	55,573,399
営業収益合計	470,902,397	208,282,808
営業費用		
支払利息	34,826	40,374
受託者報酬	1,619,534	1,270,437
委託者報酬	89,074,705	69,873,553
その他費用	305,122	228,291
営業費用合計	91,034,187	71,412,655
営業利益又は営業損失（ ）	379,868,210	136,870,153
経常利益又は経常損失（ ）	379,868,210	136,870,153
中間純利益又は中間純損失（ ）	379,868,210	136,870,153
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（ ）	49,955,607	10,982,315
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,818,350,526	1,913,304,087
剰余金増加額又は欠損金減少額	242,607,431	73,702,816
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	242,607,431	73,702,816
剰余金減少額又は欠損金増加額	436,773,991	581,365,061
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	436,773,991	581,365,061
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（ ）	1,954,096,569	1,531,529,680

（ 3 ）【中間注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第6期中間計算期間	
	自 令和 1年 5月14日	至 令和 1年11月13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、令和 1年 5月14日から令和 1年11月13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5期		第6期中間計算期間	
	（ 令和 1年 5月13日現在 ）		（ 令和 1年11月13日現在 ）	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	6,982,378,085口		5,130,800,257口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2740円	1口当たり純資産額	1.2985円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,740円)	(10,000口当たりの純資産額)	12,985円)

（ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第5期中間計算期間	第6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	自 令和 1年 5月14日 至 令和 1年11月13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 32,375,926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 25,438,196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6期中間計算期間 (令和 1年11月13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5期 (令和 1年 5月13日現在)	第6期中間計算期間 (令和 1年11月13日現在)
期首元本額	8,288,368,127円	6,982,378,085円
期中追加設定元本額	2,294,676,442円	270,380,821円
期中一部解約元本額	3,600,666,484円	2,121,958,649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(2018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	469,274
関連ファンドに対する投資	11,369,772
金融デリバティブ商品	
OTC取引	32,486
現金	738
投資有価証券売却による未収入金	3,225
関連ファンド売却による未収入金	12,377
ファンド持分追加設定による未収入金	49,362
未収利息および未収配当金	69
	<hr/>
	11,937,303

負債：

金融デリバティブ商品	
OTC取引	44,572
投資有価証券購入による未払金	3,967
関連ファンド購入による未払金	28,903
未払利息	89
カウンターパーティー預り金	7,667
ファンド持分一部解約による未払金	32,760
未払管理手数料	28
未払顧問費用	178
未払管理事務代行費	44
未払販売手数料	24
	<hr/>
	118,232

純資産

11,819,071

投資有価証券(原価)

469,269

関連ファンドに対する投資(原価)

11,245,387

純資産：

Jクラス(円)	751,680
Jクラス(米ドル)	169,004

発行済口数:

Jクラス(円)	9,081
Jクラス(米ドル)	1,808

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)	82.77
(NAV報告通貨建て:円)	9,341
Jクラス(米ドル)	
(機能通貨建て:米ドル)	93.48
(NAV報告通貨建て:円)	10,550

投資明細表(2018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	定期性預金				
4.0%	4.0%	3.3%			
	Bank of Nova Scotia				
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	11,799	USD	11,799
	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.				
	(0.300%) 期日 11/01/2018	JPY	9		0
	Brown Brothers Harriman & Co.				
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	61		61
	Citibank N.A.				
	1.690% 期日 11/01/2018		49,184		49,184
	DBS Bank Ltd.				
	1.690% 期日 11/01/2018		12,667		12,667
	JPMorgan Chase & Co.				
	1.690% 期日 11/01/2018		104,599		104,599
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
	(0.300%) 期日 11/01/2018	JPY	2		0
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	120,371		120,371
	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
	(0.300%) 期日 11/01/2018	JPY	8		0
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	93,517		93,517
					392,198
	米国短期国債				
	2.249% 期日 01/10/2019		23,255		23,155
	0.7%				
	2.299% 期日 01/24/2019		50,968		50,700
	2.304% 期日 01/31/2019		3,240		3,221
					77,076
	短期証券合計				469,274
	(原価: 469,269米ドル)				
	投資有価証券合計				469,274
	(原価: 469,269米ドル)				
関連ファンド	ミューチュア				
に対する投資	ル・ファンド				
96.2%	96.2%				
	PIMCO Bermuda Income Fund (M)				
	(原価: 11,245,387米ドル)		889,654		11,369,772
	関連ファンドに対する投資合計				11,369,772
	(原価: 11,245,387米ドル)				
	投資合計 100.2%			USD	11,839,046
	(原価: 11,714,656米ドル)				
	金融デリバティブ商品(0.1%)				(12,086)
	(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)				(7,889)
	(0.1%)				
	純資産 100.0%			USD	11,819,071

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(2018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*	13,026,164
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	9,212
OTC取引	122,358
現金	33
カウンターパーティー預け金	42,056
外国通貨(時価)	4,618
投資有価証券売却による未収入金	41,024
TBA売却による未収入金	1,858,850
ファンド持分追加設定による未収入金	28,903
未収利息および未収配当金	62,334
	<u>15,195,552</u>

負債：

借入金およびその他の金融取引	
買い現先による未払金	262,824
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	18,693
OTC取引	50,937
投資有価証券購入による未払金	172,959
TBA購入による未払金	2,792,221
未払利息	84
カウンターパーティー預り金	96,618
ファンド持分一部解約による未払金	12,437
未払税金	263
	<u>3,407,036</u>

純資産

11,788,516

投資有価証券(原価)

13,230,824

外国通貨(原価)

4,643

金融デリバティブ商品による収益又は費用(純額)

(44,560)

*レポ取引を含む：

157,400

投資明細表(2018年10月31日現在)

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)		通貨
投資有価証券	銀行ローン債権	Accudyne Industries				
		Borrower S.C.A.				
110.5%	5.5%	5.302% 期日 08/18/2024	USD	537	USD	536
		Air Medical Group				
		Holdings, Inc.				
		6.530% 期日 03/14/2025		993		977

Alphabet Holding Co., Inc. 5.802% 期日 09/26/2024	495	474
Altica France S.A. 6.280% 期日 08/14/2026	5,400	5,335
Altran Technologies 2.750% 期日 03/20/2025 EUR	2,789	3,175
American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 4.302% 期日 10/31/2023 USD	1,679	1,666
Ancestry.com Operations, Inc. 5.550% 期日 10/19/2023	1,177	1,181
Aramark Intermediate HoldCo Corp. 4.052% 期日 03/11/2025	933	935
Avantor, Inc. 6.302% 期日 11/21/2024	684	689
Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC 4.280% 期日 01/15/2025	42,148	42,087
AWAS Leasing 2011- Ltd. 4.870% 期日 10/02/2021	633	632
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 4.136% 期日 06/01/2024	468	467
Bausch Health Co., Inc. 5.274% 期日 06/01/2025	461	462
Beacon Roofing Supply, Inc. 4.527% 期日 01/02/2025	1,104	1,096
BWay Holdings Co. 5.658% 期日 04/03/2024	385	383
Caesars Resort Collection LLC 5.052% 期日 12/22/2024	5,344	5,352
Camelot U.S. Acquisition 1 Co. 5.552% 期日 10/03/2023	192	192
Castlelake Aircraft Structured Trust 3.967% 期日 07/12/2024	3,359	3,312
Ceasers Entertainment Operating Co. LLC 4.302% 期日 10/06/2024	2,303	2,294
CenturyLink, Inc. 5.052% 期日 01/31/2025	2,006	1,985
CH Hold Corp. 5.302% 期日 02/01/2024	294	295
Charter Communications Operating LLC 4.310% 期日 04/30/2025	5,610	5,617
CityCenter Holdings LLC 4.552% 期日 04/18/2024	296	296
Community Health Systems, Inc. 5.563% 期日 01/27/2021	26,707	26,217
Concordia International Corp. 7.781% 期日 09/06/2024	3,400	3,341
Crown Holdings, Inc. 4.283% 期日 04/03/2025	763	766

CSC Holdings LLC			
4.780% 期日 01/25/2026		2,886	2,895
DaVita, Inc.			
5.052% 期日 06/24/2021		192	192
Dell International LLC			
4.310% 期日 09/07/2023		2,814	2,813
Diamond Resorts International, Inc.			
6.052% 期日 09/02/2023		3,942	3,848
Dubai World			
2.000% 期日 09/30/2022		20,315	19,045
Energizer Holdings, Inc.			
7.353% 期日 05/18/2019		2,700	2,703
Envision Healthcare Corp.			
6.052% 期日 10/10/2025		9,100	8,930
FCA US LLC			
4.300% 期日 12/31/2018		758	759
Financial & Risk U.S. Holdings, Inc.			
4.000% 期日 10/01/2025	EUR	15,000	17,096
6.052% 期日 10/01/2025	USD	11,300	11,215
First Data Corp.			
4.287% 期日 07/08/2022		2,629	2,626
Forest City Enterprises LP			
6.199% 期日 10/24/2025		2,200	2,212
Frontier Communications Corp.			
6.060% 期日 06/15/2024		7,425	7,202
Genworth Holdings, Inc.			
6.831% 期日 03/07/2023		398	407
Golden Nugget, Inc.			
5.052% 期日 10/04/2023		1	1
5.186% 期日 10/04/2023		13	13
5.277% 期日 10/04/2023		15	16
GreenSky Holdings LLC			
5.563% 期日 03/31/2025		4,876	4,900
HCA, Inc.			
4.052% 期日 03/18/2023		826	831
4.302% 期日 03/13/2025		2,976	2,994
HD Supply Waterworks Ltd.			
5.313% 期日 08/01/2024		317	317
Hilton Worldwide Finance LLC			
4.031% 期日 10/25/2023		10,682	10,703
iHeartCommunications, Inc.			
8.443% 期日 01/30/2019		45,625	33,183
9.802% 期日 07/30/2019		6,200	4,499
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
6.045% 期日 11/27/2023		3,800	3,805
6.625% 期日 01/02/2024		10,100	10,388
Iqvia, Inc.			
4.386% 期日 01/17/2025		10,098	10,128
IRB Holdings Corp.			
5.460% 期日 02/05/2025		697	697
KFC Holding Co.			
4.037% 期日 04/03/2025		1,078	1,080
Kinetic Concepts, Inc.			
5.636% 期日 02/02/2024		9,381	9,427
Klockner Pentaplast of America, Inc.			
4.750% 期日 06/30/2022	EUR	300	323

Las Vegas Sands LLC				
4.052% 期日 03/27/2025	USD	2,574		2,568
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
4.552% 期日 08/29/2025		1,300		1,307
McDermott International, Inc.				
7.302% 期日 05/10/2025		2,832		2,812
Meredith Corp.				
5.052% 期日 01/31/2025		975		975
Messer Industries LLC				
4.834% 期日 10/01/2025		2,120		2,123
MGM Growth Properties Operating Partnership LP				
4.302% 期日 03/21/2025		605		603
MH Sub LLC				
6.030% 期日 09/13/2024		1,000		1,005
Mission Broadcasting, Inc.				
4.544% 期日 01/17/2024		63		64
Multi-Color Corp.				
4.302% 期日 10/31/2024		174		175
Neiman Marcus Group Ltd. LLC				
5.531% 期日 10/25/2020		11,822		10,786
Nexstar Broadcasting, Inc.				
4.544% 期日 01/17/2024		396		397
Nielsen Finance LLC				
4.281% 期日 10/04/2023		394		392
Ocean Rig UDW, Inc.				
8.000% 期日 09/20/2024		6,693		7,044
Parexel International Corp.				
5.052% 期日 09/27/2024		396		391
PetSmart, Inc.				
5.280% 期日 03/11/2022		4,865		4,138
Pisces Midco, Inc.				
6.175% 期日 04/12/2025		5,161		5,149
Post Holdings, Inc.				
4.290% 期日 05/24/2024		876		876
Prestige Brands, Inc.				
4.302% 期日 01/26/2024		60		60
Republic of Tanzania				
7.839% 期日 12/10/2019		2,600		2,551
Reynolds Group Holdings, Inc.				
5.052% 期日 02/05/2023		196		196
RPI Finance Trust				
4.386% 期日 03/27/2023		7,018		7,033
SBA Senior Finance II LLC				
4.310% 期日 04/11/2025		499		498
Sequa Mezzanine Holdings LLC				
7.389% 期日 11/28/2021		31		31
7.408% 期日 11/28/2021		12,498		12,333
11.520% 期日 04/28/2022		650		644
Serta Simmons Bedding LLC				
5.774% 期日 11/08/2023		197		179
Sigma Holdco BV				
3.500% 期日 07/02/2025	EUR	5,300		6,013
Sprint Communications, Inc.				
4.813% 期日 02/02/2024	USD	4,142		4,140

	SS&C Technologies Holdings, Inc.				
	4.552% 期日 04/16/2025		8,567		8,535
	Starfruit Finco BV				
	3.750% 期日 10/01/2025	EUR	3,800		4,347
	5.506% 期日 10/01/2025	USD	4,900		4,898
	State of Rio De Janeiro				
	6.024% 期日 12/20/2020		6,716		6,531
	Syniverse Holdings, Inc.				
	7.280% 期日 03/09/2023		746		750
	TerraForm Power Operating LLC				
	4.302% 期日 11/08/2022		199		199
	Traverse Midstream Partners LLC				
	6.600% 期日 09/27/2024		234		236
	Tronox Blocked Borrower LLC				
	5.302% 期日 09/23/2024		135		135
	Tronox Finance LLC				
	5.302% 期日 09/23/2024		361		361
	Unitymedia Finance LLC				
	4.530% 期日 01/15/2026		1,000		1,000
	Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG				
	2.750% 期日 01/15/2027	EUR	2,900		3,306
	Univision Communications, Inc.				
	5.052% 期日 03/15/2024	USD	26,641		25,603
	Vertiv Group Corp.				
	6.313% 期日 11/30/2023		251		248
	VICI Properties 1 LLC				
	4.280% 期日 12/20/2024		3,627		3,623
	Vistra Operations Co. LLC				
	4.302% 期日 08/04/2023		425		427
	4.552% 期日 12/14/2023		444		445
	West Corp.				
	6.302% 期日 10/10/2024		1		1
	6.527% 期日 10/10/2024		212		212
	Westmoreland Coal Co.				
	10.562% 期日 05/21/2019		153		156
	WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL				
	4.246% 期日 07/21/2025		79,000		79,077
	4.850% 期日 02/09/2021		45,000		45,079
	WHOLE LOAN ST REGIS ASPEN				
	3.200% 期日 07/09/2020		99,000		99,158
	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.				
	4.052% 期日 05/30/2025		2,500		2,502
	銀行貸付債権証券合計				646,322
	(原価：658,315米ドル)				
社債券等	銀行および金融	ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC			
33.0%	20.4%	2.626% 期日 04/28/2020	EUR	3,028	3,432
		ABN AMRO Bank NV			
		1.800% 期日 09/20/2019	USD	200	198
		2.450% 期日 06/04/2020		5,900	5,828
		ADLER Real Estate AG			
		1.875% 期日 04/27/2023	EUR	2,900	3,193
		3.000% 期日 04/27/2026		2,900	3,188

AerCap Ireland Capital DAC						
3.500%	期日	05/26/2022	USD	150		146
3.750%	期日	05/15/2019		1,850		1,854
4.250%	期日	07/01/2020		1,405		1,414
4.500%	期日	05/15/2021		650		657
4.625%	期日	10/30/2020		4,000		4,063
5.000%	期日	10/01/2021		1,300		1,335
AGFC Capital Trust						
4.186%	期日	01/15/2067		2,200		1,155
Air Lease Corp.						
3.250%	期日	03/01/2025		37,900		35,227
Akelius Residential Property AB						
1.500%	期日	01/23/2022	EUR	3,600		4,162
3.375%	期日	09/23/2020		2,900		3,480
Alliance Data Systems Corp.						
4.500%	期日	03/15/2022		173		199
Ally Financial, Inc.						
3.250%	期日	11/05/2018	USD	1,400		1,400
3.500%	期日	01/27/2019		5,240		5,240
3.750%	期日	11/18/2019		1,060		1,063
4.125%	期日	03/30/2020		5,800		5,822
4.250%	期日	04/15/2021		4,660		4,672
7.500%	期日	09/15/2020		556		591
8.000%	期日	12/31/2018		400		403
8.000%	期日	03/15/2020		550		580
8.000%	期日	11/01/2031		8,949		10,805
Alpha Bank AE						
2.500%	期日	02/05/2023	EUR	3,900		4,473
Ambac LSNI LLC						
7.396%	期日	02/12/2023	USD	12,727		12,918
American International Group, Inc.						
5.750%	期日	04/01/2048		2,516		2,382
American Tower Corp.						
3.000%	期日	06/15/2023		1,864		1,787
Annington Funding PLC						
1.650%	期日	07/12/2024	EUR	1,600		1,786
2.646%	期日	07/12/2025	GBP	2,200		2,770
3.184%	期日	07/12/2029		900		1,136
Ardonagh Midco 3 PLC						
8.375%	期日	07/15/2023		3,560		4,274
Army Hawaii Family Housing Trust Certificates						
2.680%	期日	06/15/2050	USD	8,200		6,112
Aroundtown S.A.						
1.000%	期日	01/07/2025	EUR	2,800		2,977
1.625%	期日	01/31/2028		2,100		2,149
1.875%	期日	01/19/2026		500		548
2.000%	期日	11/02/2026		2,500		2,733
3.000%	期日	10/16/2029	GBP	7,400		8,938
Assurant, Inc.						
4.200%	期日	09/27/2023	USD	2,012		2,003
Athene Holding Ltd.						
4.125%	期日	01/12/2028		894		821
Atrium European Real Estate Ltd.						
3.000%	期日	09/11/2025	EUR	3,100		3,547
3.625%	期日	10/17/2022		350		426
AXA Equitable Holdings, Inc.						

