【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年12月11日提出
【計算期間】	第2特定期間(自　平成29年3月14日至　平成29年9月12日)
【ファンド名】	りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり） りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　松下　隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目５番１号
【事務連絡者氏名】	土田　雅央
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目５番１号
【電話番号】	03-5405-0740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ　当ファンドは、投資信託への投資を通じて、米ドル建ての世界の幅広い債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的なインカム収入の確保と値上り益の獲得を目指して運用を行います。

ロ　当ファンドの募集上限額は各ファンドにつき3,000億円であり、設定日以後の追加信託は行われません。

ハ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産（収益の源泉）	債券	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年４回	目論見書または信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり（限定ヘッジ）	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

項目	該当する属性区分	内容

投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年４回	目論見書または信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

≪商品分類表≫

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

単位型･追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 （　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

≪属性区分表≫

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月）	グローバル （日本を除く） 日本 北米 欧州	ファミリーファンド	あり （限定ヘッジ）

社債 その他債券 クレジット属性 （　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（債券　一般）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回（毎月） 日々 その他 （　）	アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファンド・オブ・ファンズ	なし

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（債券　一般）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を除く） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり なし

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。
※商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（http://www.toushin.or.jp/）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2016年12月29日　　信託契約締結、設定、運用開始。

（３）【ファンドの仕組み】

イ　当ファンドの関係法人とその役割

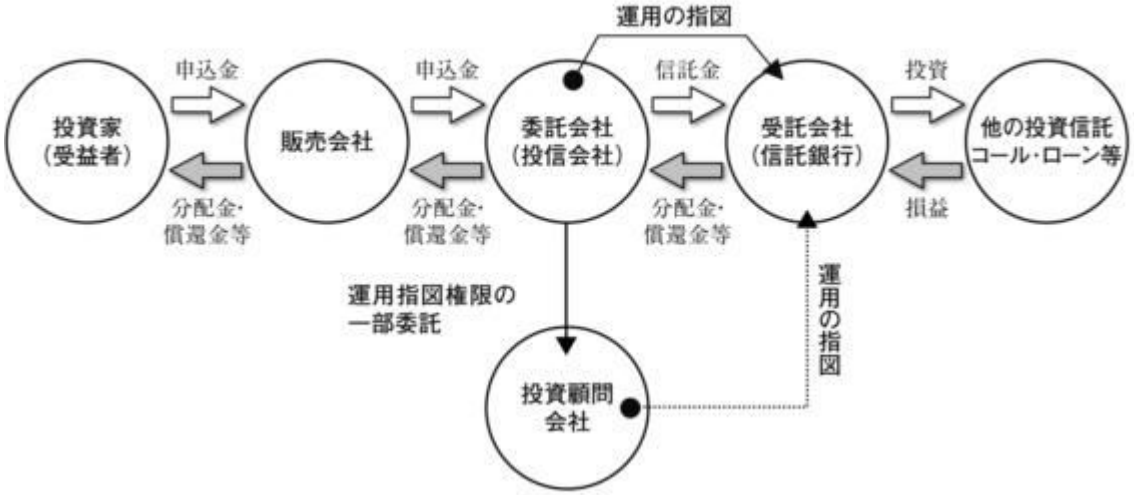
（イ）委託会社　「三井住友アセットマネジメント株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社　「株式会社りそな銀行」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

（ニ）投資顧問会社（運用の委託先）　「ピムコジャパンリミテッド」
委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、当ファンドの運用指図に関する権限の一部の委託を受け、信託財産の運用を行います。

運営の仕組み



ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額
2,000百万円（2017年 9月29日現在）

（ロ）会社の沿革
1985年７月15日　三生投資顧問株式会社設立

1987年２月20日　証券投資顧問業の登録
1987年６月10日　投資一任契約にかかる業務の認可
1999年１月１日　三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年２月５日　三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年１月27日　証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月１日　住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年４月１日　トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

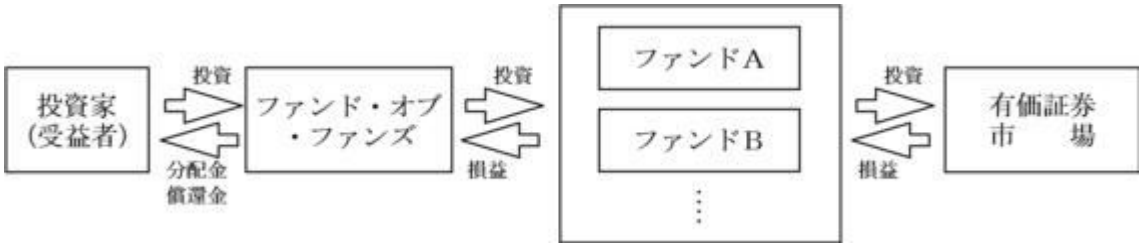
（ハ）大株主の状況

（2017年 9月29日現在）

名称	住所	所有株式数	比率（%）
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目１番２号	10,584	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目４番35号	3,528	20.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目９番地	3,528	20.0