3.900% 期日 04/20/2023	USD	436	431
4.350% 期日 04/20/2028		2,610	2,499
5.000% 期日 04/20/2048		1,518	1,358
Axis Bank Ltd.			
3.250% 期日 05/21/2020		2,200	2,171
Banco Bilbao Vizcaya Argenteria S.A.			
6.750% 期日 02/18/2020	EUR	7,600	8,848
7.000% 期日 02/19/2019		31,200	35,738
8.875% 期日 04/14/2021		8,600	10,856
Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.			
25.980% 期日 04/26/2020	ARS	61,000	1,262
Banco do Brasil S.A.			
6.000% 期日 01/22/2020	USD	1,000	1,026
Banco do Nordeste do Brasil S.A.			
4.375% 期日 05/03/2019		7,300	7,318
Banco Espirito Santo S.A.			
2.625% 期日 05/08/2049	EUR	3,100	1,089
Banco Santander S.A.			
3.545% 期日 04/12/2023	USD	800	803
3.848% 期日 04/12/2023		1,200	1,162
4.379% 期日 04/12/2028		800	744
4.750% 期日 03/19/2025	EUR	10,200	10,138
6.250% 期日 09/11/2021		21,400	24,926
Bank of America Corp.			
3.106% 期日 03/05/2024	USD	4,136	4,109
3.419% 期日 12/20/2028		315	291
Bank of China Ltd.			
0.182% 期日 04/17/2021	EUR	3,020	3,423
Bank of Ireland			
7.375% 期日 06/18/2020		500	604
Barclays Bank PLC			
7.625% 期日 11/21/2022	USD	7,540	8,063
14.000% 期日 06/15/2019	GBP	9,970	13,659
Barclays PLC			
1.375% 期日 01/24/2026	EUR	4,300	4,625
2.375% 期日 10/06/2023	GBP	7,350	9,233
3.125% 期日 01/17/2024		27,000	34,633
3.250% 期日 02/12/2027		17,530	21,849
3.250% 期日 01/17/2033		3,300	3,790
3.684% 期日 01/10/2023	USD	500	484
3.695% 期日 05/16/2024		8,400	8,335
4.039% 期日 01/10/2023		1,000	1,016
4.337% 期日 01/10/2028		700	652
4.338% 期日 05/16/2024		5,400	5,301
4.375% 期日 01/12/2026		2,900	2,786
4.972% 期日 05/16/2029		2,600	2,528
5.875% 期日 09/15/2024	GBP	5,800	6,922
6.500% 期日 09/15/2019	EUR	21,200	24,770
7.000% 期日 09/15/2019	GBP	7,540	9,682
7.250% 期日 03/15/2023		14,800	19,444
7.750% 期日 09/15/2023	USD	11,100	11,102
7.875% 期日 03/15/2022		1,200	1,239
7.875% 期日 09/15/2022	GBP	8,053	10,761
8.000% 期日 12/15/2020	EUR	4,160	5,166
8.250% 期日 12/15/2018	USD	5,030	5,060
Bevco Lux Sarl			
1.750% 期日 02/09/2023	EUR	5,100	5,732
BGC Partners, Inc.			
5.125% 期日 05/27/2021	USD	400	409

5.375% 期日 12/09/2019		1,450	1,470
Blackstone CQP Holdco LP			
6.000% 期日 08/18/2021		1,300	1,305
6.500% 期日 03/20/2021		7,400	7,454
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl			
1.400% 期日 07/06/2022	EUR	4,100	4,670
2.200% 期日 07/24/2025		2,900	3,220
BNP Paribas S.A.			
3.375% 期日 01/09/2025	USD	54,443	50,961
4.400% 期日 08/14/2028		4,200	4,041
7.000% 期日 08/16/2028		1,400	1,382
7.625% 期日 03/30/2021		600	625
BOC Aviation Ltd.			
2.375% 期日 09/15/2021		570	544
3.499% 期日 09/26/2023		3,500	3,507
3.500% 期日 01/31/2023		200	195
3.609% 期日 05/02/2021		3,380	3,403
Boston Properties LP			
3.200% 期日 01/15/2025		991	943
BPCE S.A.			
12.500% 期日 09/30/2019		700	753
Brighthouse Financial, Inc.			
3.700% 期日 06/22/2027		2,400	2,069
Brixmor Operating Partnership LP			
3.250% 期日 09/15/2023		300	287
Brookfield Finance, Inc.			
3.900% 期日 01/25/2028		1,988	1,860
4.700% 期日 09/20/2047		4,240	3,923
Capital One Financial Corp.			
3.450% 期日 04/30/2021		5,900	5,878
CBL & Associates LP			
5.950% 期日 12/15/2026		1,384	1,156
China Construction Bank Corp.			
0.281% 期日 09/24/2021	EUR	2,000	2,269
CIT Group, Inc.			
4.125% 期日 03/09/2021	USD	1,216	1,216
5.000% 期日 08/15/2022		7,200	7,245
5.000% 期日 08/01/2023		4,136	4,157
5.250% 期日 03/07/2025		1,058	1,067
5.375% 期日 05/15/2020		1,330	1,369
Citigroup, Inc.			
3.142% 期日 01/24/2023		2,500	2,442
Compass Bank			
2.750% 期日 09/29/2019		700	697
Cooperatieve Rabobank UA			
2.938% 期日 04/26/2021		1,750	1,755
3.125% 期日 04/26/2021		2,500	2,478
4.625% 期日 12/29/2025	EUR	3,600	4,050
5.500% 期日 06/29/2020		17,610	21,000
6.625% 期日 06/29/2021		11,400	14,218
Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.			
6.875% 期日 07/08/2020	GBP	3,430	4,650
7.500% 期日 07/08/2026		600	895
Corestate Capital Holding S.A.			

3.500% 期日 04/15/2023	EUR	39,300	43,747
CPI Property Group S.A.			
1.450% 期日 04/14/2022		5,500	6,219
2.125% 期日 10/04/2024		4,800	5,369
Credit Agricole S.A.			
3.507% 期日 04/24/2023	USD	1,000	998
3.750% 期日 04/24/2023		1,750	1,711
7.875% 期日 01/23/2024		496	514
Credit Suisse AG			
4.375% 期日 08/05/2020		750	762
6.500% 期日 08/08/2023		10,885	11,526
Credit Suisse Group AG			
2.997% 期日 12/14/2023		3,600	3,426
3.532% 期日 12/14/2023		3,000	3,025
3.574% 期日 06/12/2024		2,750	2,757
3.869% 期日 01/12/2029		33,900	31,519
4.207% 期日 06/12/2024		3,500	3,480
4.282% 期日 01/09/2028		6,700	6,428
7.250% 期日 09/12/2025		1,800	1,784
7.500% 期日 07/17/2023		5,800	5,916
Credit Suisse Group			
Funding Guernsey Ltd.			
2.750% 期日 08/08/2025	GBP	600	757
3.750% 期日 03/26/2025	USD	1,800	1,725
Crown Castle International Corp.			
3.200% 期日 09/01/2024		604	571
3.650% 期日 09/01/2027		2,678	2,481
4.000% 期日 03/01/2027		255	244
CTR Partnership LP			
5.250% 期日 06/01/2025		504	493
Deutsche Bank AG			
0.375% 期日 01/18/2021	EUR	73,700	82,269
2.700% 期日 07/13/2020	USD	4,272	4,176
3.150% 期日 01/22/2021		10,000	9,756
3.284% 期日 01/22/2021		12,700	12,569
3.406% 期日 07/13/2020		1,774	1,763
3.766% 期日 02/04/2021		5,310	5,298
3.950% 期日 02/27/2023		1,820	1,753
4.250% 期日 10/14/2021		15,940	15,820
4.251% 期日 05/10/2019		80	80
Digital Euro Finco LLC			
2.625% 期日 04/15/2024	EUR	1,400	1,675
Digital Realty Trust LP			
3.700% 期日 08/15/2027	USD	92	86
Digital Stout Holding LLC			
2.750% 期日 07/19/2024	GBP	400	513
3.300% 期日 07/19/2029		400	508
Discover Bank			
3.350% 期日 02/06/2023	USD	900	870
Emerald Bay S.A.			
0.000% 期日 10/08/2020	EUR	3,425	3,682
EPR Properties			
4.500% 期日 06/01/2027	USD	3,650	3,469
4.750% 期日 12/15/2026		372	360
4.950% 期日 04/15/2028		1,132	1,096
Equinix, Inc.			
2.875% 期日 03/15/2024	EUR	5,700	6,551
2.875% 期日 10/01/2025		500	557
2.875% 期日 02/01/2026		16,550	18,346
ERP Operating LP			
3.250% 期日 08/01/2027	USD	257	242

3.500% 期日 03/01/2028		792	757
Eurobank Ergasias S.A.			
2.750% 期日 11/02/2020	EUR	1,000	1,157
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2.750% 期日 03/29/2028		6,600	7,524
4.850% 期日 04/17/2028	USD	3,411	3,329
Fastighets AB Balder			
1.125% 期日 03/14/2022	EUR	5,745	6,550
1.875% 期日 03/14/2025		1,100	1,234
1.875% 期日 01/23/2026		1,470	1,622
Franshion Brilliant Ltd.			
5.750% 期日 03/19/2019	USD	1,593	1,605
Freedom Mortgage Corp.			
8.250% 期日 04/15/2025		1,259	1,171
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2.875% 期日 06/20/2022	EUR	1,400	1,632
3.000% 期日 03/29/2025		400	454
GLP Capital LP			
5.250% 期日 06/01/2025	USD	1,200	1,209
5.300% 期日 01/15/2029		3,424	3,377
Goldman Sachs Group, Inc.			
0.131% 期日 12/16/2020	EUR	1,200	1,361
3.060% 期日 02/23/2023	USD	12,900	12,895
3.200% 期日 02/23/2023		12,900	12,540
3.814% 期日 04/23/2029		7,100	6,677
Goodman Australia Finance Pty Ltd.			
1.375% 期日 09/27/2025	EUR	400	437
Goodman U.S. Finance Three LLC			
3.700% 期日 03/15/2028	USD	2,324	2,164
Grainger PLC			
3.375% 期日 04/24/2028	GBP	2,000	2,534
Growthpoint Properties International Pty Ltd.			
5.872% 期日 05/02/2023	USD	1,600	1,591
High Street Funding Trust II			
4.682% 期日 02/15/2048		300	291
Host Hotels & Resorts LP			
4.000% 期日 06/15/2025		200	193
Howard Hughes Corp.			
5.375% 期日 03/15/2025		3,600	3,474
HSBC Bank Argentina S.A.			
25.250% 期日 09/27/2019	ARS	53,530	1,360
HSBC Holdings PLC			
2.625% 期日 08/16/2028	GBP	360	444
2.922% 期日 05/18/2021	USD	7,000	7,009
3.033% 期日 11/22/2023		4,900	4,714
3.262% 期日 03/13/2023		800	782
3.322% 期日 05/18/2024		3,000	2,994
3.950% 期日 05/18/2024		2,800	2,773
4.041% 期日 03/13/2028		700	671
4.300% 期日 03/08/2026		500	493
4.750% 期日 07/04/2029	EUR	2,800	2,991
5.250% 期日 09/16/2022		7,500	8,868
5.875% 期日 09/28/2026	GBP	4,500	5,721
6.000% 期日 09/29/2023	EUR	7,210	8,935
6.250% 期日 03/23/2023	USD	5,400	5,252
6.500% 期日 03/23/2028		9,470	8,902

Hudson Pacific Properties LP			
3.950%	期日 11/01/2027	363	336
Hunt Cos., Inc.			
6.250%	期日 02/15/2026	462	427
ICICI Bank Ltd.			
3.125%	期日 08/12/2020	200	197
3.441%	期日 12/04/2018	25,600	25,597
InCaps Funding I Ltd.			
4.321%	期日 06/01/2033	17,521	17,521
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.			
2.625%	期日 05/26/2020	1,600	1,574
3.093%	期日 11/08/2020	2,000	2,001
ING Bank NV			
2.450%	期日 03/16/2020	3,200	3,159
2.500%	期日 10/01/2019	3,300	3,282
ING Groep NV			
1.000%	期日 09/20/2023	EUR 1,100	1,239
3.398%	期日 10/02/2023	USD 4,100	4,101
4.100%	期日 10/02/2023	6,000	5,966
4.550%	期日 10/02/2028	4,300	4,233
Inmobiliaria Colonial Socimi S.A.			
1.625%	期日 11/28/2025	EUR 3,000	3,282
2.000%	期日 04/17/2026	2,900	3,221
International Lease Finance Corp.			
5.875%	期日 08/15/2022	USD 500	527
8.250%	期日 12/15/2020	7,970	8,648
8.625%	期日 01/15/2022	3,201	3,629
Intesa Sanpaolo SpA			
7.000%	期日 01/19/2021	EUR 26,850	31,069
7.750%	期日 01/11/2027	660	768
Intrepid Aviation Group Holdings LLC			
8.500%	期日 08/15/2021	USD 3,970	4,000
iStar, Inc.			
4.625%	期日 09/15/2020	137	136
5.250%	期日 09/15/2022	515	500
Jefferies Finance LLC			
6.875%	期日 04/15/2022	1,000	1,008
7.250%	期日 08/15/2024	600	590
7.375%	期日 04/01/2020	6,475	6,572
7.500%	期日 04/15/2021	1,380	1,394
JP Morgan Chase Bank N.A.			
2.848%	期日 04/26/2021	12,400	12,405
3.086%	期日 04/26/2021	12,400	12,355
Kasikornbank PCL			
3.500%	期日 10/25/2019	2,200	2,200
KBC Group NV			
4.250%	期日 10/24/2025	EUR 4,400	4,530
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
3.250%	期日 11/12/2025	1,400	1,568
3.950%	期日 06/30/2022	GBP 800	1,051
Kennedy-Wilson, Inc.			
5.875%	期日 04/01/2024	USD 1,320	1,274
Kojamo OYJ			
1.500%	期日 06/19/2024	EUR 1,200	1,356
1.625%	期日 03/07/2025	2,400	2,684
Liberty Living Finance PLC			

2.625% 期日 11/28/2024	GBP	1,250	1,586
3.375% 期日 11/28/2029		500	636
Lifestorage LP			
3.500% 期日 07/01/2026	USD	1,200	1,105
LifeStorage LP			
3.875% 期日 12/15/2027		1,010	940
Lincoln Finance Ltd.			
6.875% 期日 04/15/2021	EUR	9,322	10,937
Lloyds Bank PLC			
2.833% 期日 05/07/2021	USD	4,000	4,007
3.300% 期日 05/07/2021		9,600	9,526
12.000% 期日 12/16/2024		200	241
Lloyds Banking Group PLC			
2.250% 期日 10/16/2024	GBP	6,600	8,187
2.907% 期日 11/07/2023	USD	3,500	3,330
3.574% 期日 11/07/2028		5,600	5,043
4.000% 期日 03/07/2025	AUD	4,700	3,327
4.050% 期日 08/16/2023	USD	5,800	5,750
4.375% 期日 03/22/2028		2,200	2,106
4.450% 期日 05/08/2025		3,400	3,387
4.550% 期日 08/16/2028		5,000	4,836
6.375% 期日 06/27/2020	EUR	1,400	1,670
7.000% 期日 06/27/2019	GBP	38,538	50,167
7.500% 期日 06/27/2024	USD	2,700	2,730
7.500% 期日 09/27/2025		7,700	7,758
7.625% 期日 06/27/2023	GBP	8,311	11,296
7.875% 期日 06/27/2029		4,600	6,570
LoanCore Capital Markets LLC			
6.875% 期日 06/01/2020	USD	1,900	1,920
Meiji Yasuda Life Insurance Co.			
5.100% 期日 04/26/2048		3,400	3,375
Merlin Properties Socimi S.A.			
1.750% 期日 05/26/2025	EUR	1,710	1,902
1.875% 期日 11/02/2026		700	767
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.			
2.652% 期日 09/19/2022	USD	1,100	1,048
Mizuho Bank Ltd.			
2.400% 期日 03/26/2020		1,200	1,186
Mizuho Financial Group, Inc.			
2.601% 期日 09/11/2022		4,700	4,491
3.211% 期日 09/11/2022		10,200	10,226
Morgan Stanley			
2.891% 期日 02/10/2021		12,900	12,909
3.125% 期日 01/23/2023		12,900	12,496
3.772% 期日 01/24/2029		3,600	3,415
National Australia Bank Ltd.			
1.375% 期日 07/12/2019		600	594
2.625% 期日 07/23/2020		250	247
National Bank of Greece S.A.			
2.750% 期日 10/19/2020	EUR	800	932
Nationwide Building Society			
3.766% 期日 03/08/2024	USD	5,600	5,452
4.302% 期日 03/08/2029		6,400	6,042
Natwest Markets PLC			

0.581% 期日 09/27/2021	EUR	5,100	5,785
0.625% 期日 03/02/2022		300	335
Navient Corp.			
4.875% 期日 06/17/2019	USD	10,490	10,542
5.000% 期日 10/26/2020		4,474	4,510
5.500% 期日 01/15/2019		17,552	17,640
5.625% 期日 08/01/2033		1,468	1,201
5.875% 期日 03/25/2021		14,633	14,834
6.500% 期日 06/15/2022		3,440	3,505
6.625% 期日 07/26/2021		3,990	4,115
7.250% 期日 01/25/2022		5,900	6,158
8.000% 期日 03/25/2020		21,896	22,909
Nordea Kredit			
Realkreditaktieselskab			
2.000% 期日 10/01/2047	DKK	2,648	405
Nykredit Realkredit A/S			
2.500% 期日 10/01/2047		9,787	1,553
Ontario Teachers' Cadillac			
Fairview Properties Trust			
3.125% 期日 03/20/2022	USD	696	682
Oppenheimer Holdings, Inc.			
6.750% 期日 07/01/2022		424	429
Physicians Realty LP			
3.950% 期日 01/15/2028		1,828	1,685
4.300% 期日 03/15/2027		2,650	2,523
Preferred Term Securities			
X Ltd.			
2.714% 期日 09/23/2035		584	561
Preferred Term Securities			
XX Ltd.			
2.634% 期日 03/22/2037		1,338	1,244
2.714% 期日 03/22/2037		4,918	4,033
Preferred Term Securities			
XX Ltd.			
2.624% 期日 06/22/2037		30,831	28,211
Preferred Term Securities			
XX Ltd.			
2.634% 期日 09/22/2037		50,146	45,883
Prologis International			
Funding II S.A.			
1.750% 期日 03/15/2028	EUR	900	1,003
Provident Funding			
Associates LP			
6.375% 期日 06/15/2025	USD	172	170
Qatari Diar Finance Co.			
5.000% 期日 07/21/2020		11,400	11,670
QNB Finance Ltd.			
3.688% 期日 02/12/2020		79,800	80,290
3.693% 期日 02/07/2020		56,200	56,554
4.096% 期日 04/01/2019		600	604
Realkredit Danmark A/S			
2.500% 期日 07/01/2047	DKK	8,514	1,351
Reckson Operating			
Partnership LP			
7.750% 期日 03/15/2020	USD	500	526
Royal Bank of Scotland			
Group PLC			
2.000% 期日 03/08/2023	EUR	1,900	2,200
2.000% 期日 03/04/2025		21,750	24,652
2.500% 期日 03/22/2023		25,700	30,357
3.498% 期日 05/15/2023	USD	4,414	4,249

3.784% 期日 05/15/2023		3,074	3,091
3.875% 期日 09/12/2023		7,700	7,416
4.800% 期日 04/05/2026		2,300	2,271
5.076% 期日 01/27/2030		10,700	10,501
7.500% 期日 08/10/2020		2,900	2,955
8.000% 期日 08/10/2025		6,760	6,992
8.625% 期日 08/15/2021		4,200	4,426
Sagax AB			
2.000% 期日 01/17/2024	EUR	1,600	1,822
Santander Holdings USA, Inc.			
3.400% 期日 01/18/2023	USD	14,048	13,422
3.700% 期日 03/28/2022		412	405
4.400% 期日 07/13/2027		1,284	1,200
4.500% 期日 07/17/2025		3,000	2,938
Santander UK Group Holdings PLC			
0.531% 期日 03/27/2024	EUR	2,800	3,124
2.875% 期日 08/05/2021	USD	3,600	3,492
2.920% 期日 05/08/2026	GBP	1,220	1,535
3.373% 期日 01/05/2024	USD	55,550	53,065
3.571% 期日 01/10/2023		1,500	1,450
3.625% 期日 01/14/2026	GBP	1,900	2,498
3.823% 期日 11/03/2028	USD	3,400	3,067
6.750% 期日 06/24/2024	GBP	16,360	21,397
7.375% 期日 06/24/2022		4,100	5,456
Santander UK PLC			
1.625% 期日 05/10/2021		6,300	8,021
2.941% 期日 06/01/2021	USD	2,200	2,210
3.400% 期日 06/01/2021		5,400	5,364
SBA Tower Trust			
2.877% 期日 07/09/2021		1,500	1,467
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
3.080% 期日 03/07/2019	EUR	5,200	5,923
3.352% 期日 11/15/2019		8,000	9,216
4.150% 期日 03/06/2019	USD	4,200	4,197
5.180% 期日 06/28/2019		7,200	7,237
5.717% 期日 06/16/2021		900	916
6.125% 期日 02/07/2022		10,400	10,685
SELP Finance Sarl			
1.500% 期日 11/20/2025	EUR	1,500	1,647
SL Green Operating Partnership LP			
3.250% 期日 10/15/2022	USD	234	226
SL Green Realty Corp.			
4.500% 期日 12/01/2022		1,420	1,431
SMBC Trust Account			
3.608% 期日 04/09/2021		5,000	5,008
Societe Generale S.A.			
6.750% 期日 04/06/2028		2,200	1,944
7.375% 期日 10/04/2023		11,200	10,906
8.250% 期日 11/29/2018		800	803
Society of Lloyd's			
4.750% 期日 10/30/2024	GBP	800	1,085
Springleaf Finance Corp.			
5.250% 期日 12/15/2019	USD	10,070	10,196
5.625% 期日 03/15/2023		27,700	26,869
6.000% 期日 06/01/2020		6,232	6,388
6.125% 期日 05/15/2022		14,223	14,365
6.875% 期日 03/15/2025		3,161	3,035
7.750% 期日 10/01/2021		1,780	1,887

8.250% 期日 12/15/2020	23,219	24,902
Standard Chartered PLC		
3.558% 期日 01/20/2023	2,470	2,474
4.247% 期日 01/20/2023	4,700	4,699
Starwood Property Trust, Inc.		
3.625% 期日 02/01/2021	8,000	7,790
4.750% 期日 03/15/2025	1,152	1,100
5.000% 期日 12/15/2021	500	499
State Bank of India		
3.358% 期日 04/06/2020	14,500	14,546
Stearns Holdings LLC		
9.375% 期日 08/15/2020	1,580	1,584
STORE Capital Corp.		
4.500% 期日 03/15/2028	1,348	1,306
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
2.514% 期日 01/17/2020	6,300	6,246
2.799% 期日 01/17/2020	6,300	6,307
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
3.102% 期日 01/17/2023	6,300	6,135
3.189% 期日 01/17/2023	5,670	5,673
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
1.950% 期日 09/19/2019	2,490	2,465
2.779% 期日 09/19/2019	3,040	3,046
Summit Germany Ltd.		
2.000% 期日 01/31/2025 EUR	1,100	1,190
Tesco Property Finance 2 PLC		
6.052% 期日 10/13/2039 GBP	5,108	7,852
Tesco Property Finance 3 PLC		
5.744% 期日 04/13/2040	166	251
Tesco Property Finance 4 PLC		
5.801% 期日 10/13/2040	402	612
Tesco Property Finance 6 PLC		
5.411% 期日 07/13/2044	2,637	3,854
TLG Immobilien AG		
1.375% 期日 11/27/2024 EUR	1,500	1,663
TP ICAP PLC		
5.250% 期日 01/26/2024 GBP	1,900	2,330
Tritax Big Box REIT PLC		
2.625% 期日 12/14/2026	1,000	1,261
3.125% 期日 12/14/2031	800	1,000
Turkiye Garanti Bankasi A/S		
3.588% 期日 02/11/2019 USD	5,800	5,753
U.S. Capital Funding VI Ltd.		
2.694% 期日 07/10/2043	28,305	25,474
UBS AG		
5.125% 期日 05/15/2024	900	898
7.625% 期日 08/17/2022	6,000	6,585
UBS Group Funding Switzerland AG		
2.650% 期日 02/01/2022	7,100	6,856
2.859% 期日 08/15/2023	1,000	959
3.491% 期日 05/23/2023	2,000	1,956

	4.125% 期日 09/24/2025		2,870	2,826
	4.125% 期日 04/15/2026		2,500	2,456
	4.253% 期日 03/23/2028		1,800	1,766
	5.750% 期日 02/19/2022	EUR	3,200	3,948
	7.000% 期日 02/19/2025	USD	200	209
	UDR, Inc.			
	3.500% 期日 01/15/2028		410	382
	4.625% 期日 01/10/2022		103	105
	Unique Pub Finance Co. PLC			
	5.659% 期日 06/30/2027	GBP	2,308	3,259
	6.542% 期日 03/30/2021		736	988
	7.395% 期日 03/28/2024		1,886	2,678
	Ventas Realty LP			
	3.250% 期日 10/15/2026	USD	100	92
	VEREIT Operating Partnership LP			
	3.950% 期日 08/15/2027		380	354
	VICI Properties 1 LLC			
	8.000% 期日 10/15/2023		3,278	3,614
	Virgin Money Holdings UK PLC			
	8.750% 期日 11/10/2021	GBP	200	273
	Vornado Realty LP			
	3.500% 期日 01/15/2025	USD	528	504
	Wells Fargo & Co.			
	2.125% 期日 12/20/2023	GBP	2,100	2,670
	3.000% 期日 10/23/2026	USD	2,810	2,573
	3.268% 期日 02/11/2022		6,670	6,726
	Wells Fargo Bank N.A.			
	2.977% 期日 07/23/2021		4,700	4,704
	3.325% 期日 07/23/2021		10,600	10,566
	Welltower, Inc.			
	3.950% 期日 09/01/2023		830	829
	4.250% 期日 04/15/2028		1,256	1,228
	Westfield America Management Ltd.			
	2.125% 期日 03/30/2025	GBP	500	629
	WellWork Cos., Inc.			
	7.875% 期日 05/01/2025	USD	1,344	1,240
	WPC Eurobond BV			
	2.125% 期日 04/15/2027	EUR	2,100	2,325
	2.250% 期日 04/09/2026		3,400	3,837
				2,402,158
産業	AA Bond Co. Ltd.			
9.9%	2.750% 期日 07/31/2023	GBP	400	472
	2.875% 期日 01/31/2022		2,100	2,591
	4.249% 期日 07/31/2020		506	665
	4.875% 期日 07/31/2024		1,200	1,534
	AbbVie, Inc.			
	3.375% 期日 11/14/2021	USD	5,824	5,797
	3.750% 期日 11/14/2023		3,462	3,433
	4.250% 期日 11/14/2028		4,992	4,822
	Air Canada 2017-1 Class B Pass-Through Trust			
	3.700% 期日 01/15/2026		366	352
	Allergan Funding SCS			
	0.031% 期日 06/01/2019	EUR	144	163
	3.000% 期日 03/12/2020	USD	500	498
	Altice Financing S.A.			
	5.250% 期日 02/15/2023	EUR	10,200	11,998
	6.625% 期日 02/15/2023	USD	13,930	13,823
	7.500% 期日 05/15/2026		1,000	942

Altice France S.A.					
5.625%	期日	05/15/2024	EUR	13,920	16,312
5.875%	期日	02/01/2027		24,000	28,081
6.250%	期日	05/15/2024	USD	15,000	14,437
7.375%	期日	05/01/2026		14,133	13,581
8.125%	期日	02/01/2027		4,300	4,268
Altice Luxembourg S.A.					
7.250%	期日	05/15/2022	EUR	11,224	12,480
American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust					
3.350%	期日	10/15/2029	USD	467	444
Andeavor Logistics LP					
3.500%	期日	12/01/2022		144	141
4.250%	期日	12/01/2027		258	246
5.500%	期日	10/15/2019		200	204
AP Moller - Maersk A/S					
1.750%	期日	03/16/2026	EUR	2,900	3,184
2.875%	期日	09/28/2020	USD	1,400	1,379
Arrow Electronics, Inc.					
3.250%	期日	09/08/2024		479	449
Avolon Holdings Funding Ltd.					
5.500%	期日	01/15/2023		3,604	3,595
Bacardi Ltd.					
4.450%	期日	05/15/2025		2,000	1,969
4.700%	期日	05/15/2028		2,600	2,517
Baidu, Inc.					
3.875%	期日	09/29/2023		4,100	4,052
4.375%	期日	03/29/2028		1,400	1,362
Banff Merger Sub, Inc.					
9.750%	期日	09/01/2026		2,425	2,334
BAT Capital Corp.					
2.297%	期日	08/14/2020		300	294
Bausch Health Cos., Inc.					
5.500%	期日	11/01/2025		210	207
6.500%	期日	03/15/2022		3,835	3,979
7.000%	期日	03/15/2024		901	946
Baxalta, Inc.					
2.875%	期日	06/23/2020		828	819
Bayer U.S. Finance II LLC					
3.003%	期日	06/25/2021		1,600	1,601
Boral Finance Pty Ltd.					
3.000%	期日	11/01/2022		1,996	1,922
Boston Scientific Corp.					
3.375%	期日	05/15/2022		2,260	2,231
6.000%	期日	01/15/2020		300	309
Broadcom Corp.					
2.200%	期日	01/15/2021		100	97
2.375%	期日	01/15/2020		100	99
2.650%	期日	01/15/2023		6,325	5,938
3.000%	期日	01/15/2022		6,026	5,838
3.625%	期日	01/15/2024		1,487	1,426
3.875%	期日	01/15/2027		8,690	7,993
Bureau Veritas S.A.					
1.875%	期日	01/06/2025	EUR	3,200	3,671
Caesars Resort Collection LLC					
5.250%	期日	10/15/2025	USD	86	80
Campbell Soup Co.					
2.834%	期日	03/16/2020		2,490	2,486
2.964%	期日	03/15/2021		2,030	2,023

3.950% 期日 03/15/2025		1,539	1,464
Celgene Corp.			
2.250% 期日 08/15/2021		3,660	3,535
Central Nippon Expressway Co. Ltd.			
2.774% 期日 02/15/2022		13,200	13,138
2.881% 期日 08/04/2020		7,800	7,816
Charles River Laboratories International, Inc.			
5.500% 期日 04/01/2026		404	404
Charter Communications Operating LLC			
3.579% 期日 07/23/2020		1,426	1,424
4.191% 期日 02/01/2024		4,202	4,273
4.200% 期日 03/15/2028		1,393	1,307
4.464% 期日 07/23/2022		1,687	1,708
4.500% 期日 02/01/2024		1,700	1,705
4.908% 期日 07/23/2025		992	998
Chesapeake Energy Corp.			
5.686% 期日 04/15/2019		189	190
Christian Dior SE			
0.750% 期日 06/24/2021	EUR	300	345
1.375% 期日 06/19/2019		100	114
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.			
6.500% 期日 11/15/2022	USD	1,370	1,398
7.625% 期日 03/15/2020		2,300	2,303
Cleveland-Cliffs, Inc.			
4.875% 期日 01/15/2024		520	498
CNH Industrial Capital LLC			
4.375% 期日 11/06/2020		300	304
4.875% 期日 04/01/2021		80	82
Comcast Corp.			
2.738% 期日 10/01/2020		4,008	4,011
2.848% 期日 10/01/2021		2,242	2,244
3.038% 期日 04/15/2024		3,632	3,614
3.700% 期日 04/15/2024		3,180	3,169
Community Health Systems, Inc.			
5.125% 期日 08/01/2021		17,507	16,675
6.250% 期日 03/31/2023		26,200	24,194
8.625% 期日 01/15/2024		10,517	10,662
Conagra Brands, Inc.			
2.908% 期日 10/09/2020		180	180
CSCEC Finance Cayman I Ltd.			
2.950% 期日 11/19/2020		400	393
CVS Health Corp.			
3.700% 期日 03/09/2023		4,063	4,013
4.300% 期日 03/25/2028		5,980	5,843
CVS Pass-Through Trust			
7.507% 期日 01/10/2032		722	834
DAE Funding LLC			
4.000% 期日 08/01/2020		2,670	2,653
4.500% 期日 08/01/2022		13,832	13,521
5.000% 期日 08/01/2024		9,446	9,233
Davide Campari-Milano SpA			
2.750% 期日 09/30/2020	EUR	1,410	1,673
Dell International LLC			
4.420% 期日 06/15/2021	USD	11,782	11,887
Delta Air Lines, Inc.			
2.875% 期日 03/13/2020		1,720	1,705

3.625% 期日 03/15/2022		920	905
Diamond Resorts International, Inc.			
7.750% 期日 09/01/2023		8,334	8,574
10.750% 期日 09/01/2024		260	255
Discovery Communications LLC			
2.750% 期日 11/15/2019		304	302
2.950% 期日 03/20/2023		362	344
3.950% 期日 03/20/2028		528	492
DISH DBS Corp.			
5.125% 期日 05/01/2020		4,588	4,617
7.875% 期日 09/01/2019		17,565	18,132
DP World Ltd.			
2.375% 期日 09/25/2026	EUR	2,200	2,484
4.250% 期日 09/25/2030	GBP	1,100	1,400
DR Horton, Inc.			
4.000% 期日 02/15/2020	USD	290	291
DXC Technology Co.			
3.271% 期日 03/01/2021		4,154	4,154
4.750% 期日 04/15/2027		310	308
Eastern Creation Investment Holdings Ltd.			
2.750% 期日 09/26/2020		2,300	2,251
Eastern Creation Investment Holdings Ltd.			
3.625% 期日 03/20/2019		600	599
eBay, Inc.			
3.800% 期日 03/09/2022		3,375	3,385
EI Group PLC			
6.375% 期日 02/15/2022	GBP	5,600	7,401
6.500% 期日 12/06/2018		1,051	1,352
6.875% 期日 02/15/2021		950	1,320
EMC Corp.			
2.650% 期日 06/01/2020	USD	31,268	30,432
Energy Transfer Operating LP			
4.150% 期日 10/01/2020		100	101
4.200% 期日 09/15/2023		1,354	1,349
4.950% 期日 06/15/2028		1,962	1,942
6.000% 期日 06/15/2048		300	298
Energy Transfer Partners LP			
5.750% 期日 09/01/2020		2,140	2,207
5.875% 期日 03/01/2022		450	474
EQT Corp.			
3.166% 期日 10/01/2020		1,229	1,229
4.875% 期日 11/15/2021		200	205
Equifax, Inc.			
3.184% 期日 08/15/2021		1,668	1,679
3.600% 期日 08/15/2021		586	581
Eurofins Scientific SE			
2.125% 期日 07/25/2024	EUR	800	902
Exela Intermediate LLC			
10.000% 期日 07/15/2023	USD	880	919
Ford Motor Credit Co. LLC			
2.597% 期日 11/04/2019		1,300	1,285
5.875% 期日 08/02/2021		400	414
8.125% 期日 01/15/2020		1,600	1,677
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			

6.500% 期日 10/01/2025		5,520	5,437
6.750% 期日 03/15/2022		9,064	9,302
Fresenius Medical Care US Finance, Inc.			
4.125% 期日 10/15/2020		16	16
5.625% 期日 07/31/2019		374	380
Fresenius U.S. Finance II, Inc.			
4.250% 期日 02/01/2021		190	192
G4S International Finance PLC			
1.500% 期日 01/09/2023	EUR	1,400	1,607
GATX Corp.			
3.061% 期日 11/05/2021	USD	3,900	3,908
General Electric Co.			
5.500% 期日 01/08/2020		950	969
5.550% 期日 05/04/2020		150	154
General Mills, Inc.			
2.976% 期日 04/16/2021		2,524	2,523
3.200% 期日 04/16/2021		451	448
General Motors Financial Co., Inc.			
3.150% 期日 01/15/2020		125	124
3.200% 期日 07/13/2020		800	793
3.550% 期日 04/09/2021		1,110	1,101
Gerdau Holdings, Inc.			
7.000% 期日 01/20/2020		7,200	7,479
Greene King Finance PLC			
4.064% 期日 03/15/2035	GBP	723	984
5.106% 期日 03/15/2034		150	220
5.702% 期日 12/15/2034		4,156	5,016
Halfmoon Parent, Inc.			
3.326% 期日 07/15/2023	USD	10,860	10,858
3.750% 期日 07/15/2023		13,332	13,230
Harris Corp.			
3.000% 期日 04/30/2020		5,600	5,598
Harvest Operations Corp.			
2.330% 期日 04/14/2021		2,884	2,773
HCA, Inc.			
4.250% 期日 10/15/2019		2,710	2,725
6.500% 期日 02/15/2020		200	207
Hilton Domestic Operating Co., Inc.			
5.125% 期日 05/01/2026		2,766	2,711
HOCHTIEF AG			
2.625% 期日 05/28/2019	EUR	653	750
3.875% 期日 03/20/2020		7,453	8,874
Hyatt Hotels Corp.			
4.850% 期日 03/15/2026	USD	100	102
Hyundai Capital America			
3.137% 期日 09/18/2020		3,198	3,200
iHeartCommunications, Inc.			
9.000% 期日 12/15/2019		34,080	24,708
9.000% 期日 03/01/2021		48,736	35,455
9.000% 期日 09/15/2022		9,018	6,538
10.625% 期日 03/15/2023		4,560	3,272
11.250% 期日 03/01/2021		11,268	7,993
IHO Verwaltungs GmbH			
3.750% 期日 09/15/2026	EUR	100	113
IMCD NV			
2.500% 期日 03/26/2025		1,700	1,908

Imperial Brands Finance PLC				
2.950% 期日 07/21/2020	USD	1,300		1,284
Incitec Pivot Finance LLC				
6.000% 期日 12/10/2019		160		164
Intelsat Connect Finance S.A.				
9.500% 期日 02/15/2023		3,960		3,807
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
5.500% 期日 08/01/2023		1,624		1,457
7.500% 期日 04/01/2021		12,789		12,949
8.000% 期日 02/15/2024		4,227		4,433
8.500% 期日 10/15/2024		12,393		12,192
9.750% 期日 07/15/2025		3,141		3,298
Intelsat Luxembourg S.A.				
7.750% 期日 06/01/2021		15,908		15,113
International Flavors & Fragrances, Inc.				
3.400% 期日 09/25/2020		1,750		1,750
InterXion Holding NV				
4.750% 期日 06/15/2025	EUR	400		474
IQVIA, Inc.				
2.875% 期日 09/15/2025		400		444
3.250% 期日 03/15/2025		500		574
JT International Financial Services BV				
1.125% 期日 09/28/2025		1,100		1,254
Kinder Morgan, Inc.				
7.750% 期日 01/15/2032	USD	2,500		3,075
Kraft Heinz Foods Co.				
2.911% 期日 02/10/2021		1,690		1,694
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
6.500% 期日 09/15/2026		2,004		2,029
Martin Marietta Materials, Inc.				
2.838% 期日 12/20/2019		680		682
2.960% 期日 05/22/2020		570		571
MGM Resorts International				
6.625% 期日 12/15/2021		152		160
6.750% 期日 10/01/2020		6,108		6,379
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.				
3.500% 期日 07/30/2020		1,600		1,587
Mitchells & Butlers Finance PLC				
2.784% 期日 12/15/2030		659		621
6.013% 期日 12/15/2028	GBP	192		281
Molnlycke Holding AB				
1.875% 期日 02/28/2025	EUR	300		344
MPLX LP				
3.375% 期日 03/15/2023	USD	316		308
NetApp, Inc.				
3.300% 期日 09/29/2024		2,610		2,494
Netflix, Inc.				
3.625% 期日 05/15/2027	EUR	7,727		8,704
4.625% 期日 05/15/2029		4,800		5,465
New Red Finance, Inc.				
4.250% 期日 05/15/2024	USD	6,073		5,724
Nexi Capital SpA				
4.125% 期日 11/01/2023	EUR	100		114