ハ　ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）
一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ　基本方針
当ファンドは、安定的なインカム収入の確保と値上り益の獲得を目指して運用を行います。

ロ　投資態度
●りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）
（イ）主として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）」および「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、安定的なインカム収入の確保と値上り益の獲得を目指して運用を行います。
（ロ）「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）」を通じて、投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い債券等のうち、米ドル建ての債券および債券関連派生

商品等に投資します。

・利回り水準、割安度、発行体の返済能力、期限前償還リスク等を総合的に分析して、比較的高水準かつ安定的な利子収入が期待できると判断される銘柄に投資します。

・米国の債券等（国債、政府機関債、投資適格社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイイールド社債、貸付債権（バンクローン）等）、米国以外の先進国債券、新興国債券および債券関連派生商品等に分散投資します。

・米ドル建て債券には、非米ドル建て債券を為替取引により米ドル建てにしたものも含みます。

・市場環境や経済見通しに応じて、上記債券等の種別配分を機動的に変更します。

・米ドル以外の通貨の組入比率は、取得時において純資産総額の10%程度までとします。

・原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

（ハ）「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券を通じて、主として円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資します。

（ニ）原則として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）」の投資比率を高位に保ちます。

（ホ）運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。

（ヘ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（ト）主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。

ａ．ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）

投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。

ｂ．マネー・オープン・マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	円貨建ての短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	安定した収益の確保を目指します。

※上記ファンドの詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。

●りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

（イ）主として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）」および「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、安定的なインカム収入の確保と値上り益の獲得を目指して運用を行います。

（ロ）「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ」を通じて、投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い債券等のうち、米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資します。

・利回り水準、割安度、発行体の返済能力、期限前償還リスク等を総合的に分析して、比較的高水準かつ安定的な利子収入が期待できると判断される銘柄に投資します。

・米国の債券等（国債、政府機関債、投資適格社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイイールド社債、貸付債権（バンクローン）等）、米国以外の先進国債券、新興国債券および債券関連派生商品等に分散投資します。

・米ドル建て債券には、非米ドル建て債券を為替取引により米ドル建てにしたものも含みます。

・市場環境や経済見通しに応じて、上記債券等の種別配分を機動的に変更します。

・米ドル以外の通貨の組入比率は、取得時において純資産総額の10％程度までとします。
・原則として対円での為替ヘッジを行わず、為替差益の獲得を目指します。ただし、円高になった場合には、為替差損が発生します。

（ハ）「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券を通じて、主として円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資します。

（ニ）原則として、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）」の投資比率を高位に保ちます。

（ホ）運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。

（へ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（ト）主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。

ａ．ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）

投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。

ｂ．マネー・オープン・マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	円貨建ての短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	安定した収益の確保を目指します。

※上記ファンドの詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。

ファンドの特色

1 米ドル建ての世界の幅広い債券および債券関連派生商品等に投資します。

□米国の債券等（国債、政府機関債、投資適格社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイイールド社債、貸付債権（バンクローン）等）、米国以外の先進国債券、新興国債券および債券関連派生商品等に分散投資します。なお、投資適格未満の銘柄への投資も含みます。