Nidec Corp.			
0.487% 期日 09/27/2021	900		1,026
Nokia OYJ			
4.375% 期日 06/12/2027 USD	175		165
Norwegian Air Shuttle ASA			
2016-1 Class A Pass-Through Trust			
4.875% 期日 05/10/2028	464		455
Ooredoo Tamweel Ltd.			
3.039% 期日 12/03/2018	200		200
Ortho-Clinical			
Diagnostics, Inc.			
6.625% 期日 05/15/2022	5,091		4,918
Pacific National Finance			
Pty Ltd.			
4.625% 期日 09/23/2020	530		535
Park Aerospace Holdings			
Ltd.			
3.625% 期日 03/15/2021	18,709		18,007
4.500% 期日 03/15/2023	10,570		10,082
5.250% 期日 08/15/2022	48,447		48,265
5.500% 期日 02/15/2024	8,672		8,609
Pelabuhan Indonesia III			
Persero PT			
4.500% 期日 05/02/2023	1,600		1,563
Petroleos de Venezuela			
S.A.			
5.375% 期日 04/12/2027	11,932		2,178
5.500% 期日 04/12/2037	10,372		1,919
6.000% 期日 05/16/2024	8,083		1,427
6.000% 期日 11/15/2026	13,183		2,323
9.000% 期日 11/17/2021	400		86
9.750% 期日 05/17/2035	4,730		1,029
Petroleos Mexicanos			
6.500% 期日 03/13/2027	2,620		2,543
6.750% 期日 09/21/2047	390		336
Petronas Capital Ltd.			
5.250% 期日 08/12/2019	2,800		2,847
PetSmart, Inc.			
5.875% 期日 06/01/2025	674		529
Phillips 66			
3.086% 期日 04/15/2019	1,000		1,000
3.186% 期日 04/15/2020	900		900
QGOG Constellation S.A.			
9.500% 期日 11/09/2024	753		365
QUALCOMM, Inc.			
2.900% 期日 05/20/2024	140		133
QVC, Inc.			
4.375% 期日 03/15/2023	900		885
4.450% 期日 02/15/2025	660		628
4.850% 期日 04/01/2024	2,190		2,162
5.125% 期日 07/02/2022	3,400		3,444
5.450% 期日 08/15/2034	50		44
5.950% 期日 03/15/2043	8,100		7,250
Radiate Holdco LLC			
6.875% 期日 02/15/2023	3,210		3,098
RCI Banque S.A.			
0.250% 期日 07/12/2021 EUR	1,300		1,460
Refinitiv U.S. Holdings,			
Inc.			
4.500% 期日 05/15/2026	15,630		17,761
6.250% 期日 05/15/2026 USD	3,300		3,288

6.875% 期日 11/15/2026	EUR	600	678
8.250% 期日 11/15/2026	USD	850	829
Rite Aid Corp.			
6.125% 期日 04/01/2023		4,940	4,221
Roadster Finance DAC			
1.625% 期日 12/09/2024	EUR	700	770
2.375% 期日 12/08/2027		1,000	1,079
Rockwell Collins, Inc.			
2.800% 期日 03/15/2022	USD	194	188
Russian Railways Via RZD Capital PLC			
3.374% 期日 05/20/2021	EUR	7,700	9,130
7.487% 期日 03/25/2031	GBP	6,300	9,474
Sands China Ltd.			
4.600% 期日 08/08/2023	USD	4,200	4,153
5.125% 期日 08/08/2025		5,200	5,106
5.400% 期日 08/08/2028		7,000	6,707
Scientific Games International, Inc.			
3.375% 期日 02/15/2026	EUR	317	335
SF Holding Investment Ltd.			
4.125% 期日 07/26/2023	USD	2,200	2,186
Shelf Drilling Holdings Ltd.			
8.250% 期日 02/15/2025		473	476
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC			
2.400% 期日 09/23/2021		3,750	3,605
SMBC Aviation Capital Finance DAC			
2.650% 期日 07/15/2021		400	386
3.000% 期日 07/15/2022		300	288
4.125% 期日 07/15/2023		200	199
SoftBank Group Corp.			
3.125% 期日 09/19/2025	EUR	9,400	9,903
4.000% 期日 04/20/2023		35,726	42,108
4.000% 期日 09/19/2029		1,700	1,692
Spanish Broadcasting System, Inc.			
12.500% 期日 04/15/2049	USD	818	832
Spectra Energy Partners LP			
3.016% 期日 06/05/2020		500	501
Spirit Issuer PLC			
3.500% 期日 12/28/2031	GBP	1,060	1,334
6.582% 期日 03/28/2025		248	320
Sprint Spectrum Co. LLC			
3.360% 期日 09/20/2021	USD	3,750	3,722
4.738% 期日 03/20/2025		5,200	5,206
5.152% 期日 03/20/2028		8,270	8,291
Starfruit Finco BV			
6.500% 期日 10/01/2026	EUR	900	1,000
8.000% 期日 10/01/2026	USD	900	875
Sunoco Logistics Partners Operations LP			
5.950% 期日 12/01/2025		760	806
Sunoco LP			
4.875% 期日 01/15/2023		1,110	1,072
Syngenta Finance NV			
3.698% 期日 04/24/2020		600	598
3.933% 期日 04/23/2021		1,600	1,593
4.441% 期日 04/24/2023		5,300	5,220
4.892% 期日 04/24/2025		800	771

5.182% 期日 04/24/2028		1,800	1,706
Tech Data Corp.			
3.700% 期日 02/15/2022		2,327	2,279
4.950% 期日 02/15/2027		910	880
Telefonica Emisiones SAU			
5.134% 期日 04/27/2020		230	236
Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl			
5.500% 期日 03/01/2028		1,600	1,492
Tencent Holdings Ltd.			
3.375% 期日 05/02/2019		1,600	1,602
Tenet Healthcare Corp.			
4.625% 期日 07/15/2024		1,702	1,645
Teva Pharmaceutical Finance IV BV			
3.650% 期日 11/10/2021		418	401
Teva Pharmaceutical Finance IV LLC			
2.250% 期日 03/18/2020		474	460
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV			
0.375% 期日 07/25/2020	EUR	4,800	5,363
3.250% 期日 04/15/2022		11,200	13,102
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV			
1.700% 期日 07/19/2019	USD	220	216
2.800% 期日 07/21/2023		208	184
Textron, Inc.			
2.891% 期日 11/10/2020		3,770	3,766
Times Square Hotel Trust			
8.528% 期日 08/01/2026		1,870	2,154
T-Mobile USA, Inc.			
4.750% 期日 02/01/2028		728	337
Triumph Group, Inc.			
4.875% 期日 04/01/2021		2,479	2,347
5.250% 期日 06/01/2022		486	452
Ubisoft Entertainment S.A.			
1.289% 期日 01/30/2023	EUR	1,800	2,041
UCB S.A.			
1.875% 期日 04/02/2022		1,500	1,766
3.750% 期日 03/27/2020		376	447
4.125% 期日 01/04/2021		150	184
United Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust			
3.100% 期日 07/07/2028	USD	256	242
United Group BV			
4.375% 期日 07/01/2022	EUR	1,100	1,287
4.875% 期日 07/01/2024		1,100	1,291
United Technologies Corp.			
2.965% 期日 08/16/2021	USD	1,428	1,430
3.350% 期日 08/16/2021		292	291
3.650% 期日 08/16/2023		4,868	4,828
4.125% 期日 11/16/2028		3,448	3,393
4.450% 期日 11/16/2038		564	547
4.625% 期日 11/16/2048		1,028	993
Univision Communications, Inc.			
5.125% 期日 05/15/2023		530	501
5.125% 期日 02/15/2025		14,170	12,987
UPCB Finance Ltd.			
3.625% 期日 06/15/2029	EUR	8,151	9,146

	ViaSat, Inc.				
	5.625% 期日 09/15/2025	USD	3,698		3,444
	Virgin Media Secured Finance PLC				
	5.000% 期日 04/15/2027	GBP	3,760		4,748
	5.500% 期日 01/15/2025		9,450		12,347
	VMware, Inc.				
	2.300% 期日 08/21/2020	USD	654		639
	2.950% 期日 08/21/2022		5,956		5,707
	3.900% 期日 08/21/2027		540		494
	Volkswagen Bank GmbH				
	0.101% 期日 06/15/2021	EUR	900		1,014
	Volkswagen Financial Services AG				
	0.250% 期日 10/16/2020		7,960		9,010
	Volkswagen Financial Services NV				
	1.875% 期日 09/07/2021	GBP	1,800		2,286
	Volkswagen Leasing GmbH				
	0.132% 期日 07/06/2021	EUR	1,000		1,127
	0.250% 期日 02/16/2021		4,688		5,293
	1.000% 期日 02/16/2023		2,464		2,762
	Warner Media LLC				
	3.800% 期日 02/15/2027	USD	246		231
	Western Digital Corp.				
	4.750% 期日 02/15/2026		5,260		4,865
	Westmoreland Coal Co.				
	8.750% 期日 01/01/2022		685		271
	Wind Tre SpA				
	2.625% 期日 01/20/2023	EUR	2,400		2,535
	2.750% 期日 01/20/2024		1,400		1,472
	3.125% 期日 01/20/2025		1,200		1,241
	5.000% 期日 01/20/2026	USD	1,000		856
	Wyndham Destinations, Inc.				
	5.400% 期日 04/01/2024		172		166
	5.750% 期日 04/01/2027		196		182
	Wynn Macau Ltd.				
	4.875% 期日 10/01/2024		400		364
	5.500% 期日 10/01/2027		600		543
	Yara International ASA				
	4.750% 期日 06/01/2028		2,205		2,187
	Zimmer Biomet Holdings, Inc.				
	3.375% 期日 11/30/2021		124		122
					<u>1,165,963</u>
公共事業	AT&T, Inc.				
2.7%	3.386% 期日 07/15/2021		3,419		3,457
	3.450% 期日 09/19/2023	AUD	3,630		2,565
	3.514% 期日 06/12/2024	USD	6,982		7,007
	4.100% 期日 01/19/2026	AUD	3,630		2,558
	4.900% 期日 08/15/2037	USD	3,020		2,779
	5.000% 期日 03/01/2021		61		63
	5.300% 期日 08/15/2058		2,590		2,361
	5.650% 期日 02/15/2047		44		43
	BellSouth LLC				
	4.333% 期日 04/26/2021		28,100		28,285
	China Resources Gas Group Ltd.				
	4.500% 期日 04/05/2022		400		404
	CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.				
	2.625% 期日 05/05/2020		400		395

Dominion Energy, Inc.			
2.914%	期日 05/15/2020	9,370	9,371
Duke Energy Corp.			
2.819%	期日 05/14/2021	3,100	3,109
3.050%	期日 08/15/2022	600	587
Duquesne Light Holdings, Inc.			
6.400%	期日 09/15/2020	1,000	1,046
El Paso Natural Gas Co. LLC			
8.625%	期日 01/15/2022	1,900	2,162
Enable Midstream Partners LP			
4.950%	期日 05/15/2028	1,249	1,224
Enbridge, Inc.			
2.814%	期日 01/10/2020	8,800	8,788
3.034%	期日 06/15/2020	4,400	4,406
Florida Gas Transmission Co. LLC			
5.450%	期日 07/15/2020	790	813
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
4.375%	期日 09/19/2022	5,550	5,446
6.000%	期日 11/27/2023	11,200	11,574
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.			
3.375%	期日 11/30/2018	CHF 1,100	1,096
3.389%	期日 03/20/2020	EUR 4,900	5,761
3.600%	期日 02/26/2021	5,500	6,600
4.950%	期日 02/06/2028	USD 200	191
5.338%	期日 09/25/2020	GBP 1,230	1,644
5.999%	期日 01/23/2021	USD 2,322	2,385
6.510%	期日 03/07/2022	6,398	6,711
7.288%	期日 08/16/2037	500	553
8.625%	期日 04/28/2034	2,372	2,909
9.250%	期日 04/23/2019	20,950	21,456
Global Switch Holdings Ltd.			
2.250%	期日 05/31/2027	EUR 100	112
Iberdrola Finance Ireland DAC			
5.000%	期日 09/11/2019	USD 2,000	2,031
Israel Electric Corp. Ltd.			
7.250%	期日 01/15/2019	557	562
Kinder Morgan Energy Partners LP			
6.850%	期日 02/15/2020	2,750	2,869
Korea National Oil Corp.			
2.125%	期日 04/14/2021	600	579
Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd.			
6.350%	期日 12/01/2021	491	485
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.			
6.720%	期日 12/01/2022	232	223
ONEOK, Inc.			
4.550%	期日 07/15/2028	1,446	1,418
5.200%	期日 07/15/2048	1,180	1,145
Petrobras Global Finance BV			
5.299%	期日 01/27/2025	535	512
5.875%	期日 03/07/2022	EUR 800	1,021

5.999% 期日 01/27/2028	USD	11,921	11,337
6.125% 期日 01/17/2022		6,576	6,831
6.250% 期日 12/14/2026	GBP	2,831	3,771
6.625% 期日 01/16/2034		2,900	3,754
6.850% 期日 06/05/2115	USD	990	881
7.375% 期日 01/17/2027		18,022	18,713
8.375% 期日 12/10/2018		1,000	1,006
8.750% 期日 05/23/2026		2,340	2,618
Plains All American Pipeline LP			
6.650% 期日 01/15/2037		416	446
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1			
9.250% 期日 07/06/2024		2,992	3,205
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			
9.750% 期日 01/06/2027		896	975
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1			
8.200% 期日 04/06/2028		2,800	2,918
Rockpoint Gas Storage Canada Ltd.			
7.000% 期日 03/31/2023		150	150
Rosneft Finance S.A.			
7.250% 期日 02/02/2020		750	775
Sabine Pass Liquefaction LLC			
5.625% 期日 02/01/2021		664	687
Sempra Energy			
2.784% 期日 03/15/2021		8,200	8,197
SGSP Australia Assets Pty Ltd.			
3.300% 期日 04/09/2023		250	243
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.			
2.500% 期日 04/28/2020		200	197
Sinopec Group Overseas Development 2016 Ltd.			
1.750% 期日 09/29/2019		200	197
2.125% 期日 05/03/2019		200	199
Southern Co.			
2.750% 期日 06/15/2020		396	392
Sprint Capital Corp.			
6.900% 期日 05/01/2019		33,951	34,480
Sprint Communications, Inc.			
7.000% 期日 08/15/2020		17,292	17,940
9.000% 期日 11/15/2018		1,349	1,353
Sprint Corp.			
7.250% 期日 09/15/2021		24,594	25,762
7.625% 期日 03/01/2026		4,122	4,297
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.			
2.750% 期日 05/07/2019		900	897
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.			
2.250% 期日 05/04/2020		200	196
Transocean Phoenix 2 Ltd.			
7.750% 期日 10/15/2024		1,680	1,743
Transocean Proteus Ltd.			
6.250% 期日 12/01/2024		46	46

	Verizon Communications, Inc.			
	2.875% 期日 01/15/2038	EUR	1,680	1,873
	3.375% 期日 10/27/2036	GBP	680	853
	5.250% 期日 03/16/2037	USD	1,690	1,743
				317,381
	社債券等合計			3,885,502
	(原価: 4,003,507米ドル)			
転換社債及び短期証券	Caesars Entertainment Corp.			
0.0%	5.000% 期日 10/01/2024		2,906	4,157
	転換社債及び短期証券合計			4,157
	(原価: 4,695米ドル)			
地方債	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			
0.5%	6.630% 期日 02/01/2035		655	684
	6.725% 期日 04/01/2035		280	294
	7.350% 期日 07/01/2035		545	594
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2003			
	5.100% 期日 06/01/2033		1,740	1,645
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2014			
	6.314% 期日 01/01/2044		220	214
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015			
	7.375% 期日 01/01/2033		440	476
	7.750% 期日 01/01/2042		780	828
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017			
	7.045% 期日 01/01/2029		370	391
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2001			
	5.125% 期日 07/01/2031		17,360	10,459
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2006			
	5.000% 期日 07/01/2031		420	253
	5.250% 期日 07/01/2023		500	301
	5.250% 期日 07/01/2026		1,000	603
	5.250% 期日 07/01/2049		610	366
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2007			
	5.000% 期日 07/01/2027		700	422
	5.000% 期日 07/01/2028		75	45
	5.250% 期日 07/01/2032		400	241
	5.250% 期日 07/01/2034		400	241
	5.250% 期日 07/01/2037		410	247
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2008			
	5.000% 期日 07/01/2023		300	181
	5.125% 期日 07/01/2028		130	78
	5.500% 期日 07/01/2032		10,780	6,495
	5.700% 期日 07/01/2023		685	385
	6.000% 期日 07/01/2038		4,070	2,452

	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2009		
	5.750% 期日 07/01/2038	550	331
	6.000% 期日 07/01/2039	215	130
	6.500% 期日 07/01/2037	400	241
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2011		
	5.375% 期日 07/01/2030	685	403
	5.750% 期日 07/01/2041	1,900	1,116
	6.500% 期日 07/01/2040	120	71
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2012		
	4.125% 期日 07/01/2022	500	276
	5.000% 期日 07/01/2021	1,010	593
	5.000% 期日 07/01/2041	3,660	2,150
	5.125% 期日 07/01/2037	800	470
	5.500% 期日 07/01/2026	1,900	1,116
	5.500% 期日 07/01/2039	4,215	2,476
	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2014		
	8.000% 期日 07/01/2035	13,450	7,969
	Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010		
	6.050% 期日 07/01/2032	800	499
	Puerto Rico Electric Power Authority, General Obligation Bonds, Series 2010		
	6.125% 期日 07/01/2040	3,000	1,871
	Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2016		
	3.031% 期日 09/25/2056	1,245	1,246
	Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2017		
	3.031% 期日 01/25/2057	11,479	11,494
	Travis, Texas, Texas Public Finance Authority Revenue Bonds, Series 2014		
	8.250% 期日 07/01/2024	400	408
	地方債合計		60,755
	(原価：37,558米ドル)		
米国政府機関債	Fannie Mae		
9.8%	2.500% 期日 10/01/2022	377	371
	2.581% 期日 05/25/2048	5,795	5,776
	3.000% 期日 05/25/2048	14,487	13,659
	3.500% 期日 08/01/2042	63	62
	3.500% 期日 09/01/2047	962	938
	3.500% 期日 03/01/2048	250	243
	3.500% 期日 04/01/2048	487	475
	3.919% 期日 05/25/2048	5,795	1,086
	4.000% 期日 07/01/2040	154	155
	4.000% 期日 12/01/2041	195	194
	4.000% 期日 07/01/2042	324	323
	4.000% 期日 08/01/2042	88	88
	4.000% 期日 09/01/2042	342	341

4.000% 期日 07/01/2045	2,839	2,852
4.000% 期日 11/01/2045	499	500
4.000% 期日 03/01/2047	288	289
4.000% 期日 04/01/2047	1,035	1,040
4.000% 期日 08/01/2047	24,296	24,321
4.000% 期日 12/01/2047	295	295
4.000% 期日 01/01/2048	250	250
4.000% 期日 08/01/2048	3,994	3,998
4.000% 期日 09/01/2048	30,204	30,233
4.500% 期日 05/01/2033	20	20
4.500% 期日 07/01/2033	37	38
4.500% 期日 05/01/2034	10	10
4.500% 期日 05/01/2035	7	7
4.500% 期日 09/01/2035	8	9
4.500% 期日 02/01/2038	2	2
4.500% 期日 01/01/2041	533	539
4.750% 期日 06/01/2033	216	218
5.000% 期日 10/01/2035	78	79
5.000% 期日 12/01/2035	312	319
5.000% 期日 10/01/2036	7	8
5.000% 期日 05/01/2038	4	4
5.000% 期日 11/01/2039	12	13
5.000% 期日 10/01/2051	458	471
5.500% 期日 07/01/2033	45	47
5.500% 期日 06/01/2035	847	882
5.500% 期日 04/01/2036	2	2
5.500% 期日 11/01/2036	11	12
5.500% 期日 03/01/2037	20	20
5.500% 期日 09/01/2037	25	26
5.500% 期日 02/01/2038	4	4
5.500% 期日 04/01/2038	35	36
6.000% 期日 08/01/2031	31	31
6.000% 期日 06/01/2032	8	8
6.000% 期日 09/01/2039	425	446
6.000% 期日 10/01/2047	28	29
6.500% 期日 01/01/2037	5	6
6.500% 期日 10/01/2037	13	14
7.000% 期日 09/01/2031	38	38
7.000% 期日 05/01/2037	3	3
7.500% 期日 09/01/2032	12	12
Fannie Mae, TBA		
2.500% 期日 12/01/2033	3,000	2,869
3.000% 期日 12/01/2033	9,500	9,310
3.000% 期日 12/01/2048	107,600	101,649
3.000% 期日 01/01/2049	5,000	4,719
3.500% 期日 12/01/2048	251,000	244,012
3.500% 期日 01/01/2049	148,000	143,741
4.000% 期日 12/01/2048	209,825	209,566
4.000% 期日 01/01/2049	173,675	173,264
Freddie Mac		
3.000% 期日 11/01/2046	227	215
3.000% 期日 12/01/2047	8,620	8,161
3.000% 期日 03/01/2048	500	473
3.000% 期日 06/01/2048	26,680	25,259
3.000% 期日 07/01/2048	60,396	57,180
3.000% 期日 09/01/2048	377	357
3.500% 期日 10/01/2047	9,419	9,178
3.500% 期日 12/01/2047	3,609	3,516
3.500% 期日 03/01/2048	11,542	11,246
3.500% 期日 04/01/2048	4,416	4,303
3.500% 期日 10/01/2048	9,969	9,712
4.000% 期日 09/01/2033	6	6

	4.271% 期日 06/15/2042	88	16
	4.500% 期日 12/01/2019	1	1
	4.500% 期日 05/01/2036	6	6
	5.000% 期日 06/01/2034	483	495
	5.000% 期日 08/01/2035	99	101
	5.000% 期日 01/01/2037	4	4
	5.000% 期日 01/01/2038	4	4
	5.500% 期日 01/01/2035	1,561	1,637
	5.500% 期日 05/01/2037	7	7
	5.500% 期日 06/01/2037	279	291
	5.500% 期日 07/01/2037	41	42
	5.750% 期日 05/01/2037	443	474
	6.000% 期日 07/01/2037	52	54
	Freddie Mac, TBA		
	3.500% 期日 11/01/2048	20,000	19,469
	3.500% 期日 12/01/2048	15,000	14,585
	Ginnie Mae		
	4.500% 期日 01/20/2040	250	256
	4.500% 期日 03/20/2040	39	39
	5.000% 期日 08/20/2030	849	892
	5.000% 期日 05/20/2040	680	698
	5.000% 期日 11/20/2040	39	40
	5.000% 期日 04/20/2041	27	27
	5.500% 期日 05/20/2038	14	14
	5.500% 期日 06/20/2038	216	222
	5.500% 期日 07/20/2038	86	87
	5.500% 期日 08/20/2038	664	683
	5.500% 期日 09/20/2038	406	417
	5.500% 期日 10/20/2038	47	48
	5.500% 期日 01/20/2039	12	12
	5.500% 期日 02/20/2039	84	86
	5.500% 期日 07/20/2039	65	67
	5.500% 期日 09/20/2039	165	170
	5.500% 期日 10/20/2039	288	295
	5.500% 期日 11/20/2039	435	446
	5.500% 期日 12/20/2039	28	29
	5.500% 期日 01/20/2040	365	374
	5.500% 期日 06/20/2040	573	607
	5.500% 期日 07/20/2040	543	557
	米国政府機関債合計		1,152,830
	(原価: 1,158,405米ドル)		
	Treasury Inflation		
米国財務省証券	Protected Securities		
9.3%	0.125% 期日 04/15/2020	1,184	1,164
	0.375% 期日 01/15/2027	5	5
	0.625% 期日 07/15/2021	78	78
	2.375% 期日 01/15/2025	26,513	28,587
	U.S. Treasury Bonds		
	2.125% 期日 08/15/2021	65,100	63,710
	2.250% 期日 08/15/2046	100	79
	2.500% 期日 05/15/2024	98,000	95,410
	2.750% 期日 08/15/2047	2,830	2,490
	3.000% 期日 08/15/2048	230	213
	3.125% 期日 05/15/2048	180	171
	U.S. Treasury Notes		
	1.125% 期日 09/30/2021	37,390	35,515
	1.375% 期日 08/31/2023	56,200	52,141
	1.500% 期日 01/31/2022	200	191
	1.625% 期日 02/15/2026	2,200	1,991
	1.750% 期日 11/30/2021	26,400	25,482
	1.750% 期日 03/31/2022	9,300	8,939

	1.750% 期日 05/15/2022	5,400	5,182
	1.750% 期日 09/30/2022	11,500	10,984
	1.875% 期日 08/31/2022	24,200	23,245
	2.000% 期日 10/31/2021	2,700	2,628
	2.000% 期日 07/31/2022	7,400	7,149
	2.000% 期日 05/31/2024	33,500	31,757
	2.000% 期日 06/30/2024	142,800	135,225
	2.000% 期日 02/15/2025	11,021	10,355
	2.000% 期日 08/15/2025	1,400	1,308
	2.000% 期日 11/15/2026	800	737
	2.125% 期日 12/31/2021	30,200	29,461
	2.125% 期日 06/30/2022	19,600	19,035
	2.125% 期日 07/31/2024	21,800	20,761
	2.125% 期日 09/30/2024	117,000	111,237
	2.250% 期日 12/31/2023	89,100	85,933
	2.250% 期日 10/31/2024	203,550	194,756
	2.250% 期日 11/15/2024	63,300	60,531
	2.250% 期日 02/15/2027	28,000	26,220
	2.375% 期日 05/15/2027	5,836	5,509
	2.750% 期日 02/15/2024	2,800	2,765
	米国財務省証券合計		1,100,944
	(原価:1,146,414米ドル)		
	Accredited Mortgage Loan Trust		
36.8%	3.226% 期日 07/25/2035	9,806	9,699
	3.976% 期日 07/25/2035	715	626
	ACE Securities Corporation		
	Home Equity Loan Trust		
	2.436% 期日 08/25/2036	8,447	8,226
	3.076% 期日 01/25/2035	1,336	1,325
	3.106% 期日 02/25/2034	6,677	6,541
	3.181% 期日 08/25/2035	5,023	4,848
	Adjustable Rate Mortgage Trust		
	3.231% 期日 08/25/2035	7,287	7,079
	AFC Home Equity Loan Trust		
	3.091% 期日 06/25/2029	2,523	2,231
	ALESCO Preferred Funding Ltd.		
	2.816% 期日 12/23/2036	5,000	4,250
	Alternative Loan Trust		
	2.451% 期日 01/25/2037	10,297	10,096
	2.451% 期日 07/25/2046	9,685	9,317
	2.461% 期日 07/25/2036	13,513	12,684
	2.470% 期日 09/20/2046	2,554	2,192
	2.471% 期日 08/25/2046	19,178	15,325
	2.481% 期日 05/25/2036	23,118	20,769
	2.490% 期日 03/20/2046	11,026	10,041
	2.531% 期日 12/25/2046	26,525	24,008
	2.551% 期日 07/25/2036	23,331	18,905
	2.881% 期日 01/25/2036	3,845	3,738
	3.296% 期日 08/25/2035	787	738
	3.796% 期日 08/25/2035	857	816
	4.358% 期日 09/25/2034	1,859	1,813
	5.500% 期日 06/25/2035	9,338	9,336
	5.500% 期日 08/25/2035	117	113
	5.500% 期日 02/25/2036	27	24
	6.000% 期日 07/25/2037	34,803	25,959
	7.000% 期日 10/25/2037	41,809	26,317
	Ameriquest Mortgage Securities Trust		
	2.621% 期日 04/25/2036	10,400	10,272

2.691% 期日 03/25/2036	27,500	25,953
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
3.287% 期日 09/25/2032	635	638
4.036% 期日 10/25/2034	9,000	7,776
Argent Mortgage Loan Trust		
2.521% 期日 05/25/2035	35,304	33,657
Argent Securities Trust		
2.461% 期日 04/25/2036	8,935	3,829
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
2.791% 期日 10/25/2035	36,400	35,618
4.467% 期日 09/25/2033	2,189	2,207
Asset-Backed Funding Certificates Trust		
2.941% 期日 03/25/2035	9,929	9,925
3.016% 期日 06/25/2035	12,354	12,118
Asset-Backed Pass-Through Certificates		
3.331% 期日 04/25/2035	7,004	6,919
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
2.591% 期日 05/25/2036	15,933	13,122
Atrium Hotel Portfolio Trust		
3.710% 期日 06/15/2035	18,395	18,429
Banc of America Alternative Loan Trust		
5.586% 期日 04/25/2022	270	268
6.000% 期日 07/25/2046	3,203	2,847
Banc of America Commercial Mortgage Trust		
6.041% 期日 09/10/2045	8,787	8,998
BCAP LLC Trust		
2.365% 期日 07/26/2036	547	527
5.876% 期日 04/26/2037	5,375	4,421
6.183% 期日 04/26/2036	9,239	7,686
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
4.189% 期日 11/25/2034	376	368
Bear Stearns Alternative-A Trust		
2.451% 期日 04/25/2037	12,799	10,113
2.491% 期日 11/25/2046	9,146	9,282
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
2.481% 期日 04/25/2037	4,996	6,669
2.521% 期日 02/25/2037	8,735	9,686
2.641% 期日 04/25/2036	12,900	12,812
2.681% 期日 02/25/2036	7,436	7,390
2.681% 期日 05/25/2036	14,013	7,741
2.711% 期日 12/25/2035	9,109	9,151
2.781% 期日 12/25/2035	3,782	3,785
2.981% 期日 11/25/2035	5,796	4,692
3.001% 期日 12/25/2035	10,390	8,141
3.331% 期日 08/25/2037	27,600	24,956
4.319% 期日 05/25/2036	14,013	706

Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
2.541% 期日 10/25/2036	6,408	6,420
4.241% 期日 06/25/2035	3,853	3,773
Bear Stearns Mortgage Funding Trust		
2.481% 期日 02/25/2037	10,666	10,995
Bsprt Issuer Ltd.		
3.630% 期日 06/15/2027	2,283	2,287
4.680% 期日 06/15/2027	1,300	1,310
BX Trust		
3.160% 期日 07/15/2034	8,592	8,593
3.200% 期日 07/15/2034	7,271	7,270
3.430% 期日 07/15/2034	2,261	2,262
Caesars Palace Las Vegas Trust		
4.354% 期日 10/15/2034	9,700	9,593
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage		
5.540% 期日 01/25/2039	2,052	1,717
Centex Home Equity Loan Trust		
2.926% 期日 03/25/2035	5,514	5,461
CGGS Commercial Mortgage Trust		
3.180% 期日 02/15/2037	23,290	23,293
3.630% 期日 02/15/2037	9,280	9,310
4.580% 期日 02/15/2037	22,780	22,885
CGMS Commercial Mortgage Trust		
3.380% 期日 07/15/2030	16,004	15,952
ChaseFlex Trust		
2.581% 期日 07/25/2037	1,694	1,594
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates		
2.641% 期日 03/25/2035	843	849
CIT Mortgage Loan Trust		
3.631% 期日 10/25/2037	20,578	20,847
Citigroup Commercial Mortgage Trust		
0.254% 期日 03/10/2047	25,400	405
Citigroup Mortgage Loan Trust		
2.356% 期日 08/25/2036	15,558	7,459
2.421% 期日 12/25/2036	6,734	6,572
2.681% 期日 03/25/2037	15,986	15,916
2.791% 期日 01/25/2036	40	41
2.901% 期日 12/25/2035	3,641	3,656
3.841% 期日 08/25/2036	8,825	8,649
6.750% 期日 05/25/2036	14,014	10,601
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
2.541% 期日 01/25/2037	1,860	1,842
2.861% 期日 07/25/2035	3,174	3,198
3.316% 期日 05/25/2035	6,300	6,124
Civic Mortgage LLC		
4.350% 期日 11/25/2022	1,800	1,800
COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust		
5.617% 期日 04/15/2047	17,300	17,457

Commercial Mortgage Trust		
0.149% 期日 04/10/2047	33,000	307
Conseco Financial Corp.		
6.870% 期日 04/01/2030	4,903	5,196
6.920% 期日 12/01/2030	3,071	3,383
7.500% 期日 03/01/2030	60,063	42,630
7.600% 期日 04/15/2026	5,036	4,065
7.700% 期日 09/15/2026	2,218	2,382
Countrywide Asset-Backed Certificates		
2.421% 期日 06/25/2035	2,718	2,488
2.421% 期日 06/25/2037	22,935	21,767
2.421% 期日 07/25/2037	3,183	2,819
2.431% 期日 04/25/2047	8,451	8,144
2.441% 期日 05/25/2037	24,425	24,082
2.451% 期日 06/25/2047	2,477	2,462
2.461% 期日 11/25/2047	16,875	15,141
2.501% 期日 08/25/2037	25,800	22,917
2.511% 期日 05/25/2037	12,783	11,726
2.511% 期日 10/25/2047	29,628	28,727
2.521% 期日 05/25/2036	10,519	7,593
2.631% 期日 03/25/2036	2,010	1,841
2.681% 期日 06/25/2036	6,300	6,215
2.701% 期日 01/25/2045	7,235	7,221
2.721% 期日 04/25/2036	10,000	10,006
2.794% 期日 08/26/2033	478	456
3.011% 期日 06/25/2035	7,000	6,458
3.031% 期日 02/25/2034	9,373	9,333
3.436% 期日 06/25/2033	831	797
3.886% 期日 01/25/2034	478	477
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
3.935% 期日 06/25/2034	2	3
4.163% 期日 11/25/2034	20	20
5.500% 期日 11/25/2035	9,828	8,361
6.000% 期日 07/25/2036	39,450	33,487
6.000% 期日 11/25/2037	7,975	6,856
Credit Suisse Mortgage Capital		
2.386% 期日 11/27/2036	8,096	8,380
3.000% 期日 01/29/2036	2,885	2,886
3.000% 期日 06/27/2037	7,757	7,704
3.000% 期日 07/25/2037	576	574
3.955% 期日 08/28/2036	2,320	2,327
6.419% 期日 10/26/2036	392	354
Credit Suisse Mortgage Capital Trust		
0.000% 期日 01/25/2058	81	80
0.000% 期日 04/25/2058	3	3
3.030% 期日 07/15/2032	5,200	5,202
3.280% 期日 07/15/2032	4,000	4,002
3.480% 期日 07/15/2032	2,400	2,402
3.530% 期日 01/25/2058	28,029	25,108
3.703% 期日 04/25/2058	81,424	80,714
4.057% 期日 06/01/2050	174,245	179,311
4.195% 期日 06/25/2050	44,492	33,842
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
6.980% 期日 03/25/2046	4,266	4,298

Credit-Based Asset			
Servicing & Securitization			
Trust			
2.431% 期日 07/25/2036		5,353	5,326
CS First Boston Mortgage			
Securities Corp.			
4.731% 期日 01/25/2033		2,644	2,558
CWABS Asset-Backed			
Certificates Trust			
2.521% 期日 03/25/2037		33,000	30,769
2.521% 期日 03/25/2047		26,535	23,591
3.001% 期日 05/25/2036		3,028	1,201
3.331% 期日 03/25/2035		5,500	5,553
3.406% 期日 12/25/2034		2,294	2,338
4.561% 期日 06/25/2035		8,644	7,865
CWHEQ Revolving Home			
Equity Loan Resuritization			
Trust			
2.530% 期日 03/15/2030		7,723	7,714
Deutsche Alternative-A			
Securities Mortgage Loan			
Trust			
2.441% 期日 03/25/2037		15,112	10,568
2.611% 期日 08/25/2037		44,195	38,975
Deutsche Alternative-A			
Securities, Inc. Mortgage			
Loan Trust			
4.409% 期日 10/25/2035		17,707	17,204
Deutsche Mortgage & Asset			
Receiving Corp.			
2.456% 期日 11/27/2036		6,595	6,435
Downey Savings & Loan			
Association Mortgage Loan			
Trust			
2.472% 期日 10/19/2036		14,386	12,837
2.582% 期日 10/19/2045		4,694	4,719
2.612% 期日 09/19/2045		9,020	7,573
Dragon Finance BV			
1.911% 期日 07/13/2023	GBP	219	272
Dutch Property Finance BV			
0.363% 期日 01/28/2048	EUR	22,500	25,576
EMC Mortgage Loan Trust			
3.337% 期日 04/25/2042	USD	10,016	8,531
3.787% 期日 04/25/2042		345	345
Encore Credit Receivables			
Trust			
3.211% 期日 11/25/2035		6,510	6,397
Eurosail PLC			
0.972% 期日 09/10/2044	GBP	1,001	1,272
Eurosail-UK PLC			
1.570% 期日 09/13/2045		6,707	8,346
1.750% 期日 06/13/2045		16,646	21,139
FBR Securitization Trust			
2.956% 期日 10/25/2035	USD	20,968	15,112
2.961% 期日 10/25/2035		15,721	15,608
3.046% 期日 09/25/2035		7,500	7,016
Finsbury Square PLC			
1.451% 期日 09/12/2065	GBP	35,762	45,588
First Franklin Mortgage			
Loan Trust			
2.431% 期日 07/25/2036	USD	1,084	1,080
2.441% 期日 04/25/2036		7,476	7,305

2.741% 期日 01/25/2036		10,000	9,302
2.986% 期日 05/25/2036		6,259	6,331
3.136% 期日 04/25/2035		5,000	5,028
First Horizon Alternative			
Mortgage Securities Trust			
2.719% 期日 05/25/2035		2,655	209
2.781% 期日 05/25/2035		2,656	2,178
6.000% 期日 08/25/2036		7,764	6,315
Fremont Home Loan Trust			
2.421% 期日 02/25/2037		11,247	8,952
3.301% 期日 01/25/2035		6,493	6,113
GE Business Loan Trust			
0.718% 期日 11/15/2034		2,979	2,929
GMAC Commercial Mortgage			
Asset Corp.			
5.456% 期日 03/10/2051		12,562	11,993
Great Wolf Trust			
3.280% 期日 09/15/2034		8,400	8,410
3.480% 期日 09/15/2034		13,900	13,895
GreenPoint Mortgage			
Funding Trust			
2.841% 期日 11/25/2045		110	94
Grifonas Finance PLC			
0.014% 期日 08/28/2039	EUR	1,124	1,159
GS Mortgage Securities			
Corp. II			
3.419% 期日 10/10/2032	USD	3,300	3,265
4.591% 期日 10/10/2032		7,600	7,366
GSAA Home Equity Trust			
6.500% 期日 11/25/2037		25	19
GSAMP Trust			
2.431% 期日 06/25/2036		4,450	4,423
2.441% 期日 01/25/2037		24,439	16,597
2.441% 期日 05/25/2046		1,352	1,342
2.541% 期日 06/25/2036		20,000	19,072
2.926% 期日 11/25/2035		7,838	5,850
GSMSC Resecuritization			
Trust			
2.396% 期日 09/26/2036		5,801	4,170
6.259% 期日 04/26/2037		37,656	13,057
GSR Mortgage Loan Trust			
2.581% 期日 03/25/2037		11,057	4,391
4.419% 期日 03/25/2037		11,057	2,090
HarborView Mortgage Loan			
Trust			
2.522% 期日 12/19/2036		1,718	1,599
2.842% 期日 02/19/2036		20,292	18,803
2.922% 期日 08/19/2045		13,914	13,563
Hawksmoor Mortgages PLC			
2.206% 期日 05/25/2053	GBP	7,174	9,214
Home Equity Asset Trust			
2.521% 期日 10/25/2036	USD	23,475	9,736
2.591% 期日 07/25/2036		415	417
Home Equity Mortgage Loan			
Asset-Backed Trust			
2.421% 期日 11/25/2036		21,779	20,701
2.461% 期日 06/25/2036		5,268	5,115
2.521% 期日 04/25/2037		18,323	13,829
3.271% 期日 08/25/2035		5,750	5,687
HSI Asset Securitization			
Corp. Trust			
2.531% 期日 05/25/2037		7,197	6,611