□米ドル建て債券には、非米ドル建て債券を為替取引により米ドル建てにしたものも含みます。

□市場環境や経済見通しに応じて、債券等の種別配分を機動的に変更します。

2 実際の運用は、債券運用において高い専門性を有するＰＩＭＣＯグループが行います。

□当ファンドの運用指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。

3 信託期間約５年6ヵ月の単位型投資信託です。

4 「為替ヘッジあり」と「為替ヘッジなし」からお選びいただけます。

□「為替ヘッジあり」は、原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

□「為替ヘッジなし」は、原則として対円での為替ヘッジを行わず、為替差益の獲得を目指します。ただし、円高になった場合には、為替差損が発生します。

5 年４回決算を行い、分配方針に基づき分配を行います。

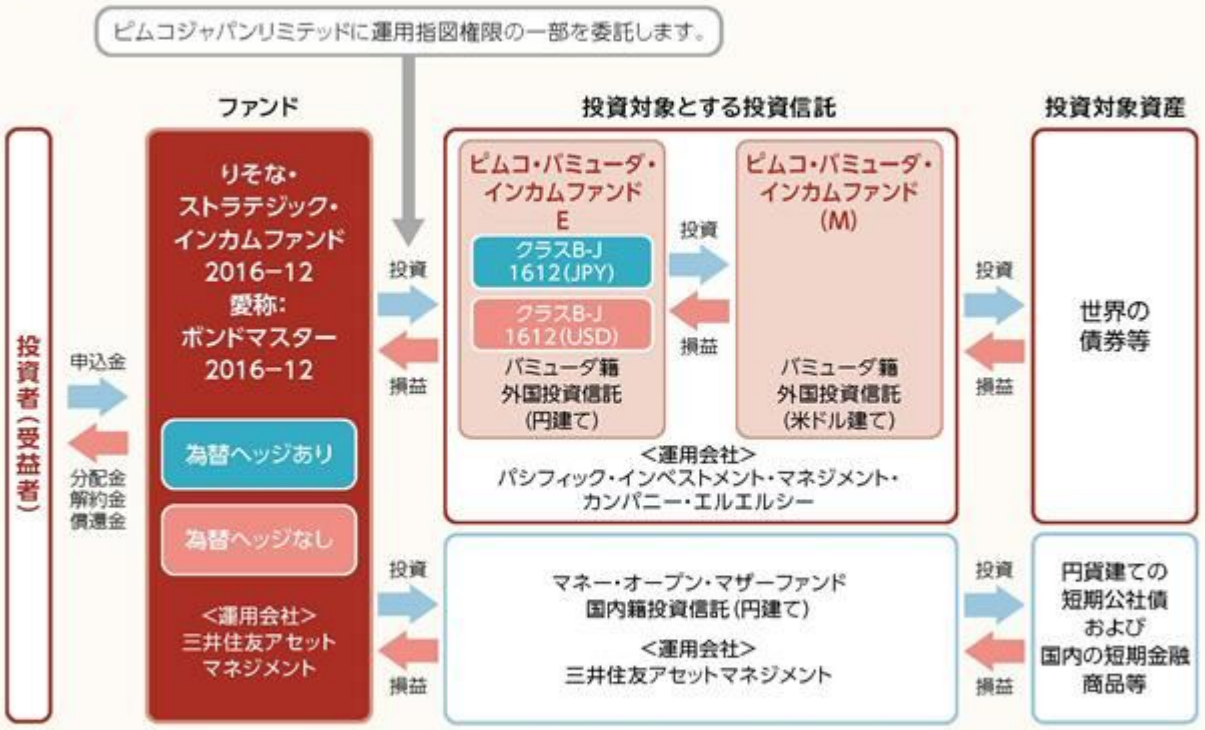
□毎年3月、6月、9月、12月の12日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。

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

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



※「ピムコ・バミューダ・インカムファンドE」の各クラスの組入比率を原則として高位に保ちます。したがってファンドの実質的な主要投資対象は、世界の債券等となります。
※ファンドの投資対象である「ピムコ・バミューダ・インカムファンドE」から、直接、米ドル建ての債券および債券関連派生商品等への投資と同等の投資効果が得られる債券等に投資することがあります。

投資する債券等の種類と特徴

■世界の幅広い債券等から、比較的高水準かつ安定的なインカム収入が期待できると判断される銘柄に投資します。

■単一の投資対象に偏ることなく、多様な投資対象に分散投資します。

主な固定金利資産

米国政府関連債
- 米国の政府や地方政府が発行する債券。
- 信用力が高く、安全性が高いため、相対的に利回りは低い。

米国投資適格社債
- 企業が発行する債券で、格付けがBBB格以上のもの。
- 信用力が高く、安全性が高いため、相対的に利回りは低い。

ハイイールド社債
- 企業が発行する債券で、格付けがBB格以下のもの。
- 信用力が低い分、高い利回りが期待できる。

米国政府系モーゲージ証券
- 政府系機関が発行する住宅ローンを担保とする証券。
- 信用力は高い。
- 期限前償還リスクがあるため、他の高格付け債券より利回りが高くなる傾向がある。

先進国債券
- 先進国の政府や政府機関、企業が発行する債券。
- 信用力が高いため、利回りは低くなる傾向がある。

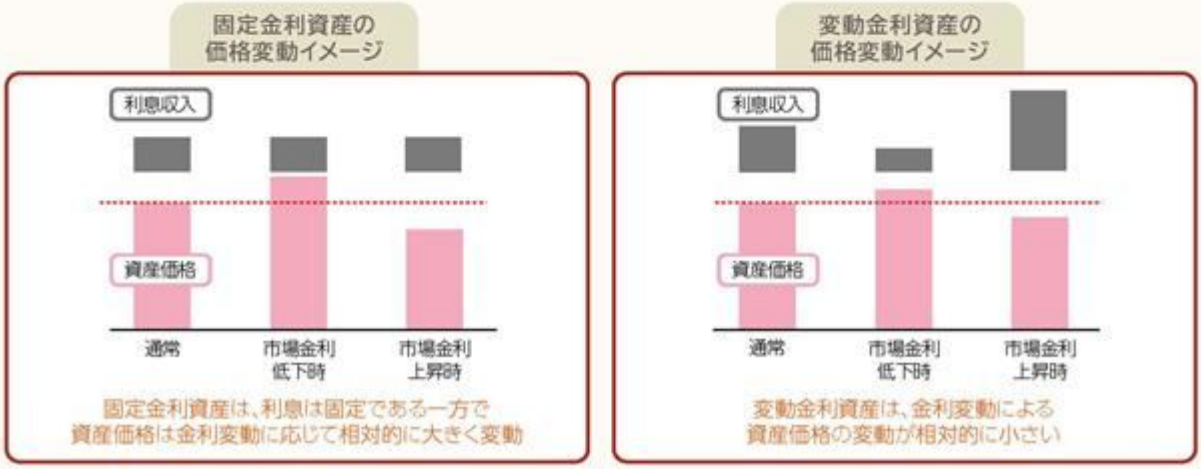
新興国債券
- 新興国の政府や政府機関、企業が発行する債券。
- 先進国の債券と比べて信用力が低い分、利回りは高くなる傾向がある。

主な変動金利資産

バンクローン
- 銀行等が、主に格付けがBB格以下の企業に対して行うローン。
- 通常、優先担保が設定されており、社債等と比較して弁済順位が高い。
- 変動金利で設定されることが多い。

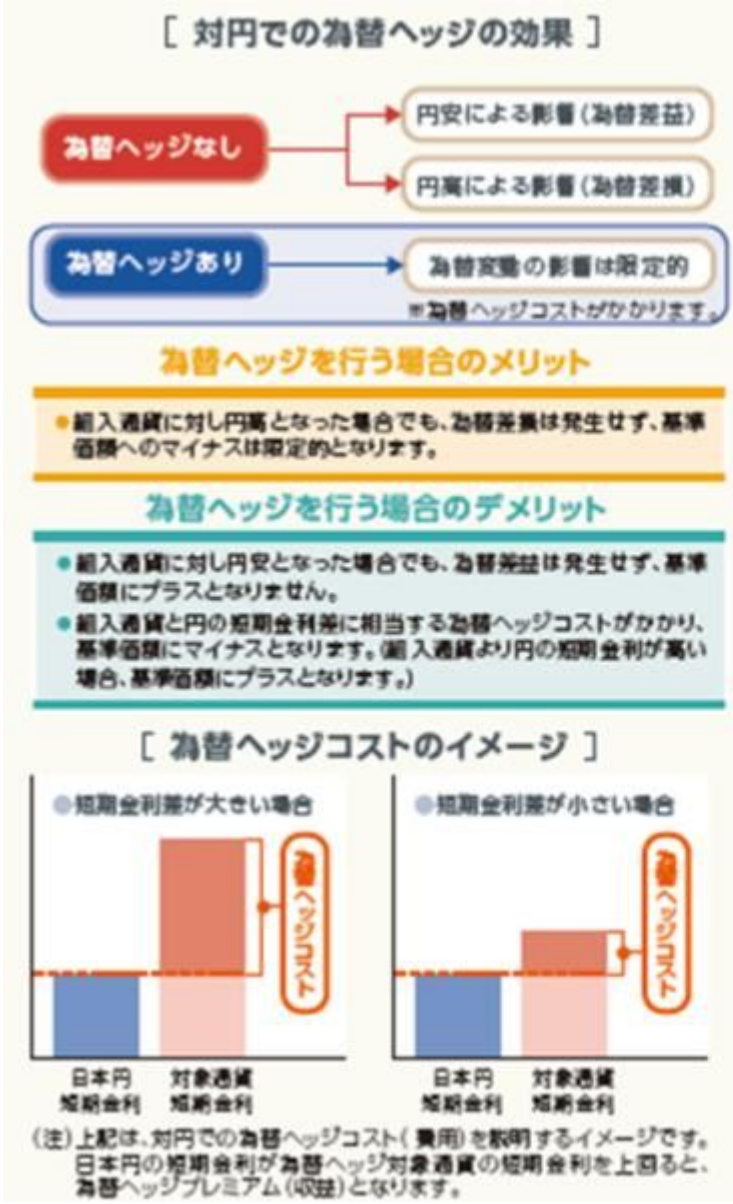
米国非政府系モーゲージ証券
- 非政府系機関が発行する住宅ローンを担保とする証券。
- 政府系と比べ信用力が低い分、利回りが高い。
- 変動金利で設定されることが多い。

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



※上記はイメージ図であり、実際とは異なる場合があります。また、すべての資産を記載しているものではありません。

為替ヘッジについて～「為替ヘッジあり」の場合



■海外証券投資には、為替変動リスクが伴います。

■対円での為替ヘッジとは通貨の先渡取引等を利用し、あらかじめ為替変動リスクを低減する手法です。円高による為替差損を低減する目的で行われます。

■「為替ヘッジあり」は、実質組入外貨建資産に対し、原則として米ドル売り円買いの為替取引を行うため、為替変動の影響は限定的となると考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。また、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