Hyatt Hotel Portfolio Trust		
2.938% 期日 08/09/2032	2,900	2,895
4.134% 期日 08/09/2032	1,967	1,969
Impac CMB Trust		
2.961% 期日 01/25/2035	22,388	22,063
Impac Secured Assets Trust		
2.471% 期日 01/25/2037	5,256	4,435
IMT Trust		
2.980% 期日 06/15/2034	2,400	2,401
3.230% 期日 06/15/2034	1,800	1,801
3.380% 期日 06/15/2034	1,100	1,101
IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust		
6.500% 期日 10/25/2037	11,546	10,037
IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust		
3.700% 期日 06/25/2037	14,208	12,296
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
2.461% 期日 02/25/2037	42,870	40,500
2.471% 期日 10/25/2036	8,117	5,424
3.537% 期日 07/25/2037	33,248	31,543
3.566% 期日 04/25/2037	12,315	11,525
3.620% 期日 04/25/2037	24,087	22,386
3.736% 期日 03/25/2036	7,884	7,203
3.895% 期日 11/25/2036	21,936	18,987
IXIS Real Estate Capital Trust		
3.046% 期日 12/25/2035	10,012	9,917
Jefferies Resecuritization Trust		
7.511% 期日 06/25/2047	1,110	994
JP Morgan Alternative Loan Trust		
2.561% 期日 04/25/2047	4,680	4,616
3.725% 期日 03/25/2036	727	682
5.730% 期日 03/25/2036	456	495
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
3.130% 期日 10/15/2032	11,125	11,129
3.380% 期日 10/15/2032	7,000	7,006
3.680% 期日 10/15/2032	7,200	7,213
4.420% 期日 10/15/2032	11,000	11,042
5.337% 期日 05/15/2047	332	333
JP Morgan Mortgage Acquisition Corp.		
2.461% 期日 03/25/2036	17,779	17,510
JP Morgan Mortgage Acquisition Trust		
2.481% 期日 05/25/2036	6,835	6,828
2.531% 期日 07/25/2036	11,062	10,920
2.551% 期日 05/25/2036	12,851	12,381
2.551% 期日 08/25/2036	8,600	6,718
2.551% 期日 06/25/2037	34,606	32,386
2.561% 期日 06/25/2037	22,826	19,293
JP Morgan Mortgage Trust		
2.581% 期日 10/25/2035	8,776	7,388
4.090% 期日 01/25/2037	1,160	1,113
JP Morgan Resecuritization Trust		
3.348% 期日 05/26/2037	13,440	11,135

3.710% 期日 02/26/2037		5,471	5,343
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			
0.000% 期日 06/15/2045	EUR	6,200	6,604
LB-UBS Commercial Mortgage Trust			
6.114% 期日 07/15/2040	USD	67	67
Legacy Mortgage Asset Trust			
3.992% 期日 01/28/2070		188,992	193,571
Lehman XS Trust			
2.471% 期日 09/25/2036		11,916	10,418
2.471% 期日 12/25/2036		11,694	8,387
2.481% 期日 02/25/2037		24,317	23,213
2.541% 期日 02/25/2047		26,054	23,848
6.500% 期日 06/25/2046		7,979	7,366
Liberty Funding Pty Ltd.			
2.510% 期日 10/10/2049	AUD	82	58
3.120% 期日 10/10/2049		16,500	11,674
Long Beach Mortgage Loan Trust			
2.471% 期日 02/25/2036	USD	7,350	6,188
2.471% 期日 03/25/2046		39,228	19,069
2.761% 期日 01/25/2046		310	311
4.381% 期日 06/25/2034		1,252	1,249
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
5.531% 期日 03/25/2032		3,600	3,684
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
3.742% 期日 04/25/2034		4	4
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
2.501% 期日 11/25/2036		37	26
2.651% 期日 01/25/2036		7,500	6,865
3.431% 期日 08/25/2037		18,185	15,756
MASTR Specialized Loan Trust			
2.761% 期日 02/25/2036		5,799	5,103
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			
3.281% 期日 10/25/2037		17,806	18,018
3.781% 期日 10/25/2037		30,178	30,428
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
2.421% 期日 05/25/2037		24,827	15,229
2.661% 期日 08/25/2035		30	30
3.001% 期日 07/25/2034		5,835	5,703
3.076% 期日 09/25/2035		6,596	6,583
3.361% 期日 10/25/2035		2,353	2,338
4.101% 期日 02/25/2033		30	29
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital, Inc. Trust			
2.406% 期日 07/25/2036		8,517	7,536
2.431% 期日 07/25/2036		58,767	30,727
2.521% 期日 06/25/2036		32,000	26,847
2.531% 期日 07/25/2036		58,479	31,105
2.551% 期日 03/25/2036		9,601	9,471
2.986% 期日 07/25/2035		3,105	3,113

3.016% 期日 07/25/2035	6,912	6,745
3.196% 期日 11/25/2034	3,529	3,500
3.281% 期日 03/25/2033	131	129
3.281% 期日 07/25/2037	549	541
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
0.827% 期日 11/15/2052	138,566	7,637
Morgan Stanley Capital , Inc. Trust		
2.641% 期日 02/25/2036	18,299	13,836
Morgan Stanley Dean Witter Capital Trust		
7.602% 期日 07/15/2033	4,175	4,384
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
2.621% 期日 02/25/2036	13,790	13,072
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital		
2.511% 期日 07/25/203	13,212	7,428
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		
3.681% 期日 11/25/2037	2,337	1,998
6.000% 期日 12/25/2035	974	770
Morgan Stanley Reremic Trust		
2.376% 期日 11/26/2036	12,808	12,330
Mortgage Loan Trust		
4.870% 期日 03/25/2034	3,310	3,238
Motel 6 Trust		
3.200% 期日 08/15/2034	29,871	29,888
3.470% 期日 08/15/2034	26,197	26,213
4.430% 期日 08/15/2034	2,707	2,714
Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates		
6.450% 期日 01/22/2026	195	198
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust		
3.030% 期日 02/15/2033	9,300	9,305
3.380% 期日 02/15/2033	8,265	8,269
3.790% 期日 11/15/2032	1,400	1,352
4.330% 期日 02/15/2033	3,600	3,607
New York Mortgage Trust		
2.821% 期日 04/25/2035	1,766	1,713
Newgate Funding PLC		
0.957% 期日 12/15/2050	GBP 22,200	26,022
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust		
5.034% 期日 05/25/2035	USD 5,014	3,735
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust		
2.791% 期日 05/25/2035	7,400	7,061
5.745% 期日 10/25/2036	25,528	10,394
Nomura Resecuritization Trust		
1.535% 期日 03/26/2037	8,819	5,324
3.752% 期日 11/26/2036	3,892	3,900

NovaStar Mortgage Funding Trust			
2.441%	期日 10/25/2036	7,084	4,473
2.481%	期日 09/25/2037	43,034	41,896
2.601%	期日 05/25/2036	17,302	17,126
3.001%	期日 10/25/2035	2,500	2,416
Oncilla Mortgage Funding PLC			
2.201%	期日 12/12/2043	GBP 10,392	13,395
Option One Mortgage Loan Trust			
2.381%	期日 02/25/2037	USD 6,524	4,128
2.401%	期日 03/25/2037	18,657	16,938
2.421%	期日 03/25/2037	53,319	48,047
Paragon Mortgages No.13 PLC			
1.042%	期日 01/15/2039	GBP 3,995	4,877
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
2.771%	期日 09/25/2035	USD 4,713	4,722
2.801%	期日 09/25/2035	25,075	21,813
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
2.441%	期日 09/25/2036	28,896	8,890
PFP Ltd.			
3.160%	期日 07/14/2035	5,513	5,518
3.530%	期日 07/14/2035	3,139	3,144
Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust			
2.591%	期日 11/25/2036	11,582	8,407
5.250%	期日 07/25/2035	9,601	7,766
Precise Mortgage Funding PLC			
1.451%	期日 12/12/2054	GBP 6,096	7,753
Quest Trust			
3.706%	期日 03/25/2035	USD 6,060	5,761
RAAC Trust			
2.751%	期日 02/25/2036	6,250	5,964
3.031%	期日 06/25/2047	23,049	16,106
RBSGC Mortgage Loan Trust			
6.000%	期日 01/25/2037	9	8
RBSSP Resecuritization Trust			
2.718%	期日 04/26/2037	177	177
Renaissance Home Equity Loan Trust			
2.641%	期日 11/25/2034	63	59
3.281%	期日 09/25/2037	60	49
5.612%	期日 04/25/2037	10,165	4,854
5.675%	期日 06/25/2037	3,910	1,756
Renoir CDO BV			
0.532%	期日 10/07/2095	EUR 3,624	4,108
1.582%	期日 10/07/2095	5,490	6,212
5.184%	期日 10/07/2095	5,159	5,898
Residential Accredited Securities Corporation Trust			
2.431%	期日 01/25/2037	USD 2,188	2,172
2.441%	期日 11/25/2036	6,969	6,679
2.501%	期日 02/25/2037	14,000	13,029

2.581% 期日 01/25/2037		36,989	21,863
2.611% 期日 04/25/2036		17,500	17,420
2.931% 期日 09/25/2035		7,400	7,350
3.046% 期日 03/25/2034		4,110	4,125
3.856% 期日 04/25/2034		1,804	1,702
Residential Asset Mortgage			
Products Trust			
2.501% 期日 10/25/2034		2,267	2,219
2.621% 期日 12/25/2035		17,489	14,949
2.781% 期日 09/25/2035		12,591	12,233
2.941% 期日 10/25/2035		4,024	4,047
2.956% 期日 11/25/2035		13,000	12,817
Residential Asset			
Securitization Trust			
5.500% 期日 10/25/2035		4,618	4,387
Residential Mortgage			
Securities 29 PLC			
1.754% 期日 12/20/2046	GBP	10,233	13,106
Residential Mortgage			
Securities 30 PLC			
1.604% 期日 03/20/2050		12,593	16,069
Ripon Mortgages PLC			
1.605% 期日 08/20/2056		21,413	27,382
Rochester Financing No.2			
PLC			
2.100% 期日 06/20/2045		8,048	10,357
Saxon Asset Securities			
Trust			
3.076% 期日 03/25/2035	USD	2,192	2,147
3.331% 期日 06/25/2033		1,280	1,282
4.031% 期日 12/25/2037		6,794	6,811
Securitized Asset-Backed			
Receivables LLC Trust			
2.551% 期日 03/25/2036		9,546	8,872
3.331% 期日 03/25/2035		8,650	8,065
Sequoia Mortgage Trust			
2.480% 期日 05/20/2035		3,467	3,428
2.800% 期日 06/20/2034		55	53
Sestante Finance Srl			
0.000% 期日 07/23/2046	EUR	13,850	13,458
SG Mortgage Securities			
Trust			
2.461% 期日 02/25/2036	USD	6,272	4,232
Slate No.1 PLC			
2.258% 期日 01/24/2051	GBP	7,819	10,036
2.658% 期日 01/24/2051		2,600	3,346
Slate No.2 PLC			
0.000% 期日 10/24/2044		1	13,082
Soundview Home Loan Trust			
2.521% 期日 07/25/2036	USD	24,020	21,948
2.561% 期日 06/25/2036		5,699	2,577
2.591% 期日 06/25/2036		44,153	24,112
2.931% 期日 03/25/2036		8,102	4,735
Specialty Underwriting &			
Residential Finance Trust			
3.256% 期日 12/25/2035		2,649	2,649
3.261% 期日 10/25/2035		3,332	3,280
Stonemont Portfolio Trust			
3.130% 期日 08/20/2030		26,145	26,152
3.380% 期日 08/20/2030		11,233	11,244
Structured Adjustable Rate			
Mortgage Loan Trust			

2.601% 期日 10/25/2035		9,713	9,131
2.931% 期日 08/25/2035		15,092	13,022
3.346% 期日 05/25/2035		123	106
3.944% 期日 06/25/2037		9,836	9,625
4.997% 期日 07/25/2035		3,721	2,898
Structured Asset			
Investment Loan Trust			
2.431% 期日 06/25/2036		13,010	12,660
3.001% 期日 04/25/2035		4,440	4,455
3.081% 期日 02/25/2034		33,062	33,127
3.481% 期日 12/25/2034		10,983	10,999
Structured Asset Mortgage			
Investments Trust			
2.491% 期日 09/25/2047		39,499	39,079
2.957% 期日 04/19/2035		4,262	4,146
Structured Asset Mortgage			
Investments Trust			
2.942% 期日 09/19/2032		58	57
Structured Asset			
Securities Corporation			
Mortgage Loan Trust			
2.411% 期日 05/25/2036		15,978	15,254
2.531% 期日 05/25/2036		5,945	5,327
2.541% 期日 04/25/2036		999	994
2.591% 期日 07/25/2036		38,871	37,921
2.781% 期日 04/25/2031		8,945	8,833
3.211% 期日 11/25/2035		19,865	19,844
Sutherland Commercial			
Mortgage Loans			
3.192% 期日 05/25/2037		1,992	1,998
Taurus CMBS UK DAC			
2.202% 期日 05/01/2022	GBP	661	845
Taurus UK DAC			
1.654% 期日 11/17/2027		11,540	14,728
Terwin Mortgage Trust			
3.661% 期日 03/25/2035	USD	2,436	2,345
Theatre Hospitals No.1 PLC			
3.813% 期日 10/15/2031	GBP	1,410	1,679
Theatre Hospitals No.2 PLC			
3.813% 期日 10/15/2031		663	792
Trinidad Mortgage			
Securities PLC			
1.608% 期日 01/24/2059		38,949	49,538
Trinity Square PLC			
1.963% 期日 07/15/2051		596	766
Truman Capital Mortgage			
Loan Trust			
2.541% 期日 03/25/2036	USD	3,171	3,120
Twin Bridges PLC			
1.582% 期日 09/12/2044	GBP	17,572	22,433
VOLT LX LLC			
3.250% 期日 06/25/2047	USD	18,745	18,642
VOLT LXIV LLC			
3.375% 期日 10/25/2047		3,493	3,473
Waldorf Astoria Boca Raton			
Trust			
3.630% 期日 06/15/2029		6,100	6,107
WaMu Mortgage Pass-Through			
Certificates Trust			
3.001% 期日 01/25/2045		153	148

	Warwick Finance			
	Residential Mortgages			
	Number Three PLC			
	0.000% 期日 12/31/2049	GBP	1	571
	0.000% 期日 12/31/2049		1	3,557
	1.604% 期日 12/21/2049		50,326	63,924
	2.304% 期日 12/21/2049		4,921	6,301
	2.804% 期日 12/21/2049		2,460	3,156
	3.304% 期日 12/21/2049		1,406	1,804
	3.804% 期日 12/21/2049		1,406	1,807
	Washington Mutual Mortgage			
	Pass-Through Certificates			
	WMALT Trust			
	2.796% 期日 10/25/2046	USD	19,587	13,981
	5.500% 期日 11/25/2035		135	126
	Wells Fargo Home Equity			
	Asset-Backed Securities			
	Trust			
	2.491% 期日 03/25/2037		2,671	2,548
	2.551% 期日 07/25/2036		10,000	9,876
	Wells Fargo Home Equity			
	Trust Mortgage Pass-			
	Through Certificates			
	2.581% 期日 04/25/2034		7,703	7,547
	Wells Fargo Mortgage-			
	Backed Securities Trust			
	4.345% 期日 05/25/2036		24,548	24,941
	4.737% 期日 10/25/2036		4,469	4,510
	4.739% 期日 10/25/2036		515	495
	WFCG Commercial Mortgage			
	Trust			
	6.000% 期日 11/15/2029		3,455	3,451
	WFRBS Commercial Mortgage			
	Trust			
	0.431% 期日 03/15/2047		8,800	203
	モーゲージ証券合計			4,334,529
	(原価4,322,419米ドル)			
資産担保証券	AASET Trust			
7.9%	3.967% 期日 05/16/2042		439	435
	Aircraft Certificate Owner			
	Trust			
	7.001% 期日 09/20/2022		564	578
	American Homes 4 Rent			
	Trust			
	6.231% 期日 10/17/2036		1,150	1,237
	Arbor Realty Commercial			
	Real Estate Notes Ltd.			
	3.270% 期日 08/15/2027		7,960	7,974
	Avant Loans Funding Trust			
	2.290% 期日 06/15/2020		386	385
	Avery Point CLO Ltd.			
	3.565% 期日 01/18/2025		2,024	2,027
	B&M CLO Ltd.			
	3.166% 期日 04/16/2026		14,726	14,716
	BFNS			
	3.994% 期日 01/25/2029		55,050	55,028
	Black Diamond CLO Ltd.			
	3.499% 期日 02/06/2026		6,329	6,335
	BSPRT Issuer Ltd.			
	3.330% 期日 03/15/2028		17,350	17,392
	4.830% 期日 03/15/2028		8,960	9,011
	5.730% 期日 03/15/2028		4,050	4,085

Business Loan Express			
Business Loan Trust			
2.571%	期日 09/25/2038	2,479	2,363
2.831%	期日 09/25/2038	1,202	1,119
3.381%	期日 09/25/2038	87	82
Cairn CLO III BV			
0.650%	期日 10/20/2028	EUR	9,400
Cairn CLO VI BV			
0.790%	期日 07/25/2029	5,520	6,261
Capitalsource Real Estate Loan Trust			
2.859%	期日 01/20/2037	USD	7,962
2.981%	期日 01/20/2037	16,100	15,448
3.081%	期日 01/20/2037	4,800	4,534
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
0.664%	期日 08/15/2027	EUR	7,400
Castlelake Aircraft Securitization Trust			
4.125%	期日 06/15/2043	USD	3,710
Catamaran CLO Ltd.			
3.359%	期日 01/27/2028	7,200	7,177
Cavendish Square Funding PLC			
0.281%	期日 02/11/2055	EUR	1,143
0.621%	期日 02/11/2055	1,500	1,657
CPS Auto Receivables Trust			
1.870%	期日 03/15/2021	USD	598
Crown Point CLO 5 Ltd.			
3.389%	期日 07/17/2028	6,300	6,300
Denali Capital CLO X LLC			
3.558%	期日 10/26/2027	11,000	11,004
Dryden 35 Euro CLO BV			
0.679%	期日 05/17/2027	EUR	17,285
Emerson Park CLO Ltd.			
3.636%	期日 07/15/2025	USD	13,030
Euromax ABS Ltd.			
0.000%	期日 04/18/2097	EUR	65
FAB CBO BV			
0.734%	期日 08/20/2080	500	521
FAB UK Ltd.			
1.250%	期日 12/06/2045	GBP	2,104
Figueroa CLO Ltd.			
3.188%	期日 06/20/2027	USD	19,900
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.			
5.000%	期日 03/12/2038	CAD	9,227
Goodgreen			
3.930%	期日 10/15/2053	USD	10,618
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.			
3.543%	期日 08/01/2025	2,538	2,542
3.569%	期日 10/22/2025	5,800	5,800
Harley Marine Financing LLC			
5.682%	期日 05/15/2043	5,826	5,397
JMP Credit Advisors CLO IIR Ltd.			
3.299%	期日 01/17/2028	32,994	32,996
LP Credit Card Asset- Backed Securities Master Trust			