■対円での為替ヘッジには、為替ヘッジコストがかかります。例えば、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行う場合、日米の短期金利差相当分が為替ヘッジコスト*となります。米国の金利上昇等により日米の短期金利差が拡大した場合、為替ヘッジコストが増加します。

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

「為替ヘッジなし」の場合

■海外証券投資には、為替変動リスクが伴います。

■「為替ヘッジなし」は、対円での為替ヘッジを行わないため、為替変動の影響を受けます。

（２）【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

（イ）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

１．有価証券

２．約束手形

３．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ　投資対象とする有価証券

委託会社（委託会社から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。）は、信託金を、主として、「マネー・オープン・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．各ファンドにつき、それぞれ次の外国投資信託の受益証券

ａ．りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）
バミューダ籍外国投資信託「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ 1612（ＪＰＹ）」受益証券

ｂ．りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）
バミューダ籍外国投資信託「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ 1612（ＵＳＤ）」受益証券

２．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

３．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの

４．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第４号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

ハ　投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

※主要投資対象となる投資信託証券の名称、運用会社、主要運用対象、運用の基本方針に関しましては、上記「（１）投資方針」の記載をご覧ください。

（３）【運用体制】

イ　運用体制

当ファンドの運用の主要部分は、委託会社から運用の指図に関する権限の一部の委託を受けたピムコジャパンリミテッドが、投資一任契約（運用委託契約）およびそれに付随するガイドラインに従って行います（運用状況のモニタリング、運用状況の報告など。また、当ファンドが投資す

る他の投資信託の運用は、パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーが行います。）。

委託会社においては、追加設定・一部解約に伴う資金の流出入の管理、運用委託先への委託資産の増減の指示、余裕資金の運用等および運用委託先の運用状況（ガイドライン等の遵守状況、運用パフォーマンスなど）のモニタリング等を行います。

ロ　委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

運用委託先に対しては、運用内容に関する十分な情報開示を求め、投資判断と委託の内容に齟齬がないかを確認します。また、定性・定量面における運用委託先の評価を継続的に実施します。

運用委託先管理部会において運用委託先との契約について年１回見直しの検討および継続可否判断等を行い、運用実績に優位性がある等の合理的理由のないままでの契約の継続は行いません。

〔参考情報：パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーにおける運用体制〕

１．運用体制

主にマクロ経済分析に基づくトップ・ダウン戦略を担当するジェネラリストと、ハイイールド債、投資適格社債、エマージング債、モーゲージ債などの専門分野を担当し、主に個別銘柄選択などのボトム・アップ戦略を担当するスペシャリストから構成されています。

２．運用哲学

運用においては、デュレーション戦略、イールドカーブ戦略、通貨戦略といったトップ・ダウン戦略と、セクター戦略、銘柄選択等のボトム・アップ戦略を融合させより安定した超過収益の獲得を目指します。

（１）コア・アプローチ

ポートフォリオのトータル・リスクをベンチマーク並みにコントロールしつつ、安定した超過収益の獲得を目指します。

（２）ファンダメンタルズの重視

経済分析をベースとした長期的な価値を追求し、短期のタイミングに依存した運用の回避を目指します。

（３）複数の源泉から付加価値を獲得

「リスク・バジェット」を慎重に管理しつつ、グローバルに付加価値の獲得を目指します。

（４）最先端の定量分析ツール

最先端の定量分析ツールでリスクの測定とモニタリングを行います。

３．運用プロセス

・年に１回長期経済予測会議を開催し、経済および政治の長期的な影響の分析をもとにポートフォリオ全体としてのリスクの方向性を決定します。また、四半期毎に短期経済予測会議を開催し、主要経済圏の経済成長率、インフレ率、短期的に市場に影響を及ぼすトレンド等を予測します。

・ポートフォリオ戦略会議を開催し、経済予測会議で形成されたトップ・ダウンの展望と債券市場の各セクターのスペシャリストによるボトム・アップ情報の両方を活用しつつ、国別配分、デュレーション、リスク特性といった投資戦略を策定します。

・各運用チームは、投資戦略に基づきモデルポートフォリオを作成し、インベストメント・コミッティーに提示します。そこでは、戦略の一貫性、リスク管理等が議論され、モデルポートフォリオが最終決定されます。個別銘柄選択に関しては、各セクター・スペシャリストによるボトム・アップ戦略とクレジット・アナリストによるリサーチを活用し、割高／割安の分析結果や流動性等を勘案して決定します。

・完成したモデル・ポートフォリオを基に、ポートフォリオ・マネージャーが顧客毎のガイドラインに準拠した個別ポートフォリオを構築します。

（４）【分配方針】

年４回（原則として毎年３月、６月、９月、12月の12日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

イ　分配対象額の範囲は、元本超過額または経費控除後の利子、配当等収益のいずれか多い金額とします。

ロ　収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ハ　留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

（５）【投資制限】

Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく投資制限

イ　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

ロ　投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

ハ　外貨建資産への直接投資は行いません。

ニ　投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

ホ　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ヘ　資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％を超えないこととします。

（ハ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

Ⅱ　法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

ハ　信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号の２）

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）
ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）

形態	バミューダ籍外国投資信託（円建て）
主要運用対象	「ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）」受益証券
運用の基本方針	・「ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）」受益証券を主要投資対象として、投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。 ・クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）：原則として米ドル売り円買いの為替取引を行います。 ・クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）：原則として対円での為替ヘッジを行いません。
ベンチマーク	ありません。
主な投資制限	・米ドル建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・デリバティブおよび外国為替予約取引の利用は、原則としてヘッジ目的および資産の効率的な運用に資することを目的とします。
決算日	年１回決算（原則として、毎年10月31日）
分配方針	年４回（毎年３月、６月、９月、12月）、原則として利子収入および売買益から分配を行う方針です。
信託報酬	ありません。
販売管理報酬	2021年12月28日まで、年0.76% 2021年12月29日以降、ありません。
その他の費用	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、租税公課、借入費用等がかかります。
信託財産留保額	ありません。
申込手数料	ありません。

<table>
<tr><td>換金手数料</td><td>換金約定日に応じて、換金代金に以下の料率を乗じた額です。
<table><tr><th>換金約定日</th><th>換金手数料率</th></tr><tr><td>2017年12月28日まで</td><td>3.0%</td></tr><tr><td>2017年12月29日から2018年12月28日まで</td><td>2.4%</td></tr><tr><td>2018年12月29日から2019年12月28日まで</td><td>1.8%</td></tr><tr><td>2019年12月29日から2020年12月28日まで</td><td>1.2%</td></tr><tr><td>2020年12月29日から2021年12月28日まで</td><td>0.6%</td></tr><tr><td>2021年12月29日以降</td><td>なし</td></tr></table></td></tr>
<tr><td>投資顧問会社</td><td>パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー</td></tr>
<tr><td>一般投資者の日本での購入の可否</td><td>購入できません。</td></tr>
</table>

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

<table>
<tr><td>形態</td><td>バミューダ籍外国投資信託（米ドル建て）</td></tr>
<tr><td>主要運用対象</td><td>投資する債券などの種類は以下の通りです。
１．各国政府または政府の部局またはその他の政府系金融機関の発行または保証する債券
２．米国の発行体および米国以外の発行体の社債（新株予約権付社債およびＣＰを含みます。）
３．モーゲージ証券およびアセット・バック証券
４．政府または企業が発行するインフレ連動債券
５．仕組債（ハイブリッド証券やインデックス証券、イベント・リンク債およびローン・パーティシペーションを含みます。）
６．ディレード・ファンディング・ローンおよびリボルビング・クレジット・ファシリティ
７．譲渡性預金、定期預金および銀行引受手形
８．現先取引および逆現先取引
９．国際機関の発行する債券
10．米国1933年証券取引法規則144Aに定められている有価証券</td></tr>
<tr><td>運用の基本方針</td><td>長期的な信託財産の成長を図りながら、利子収入の最大化を目指す運用を行います。</td></tr>
<tr><td>参考指数</td><td>ブルームバーグ・バークレイズ米国総合インデックス</td></tr>
</table>

主な投資制限	・通常、世界の幅広い債券および債券関連派生商品等にファンドの総資産額の65%以上を投資します。 ・ファンド全体のデュレーションは0-8年の範囲内で調整します。 ・ファンドは、その資産のすべてを派生商品への投資として、オプション取引、先物取引、先物オプション取引、クレジット・デフォルト・スワップを含むスワップ取引などにも投資できます。 ・投資適格未満の債券等への投資比率は、ファンドの総資産額の50%以下とします。ただし、モーゲージ証券、資産担保証券についてはこの限りではありません。 ・非米国資産への投資比率には制限を設けません。 ・米ドル以外の通貨の組入比率は、取得時においてファンドの総資産額の10%以下とします。 ・新興国債券への投資比率は、取得時においてファンドの総資産額の20%以下とします。 ・非流動性資産への投資比率は、取得時においてファンドの総資産額の15%以下とします。 ・資金の借入れの合計金額がファンドの純資産価額の10%を超える借入残高が生じる借入れは行わないものとします。 ・派生商品の使用はヘッジ目的に限定しません。
決算日	年１回、原則として、毎年10月31日
分配方針	毎月、原則として利子収入および売買益から分配を行う方針です。
信託報酬	ありません。
成功報酬	ありません。
その他の費用	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、租税公課、借入費用など。
申込手数料	ありません。
投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
一般投資者の日本での購入の可否	購入できません。

マネー・オープン・マザーファンド

主要運用対象	円貨建ての短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
ベンチマーク	ありません。
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
決算日	原則として毎年３月１日
信託報酬	ありません。
信託財産留保額	設定・解約時に0.005%
申込手数料	ありません。
委託会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