3.830% 期日 08/20/2024	7,922	7,926
METAL LLC		
4.581% 期日 10/15/2042	17,295	17,228
MMcapS Funding Ltd.		
2.671% 期日 12/01/2035	1,063	1,041
Monarch Grove CLO		
3.370% 期日 01/25/2028	20,900	20,832
National Collegiate		
Student Loan Trust		
2.456% 期日 07/25/2030	2,718	2,682
2.491% 期日 11/25/2027	791	790
2.557% 期日 03/26/2029	19,012	18,797
2.571% 期日 10/25/2033	19,278	18,657
2.753% 期日 06/25/2029	4,962	4,914
Navient Private Education		
Loan Trust		
4.430% 期日 12/15/2045	8,205	8,569
Navient Student Loan Trust		
3.437% 期日 03/25/2066	2,649	2,697
Nelnet Student Loan Trust		
2.881% 期日 03/25/2030	7,815	7,863
3.081% 期日 09/25/2065	5,641	5,695
3.270% 期日 07/27/2048	4,293	4,335
OCP CLO Ltd.		
3.299% 期日 04/17/2027	16,800	16,810
3.328% 期日 10/26/2027	25,200	25,207
Octagon Investment		
Partners XXIII Ltd.		
3.286% 期日 07/15/2027	25,300	25,306
Pangaea ABS SPV		
0.041% 期日 12/28/2096 EUR	79	90
0.151% 期日 12/28/2096	9,900	11,084
Penta CLO 2 BV		
0.790% 期日 08/04/2028	16,600	18,825
Sapphire Aviation Finance		
4.250% 期日 03/15/2040 USD	34,535	34,601
Saranac CLO III Ltd.		
3.466% 期日 06/22/2030	27,300	27,327
SCF RC Funding LLC		
4.100% 期日 06/25/2047	4,605	4,510
Securitized Term Auto		
Receivables Trust		
1.775% 期日 01/27/2020	723	722
SLM Private Credit Student		
Loan Trust		
2.534% 期日 06/15/2023	5,300	5,294
Sofi Consumer Loan Program		
LLC		
2.770% 期日 05/25/2026	2,134	2,114
SoFi Professional Loan		
Program LLC		
2.650% 期日 09/25/2040	3,200	3,099
Sorrento Park CLO DAC		
0.631% 期日 11/16/2027 EUR	21,650	24,531
Spirit Master Funding LLC		
4.360% 期日 12/20/2047 USD	20,143	19,997
SpringCastle America		
Funding LLC		
3.050% 期日 04/25/2029	2,012	1,999
Springleaf Funding Trust		
2.680% 期日 07/15/2030	22,700	22,234
St Paul's CLO VI DAC		

	0.850% 期日 08/20/2030	EUR	3,600	4,084
	Starwood Waypoint Homes Trust			
	3.230% 期日 01/17/2035	USD	11,702	11,690
	3.450% 期日 01/17/2035		1,400	1,400
	3.680% 期日 01/17/2035		4,727	4,732
	4.230% 期日 01/17/2035		8,600	8,643
	Taberna Preferred Funding I Ltd.			
	2.807% 期日 07/05/2035		2,680	2,546
	2.878% 期日 07/05/2035		6,641	6,309
	Telos CLO Ltd.			
	3.399% 期日 04/17/2028		24,100	24,099
	3.719% 期日 01/17/2027		17,200	17,220
	Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
	4.212% 期日 05/17/2032		800	800
	TICP CLO III-2 Ltd.			
	3.309% 期日 04/20/2028		33,600	33,530
	Tikehau CLO BV			
	0.600% 期日 08/04/2028	EUR	1,600	1,815
	Tralee CLO V Ltd.			
	3.869% 期日 10/20/2028	USD	5,250	5,250
	Tropic CDO Ltd.			
	2.756% 期日 07/15/2036		13,458	12,382
	TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
	3.566% 期日 03/30/2039		25,178	24,926
	3.908% 期日 09/20/2039		6,417	6,417
	4.299% 期日 04/20/2038		5,814	5,872
	Venture CLO Ltd.			
	3.316% 期日 04/15/2027		36,720	36,545
	Vertical Bridge CC LLC			
	5.193% 期日 10/15/2046		391	393
	Z Capital Credit Partners CLO Ltd.			
	3.386% 期日 07/16/2027		35,115	35,061
	資産担保証券合計			937,121
	(原価: 934,287米ドル)			
	Abu Dhabi Government International Bond			
ソブリン債	2.500% 期日 10/11/2022		9,700	9,315
3.9%	3.125% 期日 10/11/2027		30,800	28,667
	4.125% 期日 10/11/2047		6,100	5,660
	Argentina Bocon			
	41.328% 期日 10/04/2022	ARS	1,070	50
	Argentina Government International Bond			
	2.260% 期日 12/31/2038	EUR	10,385	6,622
	2.500% 期日 12/31/2038	USD	22,724	12,742
	3.375% 期日 01/15/2023	EUR	7,700	7,327
	3.875% 期日 01/15/2022		10,500	10,679
	4.625% 期日 01/11/2023	USD	17,714	15,024
	5.250% 期日 01/15/2028	EUR	1,200	1,049
	5.625% 期日 01/26/2022	USD	15,410	13,888
	5.875% 期日 01/11/2028		12,900	9,965
	6.250% 期日 04/22/2019		1,650	1,663
	6.250% 期日 11/09/2047	EUR	900	758
	6.875% 期日 01/26/2027	USD	5,000	4,178
	6.875% 期日 01/11/2048		900	664
	7.125% 期日 07/06/2036		7,100	5,431
	7.500% 期日 04/22/2026		4,750	4,156

7.820% 期日 12/31/2033	EUR	21,712	22,307
49.933% 期日 03/01/2020	ARS	28,000	841
50.575% 期日 03/11/2019		17,936	533
52.756% 期日 04/03/2022		772,656	22,080
Argentina POM Politica			
Monetaria			
68.593% 期日 06/21/2020		903,382	30,280
Autonomous Community of			
Catalonia			
4.900% 期日 09/15/2021	EUR	1,350	1,646
4.950% 期日 02/11/2020		250	297
6.350% 期日 11/30/2041		250	364
Corp. Andina de Fomento			
3.950% 期日 10/15/2021	MXN	736	35
Corp. Financiera de			
Desarrollo S.A.			
3.250% 期日 07/15/2019	USD	7,000	7,003
Croatia Government			
International Bond			
6.750% 期日 11/05/2019		12,900	13,310
Export-Import Bank of			
India			
2.750% 期日 08/12/2020		630	618
3.875% 期日 10/02/2019		200	201
Greece Government			
International Bond			
4.750% 期日 04/17/2019	EUR	14,004	16,142
Indian Railway Finance			
Corp. Ltd.			
3.917% 期日 02/26/2019	USD	470	471
KSA Sukuk Ltd.			
2.894% 期日 04/20/2022		5,200	5,028
Kuwait International			
Government Bond			
2.750% 期日 03/20/2022		4,460	4,343
3.500% 期日 03/20/2027		13,800	13,434
Peru Government			
International Bond			
5.700% 期日 08/12/2024	PEN	13,000	3,988
6.150% 期日 08/12/2032		46,805	13,810
8.200% 期日 08/12/2026		12,400	4,307
Qatar Government			
International Bond			
3.875% 期日 04/23/2023	USD	10,300	10,338
4.500% 期日 04/23/2028		3,200	3,272
5.103% 期日 04/23/2048		5,600	5,698
Russia Government			
International Bond			
3.500% 期日 01/16/2019		1,400	1,401
5.000% 期日 04/29/2020		700	713
Saudi Government			
International Bond			
2.375% 期日 10/26/2021		3,500	3,349
2.875% 期日 03/04/2023		8,200	7,807
4.000% 期日 04/17/2025		61,000	60,007
4.500% 期日 04/17/2030		21,500	21,233
4.500% 期日 10/26/2046		4,100	3,728
4.625% 期日 10/04/2047		6,400	5,888
5.000% 期日 04/17/2049		14,400	13,859
Serbia Government			
International Bond			
4.875% 期日 02/25/2020		4,500	4,543

	7.250% 期日 09/28/2021	4,300	4,645
	Tanzania Government International Bond		
	8.544% 期日 03/09/2020	500	513
	Turkey Government International Bond		
	5.625% 期日 03/30/2021	4,700	4,593
	7.500% 期日 11/07/2019	900	912
	Ukraine Government International Bond		
	7.750% 期日 09/01/2023	4,390	4,188
	Venezuela Government International Bond		
	6.000% 期日 12/09/2020	3,367	842
	7.000% 期日 03/31/2038	1,883	467
	7.650% 期日 04/21/2025	5,349	1,371
	7.750% 期日 10/13/2019	1,200	302
	8.250% 期日 10/13/2024	5,591	1,426
	9.000% 期日 05/07/2023	3,161	814
	9.250% 期日 09/15/2027	4,274	1,101
	9.250% 期日 05/07/2028	6,512	1,661
	11.750% 期日 10/21/2026	680	176
	11.950% 期日 08/05/2031	500	129
	ソブリン債合計		463,852
	(原価：528,831米ドル)		
		株式数	
普通株式	Caesars Entertainment Corp.	1,078,632	9,265
0.2%	Eurobank Ergasias S.A. National Bank of Greece S.A.	10,169,333 102,570	6,858 178
	Towergate Finance PLC	1,237,781	1,993
	普通株式合計		18,294
	(原価：22,559米ドル)		
商業不動産株式	VICI Properties, Inc.	760,482	16,419
0.1%	商業不動産株式合計		16,419
	(原価：5,574米ドル)		
株式リンク証券	Sequa Corp. 04/28/2024	42,000	4
0.0%	株式リンク証券合計		4
	(原価：0米ドル)		
優先証券	Nationwide Building Society		
0.2%	10.250%	75,650	14,257
	Sequa Corp. 9.000%	862	636
	Stichting AK Rabobank Certificaten 6.500%	17,310	2,217
	優先証券合計		17,110
	(原価：19,068米ドル)		
短期証券	銀行引受手 形	元本金額	
3.3%	0.4%	0.000% 期日 12/03/2018	CAD 3,820
		1.735% 期日 11/01/2018	19,000
		FirstBank 1.982% 期日 11/30/2018	4,580
			3,482

	HSBC Bank Canada				
	1.752% 期日 11/02/2018		9,800		7,462
	2.017% 期日 11/28/2018		3,620		2,753
	Royal Bank of Canada				
	1.747% 期日 11/05/2018		3,800		2,893
	1.991% 期日 11/30/2018		4,580		3,483
	TD Bank				
	1.727% 期日 11/05/2018		6,900		5,253
	1.739% 期日 11/01/2018		6,400		4,873
	1.957% 期日 11/30/2018		520		395
					<u>47,965</u>
手形	Keurig Dr Pepper				
0.0%	2.486% 期日 11/02/2018	USD	1,500		1,500
					<u>1,500</u>
短期債券	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER				
0.1%	3.750% 期日 02/08/2019	ARS	3,110		113
	Harris Corp.				
	2.786% 期日 02/27/2019	USD	6,800		6,803
					<u>6,916</u>
レボ取引					
1.3%					<u>157,400</u>
定期性預金	Bank of Nova Scotia				
0.6%	1.690% 期日 11/01/2018		967		967
	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.				
	(0.300%) 期日 11/01/2018	JPY	1,168,895		10,358
	Brown Brothers Harriman & Co.				
	(0.800%) 期日 11/01/2018	DKK	4,634		704
	(0.800%) 期日 11/01/2018	SEK	1		0
	(0.570%) 期日 11/01/2018	EUR	30		34
	(0.300%) 期日 11/01/2018	JPY	586		5
	0.360% 期日 11/01/2018	GBP	36		46
	0.770% 期日 11/01/2018	AUD	59		42
	0.850% 期日 11/01/2018	CAD	1		1
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	5		5
	5.190% 期日 11/01/2018	ZAR	6,355		430
	Citibank N.A.				
	(0.570%) 期日 11/01/2018	EUR	333		378
	0.360% 期日 11/01/2018	GBP	611		780
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	4,033		4,033
	DBS Bank Ltd.				
	1.690% 期日 11/01/2018		1,039		1,039
	HSBC Bank				
	(0.570%) 期日 11/01/2018	EUR	740		838
	0.360% 期日 11/01/2018	GBP	653		834
	JPMorgan Chase & Co.				
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	8,577		8,577
	National Australia Bank Ltd.				
	0.770% 期日 11/01/2018	AUD	8,679		6,151
	Royal Bank of Canada				
	0.850% 期日 11/01/2018	CAD	12		9
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
	(0.570%) 期日 11/01/2018	EUR	684		775

	(0.300%) 期日 11/01/2018	JPY	258,864	2,294
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	9,870	9,870
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
	(0.570%) 期日 11/01/2018	EUR	3,591	4,069
	(0.300%) 期日 11/01/2018	JPY	1,098,902	9,737
	1.690% 期日 11/01/2018	USD	7,668	7,668
				69,644
<hr/>				
アルゼンチン短期国債	54.730% 期日 12/28/2018	ARS	1,054,643	31,076
0.5%	43.066% 期日 11/21/2018		41,672	1,125
	50.008% 期日 03/29/2019		179,403	5,040
	50.031% 期日 01/31/2019		266,914	7,794
	51.669% 期日 04/30/2019		10,025	284
	55.179% 期日 02/28/2019		533,901	15,559
				60,878
<hr/>				
ギリシャ短期国債	0.697% 期日 11/02/2018	EUR	8,630	9,778
0.3%	1.250% 期日 03/15/2019		21,996	24,846
				34,624
<hr/>				
ナイジェリア公開市場操作国債	13.096% 期日 01/10/2019	NGN	248,200	667
0.0%				667
<hr/>				
ナイジェリア短期国債	12.708% 期日 11/01/2018		546,100	1,504
0.1%	12.718% 期日 12/13/2018		591,100	1,605
	13.096% 期日 01/17/2019		620,000	1,663
	13.536% 期日 01/31/2019		625,950	1,672
	15.662% 期日 11/29/2018		837,600	2,287
				8,731
				388,325
<hr/>				
短期証券合計 (原価：389,192米ドル)				
投資有価証券合計 110.5% (原価：13,230,824米ドル)			USD	13,026,164
金融デリバティブ商品 0.5% (原価またはプレミアム(純額)(44,560)米ドル)				
その他の資産および負債 (純額)(11.0%)				(1,299,588)
純資産 100.0%			USD	11,788,516

マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(令和 1年 5月13日現在)	(令和 1年11月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	11,736,881
コール・ローン	23,191,390	-
特殊債券	66,397,910	65,352,400
未収利息	162,010	189,475
前払費用	58,126	-
流動資産合計	89,809,436	77,278,756
資産合計	89,809,436	77,278,756
負債の部		

（令和 1年 5月13日現在）

（令和 1年11月13日現在）

流動負債		
未払利息	55	-
その他未払費用	1,805	315
流動負債合計	1,860	315
負債合計	1,860	315
純資産の部		
元本等		
元本	89,650,363	77,161,380
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	157,213	117,061
元本等合計	89,807,576	77,278,441
純資産合計	89,807,576	77,278,441
負債純資産合計	89,809,436	77,278,756

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 5月14日 至 令和 1年11月13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	（令和 1年 5月13日現在）	（令和 1年11月13日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	89,650,363口	77,161,380口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0018円 (10,000口当たりの純資産額 10,018円)	1口当たり純資産額 1.0015円 (10,000口当たりの純資産額 10,015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	(令和 1年11月13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)

(令和 1年 5月13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
令和 1年 5月13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CB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CB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

(令和 1年11月13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	89,650,363円
同期中における追加設定元本額	-円
同期中における一部解約元本額	12,488,983円
令和 1年11月13日現在における元本の内訳	
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CB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CB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	77,161,380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

2019年11月29日現在

資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060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。

2019年11月29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	762	8,210,104
単位型株式投資信託	118	645,445
追加型公社債投資信託	1	29,929
単位型公社債投資信託	187	517,762
合計	1,068	9,403,241

(3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

- a. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。
- b. 2020年1月24日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、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D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

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34期(平成30年4月1日から平成31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35期中間会計期間(平成31年4月1日から令和1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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,873,870	13,755,961
顧客分別金信託	20,010	20,011
前払費用	402,249	476,456
未収入金	39,030	64,856
未収委託者報酬	6,332,203	6,963,077
未収運用受託報酬	1,725,215	1,129,548
未収投資助言報酬	316,407	285,668
未収収益	50,321	44,150
その他の流動資産	10,891	31,771
流動資産合計	29,770,200	22,771,504
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	185,371	173,517
器具備品	300,694	751,471
有形固定資産合計	486,065	924,988
無形固定資産		
ソフトウェア	409,765	479,867
ソフトウェア仮勘定	5,755	183,528
電話加入権	56	44
商標権	-	60
無形固定資産合計	415,576	663,501
投資その他の資産		
投資有価証券	10,616,594	10,829,628
関係会社株式	10,412,523	10,252,067
長期差入保証金	658,505	2,004,451
長期前払費用	69,423	97,107
会員権	7,819	7,819

繰延税金資産	1,394,447	1,426,381
投資その他の資産合計	23,159,314	24,617,457
固定資産合計	24,060,956	26,205,946
資産合計	53,831,157	48,977,450

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
未払金		
未払収益分配金	649	1,122
未払償還金	137,522	137,522
未払手数料	2,783,763	3,246,133
その他未払金	236,739	768,373
未払費用	3,433,641	3,535,589
未払消費税等	547,706	84,966
未払法人税等	1,785,341	670,761
賞与引当金	1,507,256	1,302,052
その他の流動負債	1,408	18,110
流動負債合計	10,526,438	11,249,395
固定負債		
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601
賞与引当金	99,721	5,074
その他の固定負債	3,363	5,074
固定負債合計	3,422,915	3,428,751
負債合計	13,949,354	14,678,146
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	26,561,078	21,255,054
利益剰余金合計	28,382,283	23,076,258
株主資本計	39,011,267	33,705,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	870,535	594,061
評価・換算差額等合計	870,535	594,061
純資産合計	39,881,802	34,299,304
負債・純資産合計	53,831,157	48,977,450

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成29年4月1日	(自	平成30年4月1日
	至	平成30年3月31日)	至	平成31年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		36,538,981		39,156,499
運用受託報酬		8,362,118		6,277,217
投資助言報酬		1,440,233		1,332,888
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬		5,000		-
サービス支援手数料		128,324		182,502
その他		55,820		49,507
営業収益計		46,530,479		46,998,614
営業費用				
支払手数料		16,961,384		18,499,433
広告宣伝費		353,971		361,696
公告費		1,140		125
調査費				
調査費		1,654,233		1,752,905
委託調査費		5,972,473		6,050,441
営業雑経費				
通信費		40,066		46,551
印刷費		339,048		338,465
協会費		-		24,700
諸会費		45,465		23,756
情報機器関連費		2,582,734		2,872,416
販売促進費		34,333		49,118
その他		136,669		148,307
営業費用合計		28,121,520		30,167,918
一般管理費				
給料				
役員報酬		196,529		190,951
給料・手当		6,190,716		6,308,066
賞与		601,375		514,259
賞与引当金繰入額		1,566,810		1,235,936
交際費		25,709		27,802
寄付金		-		82
事務委託費		256,413		286,905
旅費交通費		220,569		228,538
租税公課		282,036		285,369
不動産賃借料		654,286		612,410
退職給付費用		419,884		463,553
固定資産減価償却費		329,756		378,530
諸経費		285,490		290,243
一般管理費合計		11,029,580		10,822,651

営業利益	7,379,378	6,008,044
------	-----------	-----------

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)		(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		51,335		-
受取利息		520		623
時効成立分配金・償還金		2,622		72
原稿・講演料		894		1,951
雑収入		10,669		36,408
営業外収益合計		66,042		39,055
営業外費用				
為替差損		5,125		15,760
雑損失		913		7,027
営業外費用合計		6,038		22,787
経常利益		7,439,383		6,024,312
特別利益				
投資有価証券償還益		61,842		289,451
投資有価証券売却益		30,980		7,247
過去勤務費用償却益	1	-		79,850
特別利益合計		92,822		376,549
特別損失				
固定資産除却損	2	354,695		1,462
投資有価証券償還損		141,666		13,668
投資有価証券売却損		9,634		14,605
関係会社株式評価損	3	-		160,455
合併関連費用	4	-		187,140
特別損失合計		505,996		377,331
税引前当期純利益		7,026,209		6,023,530
法人税、住民税及び事業税		2,350,891		1,750,031
法人税等調整額		280,166		90,084
法人税等合計		2,070,725		1,840,116
当期純利益		4,955,483		4,183,413

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		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
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)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,314,279	35,943,263	327,116	327,116	36,270,379
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)			543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	3,068,003	3,068,003	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		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	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802
当期変動額					
剰余金の配当	9,489,438	9,489,438			9,489,438
当期純利益	4,183,413	4,183,413			4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			276,474	276,474	276,474
当期変動額合計	5,306,024	5,306,024	276,474	276,474	5,582,498
当期末残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304

[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) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(2) 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。

(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)を当事業年度の期首から適用し、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するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」715,988千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,394,447千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第4項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

(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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
建物	312,784千円	350,176千円
器具備品	768,929千円	922,553千円

2 当座借越契約

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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

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、令和5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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	204,923千円	174,854千円

(損益計算書関係)

1 過去勤務費用償却益

過去勤務費用償却益は、退職金規程を変更したことに伴い発生した過去勤務費用の一時処理額であります。

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
器具備品	0 千円	695 千円
ソフトウェア	9,000 千円	766 千円
ソフトウェア仮勘定	345,695 千円	- 千円

3 関係会社株式評価損

関係会社株式評価損は、関連会社の株式について減損処理を適用したことによるものであります。

4 合併関連費用

合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び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であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成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	107,000.00	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	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

当事業年度(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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。

	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	17,622,360株	-	17,640,000株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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。

当該株式分割は平成30年11月1日を効力発生日としておりますので、平成31年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

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	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
平成31年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	平成31年 1月31日	平成31年 3月22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

令和1年6月24日開催の臨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
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
1年以内	208,187	597,239
1年超	42,916	6,115,662
合計	251,104	6,712,901

(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おります。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おります。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っておりません。

(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おります。

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おります。

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おります。

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おります。

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おります。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30年3月31日)

(単位:千円)

区分	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	-

当事業年度(平成31年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-
(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(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)顧客からの預り金及び(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)

区分	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,252,067
合計	10,412,523	10,252,067

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成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	-	-

当事業年度(平成31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	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

(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。

当事業年度(平成31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10,252,067千円)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。

当事業年度（平成31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	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(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	3,283,920	3,360,000	76,080
小計	3,283,920	3,360,000	76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

（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

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31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
728,127	7,247	14,605

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、有価証券について160,455千円（関係会社株式160,455千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度	当事業年度
	（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）
退職給付債務の期首残高	3,177,131	3,319,830
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の発生額	51,212	3,658
退職給付の支払額	94,727	85,082
過去勤務費用の発生額	-	79,850
退職給付債務の期末残高	3,319,830	3,418,601

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	前事業年度	当事業年度
	（平成30年3月31日）	（平成31年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	3,319,830	3,418,601
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	3,319,830	3,418,601

(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29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の費用処理額	51,212	3,658
過去勤務費用償却益	-	79,850
その他	182,458	199,849
確定給付制度に係る退職給付費用	419,884	383,703

- (注) 1.退職金規程を変更したことに伴い、過去勤務費用償却益79,850千円を特別利益に計上しております。
2.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であります。

(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29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
割引率	0.000%	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147,195千円、当事業年度156,457千円であります。

(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30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798
繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額(注)	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

- (注) 評価性引当額が49,131千円増加しております。この増加の内容は、主として関係会社株式評価損に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
法定実効税率 (調整)	30.8%	30.6%

評価性引当額の増減	-	0.8
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.9
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.9	1.4
その他	0.1	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4	30.5

(セグメント情報等)

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31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	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

(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)

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31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	2,499,836	未払 手数料	399,447
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	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

(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29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	2,260.87円	1,944.40円
1株当たり当期純利益金額	280.92円	237.15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. 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、前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株当たり当期純利益を算定しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,955,483	4,183,413
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	4,955,483	4,183,413
期中平均株式数(株)	17,640,000	17,640,000

(重要な後発事象)

前事業年度(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。

当事業年度(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

取得による企業結合

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。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併いたしました。

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

(4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社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した株式数

(1) 合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式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した。

(2) 合併比率の算定方法

当社はE Yトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はP w C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判断し、合意に至ったものであります。

(3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第35期中間会計期間 (令和1年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		31,390,396
顧客分別金信託		120,015
前払費用		518,120
未収委託者報酬		9,224,857
未収運用受託報酬		2,518,829
未収投資助言報酬		300,807
未収収益		49,098
その他		251,169
流動資産合計		44,373,295
固定資産		
有形固定資産	1	1,165,925
無形固定資産		
のれん		35,720,818
顧客関連資産		18,841,803
その他		1,287,309
無形固定資産合計		55,849,931
投資その他の資産		
投資有価証券		19,980,993
関係会社株式		11,208,183
その他		2,725,272
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		33,893,699
固定資産合計		90,909,555
資産合計		135,282,851
負債の部		
流動負債		
リース債務		1,568
顧客からの預り金		3,725
その他の預り金		117,464

未払金		4,558,058
未払費用		4,003,445
未払法人税等		1,108,639
前受収益		37,155
賞与引当金		1,620,047
資産除去債務		248,260
その他	2	262,615
流動負債合計		11,960,980
固定負債		
リース債務		1,045
退職給付引当金		5,317,984
賞与引当金		2,537
その他		218,125
繰延税金負債		3,515,376
固定負債合計		9,055,069
負債合計		21,016,049
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
その他資本剰余金		81,927,000
資本剰余金合計		90,555,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		19,373,541
利益剰余金合計		21,194,745
株主資本合計		113,750,729
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		516,072
評価・換算差額等合計		516,072
純資産合計		114,266,801
負債純資産合計		135,282,851

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		28,593,570
運用受託報酬		4,633,054
投資助言報酬		661,581
その他の営業収益		118,885
営業収益計		34,007,092
営業費用		21,567,446
一般管理費	1	11,224,956
営業利益		1,214,689
営業外収益	2	258,897
営業外費用	3	41,920

経常利益		1,431,666
特別損失	4	11,471
税引前中間純利益		1,420,194
法人税、住民税及び事業税		950,377
法人税等調整額		118,269
法人税等合計		832,107
中間純利益		588,086

(3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当中間期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
中間純利益								588,086
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
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	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,881,513
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,373,541

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
中間純利益	588,086	588,086			588,086
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			77,989	77,989	77,989
当中間期変動額合計	1,881,513	80,045,486	77,989	77,989	79,967,497
当中間期末残高	21,194,745	113,750,729	516,072	516,072	114,266,801

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（リース資産を除く）

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	2～50年
器具備品	3～20年

(2)無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア(自社利用分)	5年(社内における利用可能期間)

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3.引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)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。

(3)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)

(中間損益計算書)

当社は当中間会計期間より、「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「特別利益」ではなく「営業外収益」として、「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「特別損失」ではなく「営業外費用」として表示する方法に変更しております。これは、合併を契機に検討した結果、投資有価証券の売却及び償還の大勢が自社設定投信等の処分によるものであり毎期経常的に発生するものとして、当中間会計期間から取引実態に沿った表示へと変更したものであります。

この結果、従来の方法に比較して、「特別利益」は23,677千円減少し、「営業外収益」は同額増加しており、「特別損失」は30,023千円減少し、「営業外費用」は同額増加しております。また、「経常利益」は6,346千円減少しております。

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間 (令和1年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,557,220千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。

3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。 当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5年6月までの賃借料総額150,945千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
1.のれん償却費	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	287,191千円
無形固定資産	1,187,351千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	209,815千円
投資有価証券償還益	5,197千円
投資有価証券売却益	18,480千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	11,810千円
投資有価証券償還損	22,585千円
投資有価証券売却損	7,437千円
4.特別損失のうち主要なもの	
合併関連費用	6,094千円
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。	
固定資産除却損	5,377千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 平成31年4月1日 至 令和1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	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

(変動事由の概要)

合併に伴う普通株式の発行による増加 16,230,060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
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25日

(リース取引関係)

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1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	1,675,025千円
1年超	6,419,696千円
合計	8,094,721千円

(金融商品関係)

1.金融商品の時価等に関する事項

第35期中間会計期間(令和1年9月30日)

令和1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	31,390,396	31,390,396	-
(2)顧客分別金信託	120,015	120,015	-
(3)未収委託者報酬	9,224,857	9,224,857	-
(4)未収運用受託報酬	2,518,829	2,518,829	-
(5)未収投資助言報酬	300,807	300,807	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	19,935,624	19,935,624	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	2,528,392	2,528,392	-
資産計	66,018,923	66,018,923	-
(1)顧客からの預り金	3,725	3,725	-
(2)未払金			
未払手数料	4,192,554	4,192,554	-
負債計	4,196,280	4,196,280	-

(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	45,369
合計	45,369
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	11,208,183
合計	11,208,183

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35期中間会計期間(令和1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 11,208,183千円)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

(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	12,082,796	11,176,487	906,308
小計	12,082,796	11,176,487	906,308
(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	7,852,827	8,004,506	151,679
小計	7,852,827	8,004,506	151,679
合計	19,935,624	19,180,994	754,629

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

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。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

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) 企業結合を行った主な理由

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

(4) 企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社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31年1月16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31年1月16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. 中間財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

平成31年4月1日から令和1年9月30日

3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

取得の対価	企業結合日に交付した当社の普通株式の時価	81,927,000千円
取得原価		81,927,000千円

4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1) 合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式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した。

(2) 合併比率の算定方法

当社はEYトラザクシオン・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社は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判断し、合意に至ったものであります。

(3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1) 発生したのれんの金額

37,043,811千円

(2) 発生原因

被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

(3) 償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	24,546,329千円
固定資産	34,001,531千円
資産合計	58,547,860千円
流動負債	5,406,939千円
固定負債	8,257,731千円
負債合計	13,664,671千円

(資産除去債務関係)

当該資産除去債務の総額の増減

(単位：千円)

	当中間会計期間
	(自 平成31年4月1日
	至 令和1年9月30日)
期首残高	-
合併による増加額(注)	248,260
中間期末残高	248,260

(注) 合併に伴い主として霞ヶ関オフィスの不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について、資産除去債務の金額を計上しております。

なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

(セグメント情報等)

第35期中間会計期間(自 平成31年4月1日 至 令和1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	28,593,570	4,633,054	661,581	118,885	34,007,092

(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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

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35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,373円68銭
1株当たり中間純利益	17円36銭

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

(参考) 大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

1. 委託会社の財務諸表は、「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。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DS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 公認会計士 飯田 浩 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 榮 裕 印
業務執行社員

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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

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。

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

	第46期 （平成30年3月31日）	第47期 （平成31年3月31日）
資産の部		

流動資産			
現金・預金		21,360,895	20,475,527
前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,143	3,583
未払金	29,207	1,555,486
未払手数料	1,434,393	1,222,461
未払費用	1,287,722	1,203,269
未払法人税等	1,397,293	264,304
未払消費税等	135,042	48,437
賞与引当金	1,263,100	1,007,040
役員賞与引当金	85,600	72,900
その他	23,128	29,455
流動負債計	5,658,632	5,406,939
固定負債		
リース債務	4,698	5,173

退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-
長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	5,111,757	4,252,374
委託者報酬	26,383,145	24,415,734
その他営業収益	82,997	66,957
営業収益計	31,577,899	28,735,066
営業費用		
支払手数料	11,900,832	10,708,502
広告宣伝費	93,131	196,206
公告費	-	293
調査費		
調査費	1,637,364	2,076,042
委託調査費	2,959,680	3,032,753
委託計算費	79,120	77,597
営業雑経費		
通信費	42,497	38,715
印刷費	517,371	507,540

協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	-	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	2	179,376
固定資産除却損	-	4,121
特別損失計	-	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（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			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
利益剰余金 合計					
当期首残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金	繰越利益剰余金
				別途積立金		
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
利益剰余金 合計					
当期首残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	3,803,800	3,803,800			3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531

株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)			94,337	94,337	94,337
当期変動額合計	870,268	870,268	94,337	94,337	964,605
当期末残高	28,960,505	31,116,774	39,124	39,124	31,077,650

注記事項

(重要な会計方針)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) 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(売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。)を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 2～30年 器具備品 4～15年 (会計上の見積りの変更) 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。 これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、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。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、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。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、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。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>

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

消費税及び地方消費税の会計処理は、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」の適用に伴う変更)

「『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)を当事業年度の期首から適用し、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ました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

(追加情報)

当社は、平成31年3月22日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度において役員退職慰労引当金184,610千円を長期未払金に振り替えております。

(貸借対照表関係)

第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
1.有形固定資産の減価償却累計額	1.有形固定資産の減価償却累計額
建物 465,964千円	建物 556,889千円
器具備品 266,621千円	器具備品 297,262千円
リース資産 8,719千円	リース資産 12,584千円

(損益計算書関係)

第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
-	2. 合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------	---------------------	-----	-------

平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日
----------------------	----------	-----------	-----------	-----	------------	------------

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当の 原資	1株当た り配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

(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・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与等であり、1年以内の債権であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料、及び業務委託関連費用であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

資金調達に係る流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

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、次のとおりであります。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、次表に含めておりません(注2)を参照ください)。

第46期(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・預金	21,360,895	21,360,895	-
(2)未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	-
(3)未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	-
(4)未収入金	12,823	12,823	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,206,465	10,206,465	-
資産計	36,141,929	36,141,929	-
(1)未払手数料	1,434,393	1,434,393	-
(2)未払費用(*)	959,074	959,074	-
負債計	2,393,468	2,393,468	-

(*)金融商品に該当するものを表示しております。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	20,475,527	20,475,527	-
(2)未収委託者報酬	2,923,589	2,923,589	-
(3)未収運用受託報酬	870,546	870,546	-
(4)未収入金	4,542	4,542	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,979,968	10,979,968	-
(6)長期差入保証金	524,592	524,592	-
資産計	35,778,767	35,778,767	-
(1)未払手数料	1,222,461	1,222,461	-
(2)未払費用(*)	807,875	807,875	-
負債計	2,030,337	2,030,337	-

(*)金融商品に該当するものを表示しております。

(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・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬及び(4)未収入金

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。

- (5)投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

- (6)長期差入保証金

敷金の性質及び賃貸借契約の期間から、時価は当該帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額によっております。

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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の貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	第46期（平成30年3月31日）	第47期（平成31年3月31日）
(1) 其他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

これらについては、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時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）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。

第47期（平成31年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）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

第46期(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
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	7,683,969	7,850,063	166,093
小計	7,683,969	7,850,063	166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 51,135千円)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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第47期(平成31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
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,207,351	1,967,041	240,309
小計	2,207,351	1,967,041	240,309
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	8,772,616	9,069,317	296,700
小計	8,772,616	9,069,317	296,700
合計	10,979,968	11,036,359	56,391

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 45,071千円)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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	398,350	6,350	5,000

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,433,609	45,345	4,735

(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、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	第46期	第47期
	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,482,500	1,540,203
退職給付費用	147,235	248,717
退職給付の支払額	105,520	61,499
その他	15,987	20,359
退職給付引当金の期末残高	1,540,203	1,707,062

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

(2) 退職給付債務及び年金資産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)

	第46期	第47期
	(平成30年3月31日)	(平成31年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第46期 147,235千円 第47期 248,717千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第46期は72,489千円、第47期は75,365千円であります。

(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)

	第46期	第47期
	(平成30年3月31日)	(平成31年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	71,030	23,058
賞与引当金	386,761	308,355
社会保険料	30,549	27,751
未払事業所税	4,247	4,370
退職給付引当金	471,610	522,702
資産除去債務	-	77,318
投資有価証券	67,546	65,422
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	26,961	-
その他有価証券評価差額金	-	17,266
その他	74,458	83,141
繰延税金資産小計	1,144,165	1,140,388
評価性引当額	78,546	76,422
繰延税金資産合計	1,065,618	1,063,965

繰延税金負債		
建物	-	54,715
その他有価証券評価差額金	24,367	-
繰延税金負債合計	24,367	54,715
繰延税金資産の純額	1,041,251	1,009,250

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差異の原因となった主な項目別の内訳

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.80%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.09%
特定外国子会社等課税対象金額	-	1.99%
税額控除	-	0.64%
その他	-	0.36%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	32.50%

(注) 前事業年度は、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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該契約に基づく退去予定期限までの期間を使用見込期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

(3) 当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について合理的な見積りが可能となったことから、「(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法」に記載の算定方法に則り、資産除去債務の金額を計算しております。資産除去債務の残高の推移は次のとおりであります。

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
期首残高	-	-
見積りの変更による増加額	-	248,260
期末残高	-	248,260

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第46期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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。

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。

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。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	24,415,734	4,252,374	66,957	28,735,066

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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。

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。

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。

(関連当事者との取引)

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	3,987,525	未払 手数料 料	573,578
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	1,969,101	未払 手数料 料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	4,328,153	未払 手数料 料	540,879
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	1,465,685	未払 手数料 料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

(1株当たり情報)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

(注)潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たりの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。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
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(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

当社は、平成30年9月28日付で締結した、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DS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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。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

令和1年11月22日

三井住友DS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 羽 太 典 明 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 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DSアセットマネジメント株式会社の平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和1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DSアセットマネジメント株式会社の令和1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31年4月1日から令和1年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和1年12月24日

三井住友DS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）の令和1年5月14日から令和1年11月13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）の令和1年11月13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（令和1年5月14日から令和1年11月13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DS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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年12月24日

三井住友DS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）の令和1年5月14日から令和1年11月13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）の令和1年11月13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（令和1年5月14日から令和1年11月13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DS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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。