３【投資リスク】

イ　ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として海外の債券を投資対象としており、その価格は、保有する債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み

入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

（イ）債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

（ロ）派生商品リスク

各種派生商品（先物取引、オプション取引、各種スワップ取引等）の活用は、当該派生商品価格が、その基礎となる資産、利率、指数等の変動以上の値動きをすることがあるため、ファンドの基準価額が大きく下落する要因ともなります。

（ハ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

（ニ）為替変動リスク

「為替ヘッジあり」「為替ヘッジなし」

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

「為替ヘッジあり」

投資する外国投資信託において、原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。したがって、当該外国投資信託に組み入れられている米ドル建て資産については、為替の変動による影響は限定的と考えられます（ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。）。なお、当該外国投資信託に組み入れられている米ドル建て以外の資産については、米ドルに対する当該資産通貨の為替変動の影響を受けます。

（ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

（ヘ）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ト）換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファン

ドの換金申込みの受付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

（チ）収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。この場合、当該元本の一部払戻しに相当する金額についても課税されます。

ロ　投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

［参考情報］パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーのリスク管理体制

実効性のある管理を行うためには、異なる機能を有するセクションが相互牽制を働かせ、多面的なリスク管理、モニタリングを行うことが不可欠であると考えています。すべてのポートフォリオとすべての取引はポートフォリオ・マネジメント、アカウント・マネジメント、コンプライアンス／リーガルの３つの独立した部門が互いに牽制しあう形で監視することによりシステムの信頼性を保っています。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

無手数料です。

※ただし、外国投資信託の報酬代行会社からファンドの販売会社に対して外国投資信託の当初の買付金額に対して3.0%が支払われます。

なお、上記の販売会社に支払われる金額は、ファンドの保有期間中に外国投資信託で発生する販売管理報酬および途中換金時にかかる信託財産留保額をもって、受益者が実質的に負担することとなります。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

ただし、解約の際には、解約請求受付日に応じて１口につき、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に以下の率を乗じて得た信託財産留保額が差し引かれます。

解約請求受付日	信託財産留保額の率
2017年12月28日まで	3.0%
2017年12月29日から2018年12月28日まで	2.4%
2018年12月29日から2019年12月28日まで	1.8%
2019年12月29日から2020年12月28日まで	1.2%
2020年12月29日から2021年12月28日まで	0.6%
2021年12月29日以降	なし

※上記の信託財産留保額は、投資対象とする外国投資信託の換金手数料の支払いに充てられます。

※繰上償還が決定した場合においても、換金時には信託財産留保額がかかります。ただし外国投資信託を全額売却した後は、信託財産留保額を差し引かないことがあります。

（３）【信託報酬等】

<table>
<tr><td rowspan="6"></td><td rowspan="5">ファンド</td><td colspan="3">純資産総額に年1.3284%（税抜き1.23%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。
信託報酬は、各計算期末に当該日の受益権口数に対応する金額を、ならびに信託契約の一部解約または信託終了のときに、当該一部解約または信託終了にかかる受益権口数に対応する金額を、信託財産中から支弁します。
信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率
信託報酬の実質的配分は以下の通りです。
＜信託報酬の配分（税抜き）＞</td></tr>
<tr><td>支払先</td><td>料率</td><td>役務の内容</td></tr>
<tr><td>委託会社</td><td>年0.90%</td><td>ファンド運用の指図等の対価</td></tr>
<tr><td>販売会社</td><td>年0.30%</td><td>交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価</td></tr>
<tr><td>受託会社</td><td>年0.03%</td><td>ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価</td></tr>
<tr><td colspan="3">※上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。
※委託会社の報酬には、ファンドの運用の指図に関する権限の一部の委託先への報酬（年0.648%（税抜き0.6%））が含まれております。</td></tr>
<tr><td>投資対象とする投資信託</td><td colspan="3">2021年12月28日まで　年0.76%程度
2021年12月29日以降　なし
※上記は販売管理報酬です。</td></tr>
<tr><td>実質的な負担</td><td colspan="3">2021年12月28日まで　ファンドの純資産総額に対して
年2.0884%（税抜き1.99%）程度
2021年12月29日以降　ファンドの純資産総額に対して
年1.3284%（税抜き1.23%）程度
※日程が前後する場合があります。</td></tr>
</table>

（４）【その他の手数料等】

イ　信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0054%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

ロ　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利

息は、信託財産中から支弁します。

ハ　有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

※　上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々の取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

※　上記（1）～（4）にかかる手数料等および他の投資信託（ファンド）の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

ファンドの購入時・換金時の手数料等について

■ファンドの購入時は手数料がかかりませんが、換金時に信託財産留保額がかかり、保有期間が長いほどその率が下がります。

■ファンドの信託財産留保額は、投資対象とする外国投資信託の換金手数料に充当します。

■保有期間や基準価額の水準によっては、購入時手数料3.0%を支払った場合と比較して、投資者の費用負担の総額が相対的に高くなることがあります。

［ 信託財産留保額の率 ］

投資対象とする外国投資信託の手数料等について

■外国投資信託では販売管理報酬がかかります。販売管理報酬とは、外国投資信託のスキーム運営に対する報酬であり、投資者には、購入時手数料に相当する費用等をファンドの保有期間中に外国投資信託で発生する販売管理報酬をもって、実質的にご負担いただきます。

■外国投資信託では、換金手数料が換金約定日に応じてかかります。保有期間が長いほど換金手数料率は下がります。

■外国投資信託で発生する換金手数料および販売管理報酬に相当する額（外国投資信託の当初の買付金額の3.0%）が、設定後に外国投資信託の報酬代行会社からファンドの販売会社に支払われます。なお、ファンドまたは外国投資信託の資産から支払われるわけではありません。

ファンド保有時に投資者が信託財産で間接的に負担する費用について

ファンドの信託報酬	ファンドの純資産総額に年1.3284%(税抜き1.23%)の率を乗じた額が毎日計上され、各計算期末ならびに一部解約時または信託終了のときに、信託財産中から支払われます。
投資対象とする外国投資信託の販売管理報酬	2021年12月28日まで　年0.76%程度 2021年12月29日以降　なし
実質的な負担	2021年12月28日まで　ファンドの純資産総額に対して年2.0884%(税抜き1.99%)程度 2021年12月29日以降　ファンドの純資産総額に対して年1.3284%(税抜き1.23%)程度 ※日程が前後する場合があります。

※上記のほか、ファンドの監査費用や有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）が信託財産から支払われます。これらの費用に関しましては、その時々の取引内容等により金額が決定し、運用状況により変化するため、あらかじめ、その金額等を具体的に記載することはできません。
※ファンドの費用（手数料等）の合計額、その上限額、計算方法等は、投資者の保有期間に応じて異なる等の理由により、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

イ　個人の受益者に対する課税

（イ）収益分配時

収益分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

（ロ）一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

ロ　法人の受益者に対する課税

収益分配金ならびに一部解約時および償還時の元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。
公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをＮＩＳＡ、ジュニアＮＩＳＡでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
当ファンドは、配当控除の適用はありません。

※少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が５年間非課税とな

ります。ＮＩＳＡ、ジュニアＮＩＳＡのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。
詳しくは販売会社にお問い合わせください。
※当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合
外貨建資産への直接投資は行いません。
非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

※上記「(５)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2017年9月末現在の情報をもとに作成しています。ただし、「ＮＩＳＡ（ニーサ）」、「ジュニアＮＩＳＡ（ニーサ）」に関しては当ファンドの設定当初の情報をもとに記載しています。税法の改正等により、変更されることがあります。
※単位型の投資信託は、基準価額が元本を下回っている場合においても分配金に対して課税されます。
※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

2017年 9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	9,476,740,605	98.88
親投資信託受益証券	日本	9,997	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	107,243,500	1.12
合計(純資産総額)		9,583,994,102	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。

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

2017年 9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	1,087,555,152	98.43
親投資信託受益証券	日本	9,997	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	17,322,534	1.57
合計(純資産総額)		1,104,887,683	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

イ　主要投資銘柄

2017年 9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
バミューダ	投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）	937,085	10,000	9,370,850,000	10,113	9,476,740,605	98.88
日本	親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	9,985	1.0015	10,000	1.0013	9,997	0.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別の投資比率

2017年 9月29日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	98.88
親投資信託受益証券	0.00
合計	98.88

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

イ　主要投資銘柄

2017年 9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
バミューダ	投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）	109,324	10,000	1,093,240,000	9,948	1,087,555,152	98.43
日本	親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	9,985	1.0015	10,000	1.0013	9,997	0.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別の投資比率

2017年 9月29日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	98.43
親投資信託受益証券	0.00
合計	98.43

②【投資不動産物件】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

年月日	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
特定1期　(2017年 3月13日)	9,705,570,933	9,784,138,962	10,006	10,087
特定2期　(2017年 9月12日)	9,657,504,657	9,799,717,649	10,102	10,250
2016年12月末日	9,724,079,932	—	9,999	—
2017年 1月末日	9,737,921,324	—	10,015	—
2月末日	9,814,381,291	—	10,107	—
3月末日	9,745,181,985	—	10,047	—
4月末日	9,773,400,108	—	10,078	—
5月末日	9,824,693,685	—	10,159	—
6月末日	9,720,701,238	—	10,103	—
7月末日	9,740,159,315	—	10,133	—
8月末日	9,745,381,981	—	10,171	—
9月末日	9,583,994,102	—	10,104	—

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

年月日	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）

特定1期	(2017年 3月13日)	1,150,406,424	1,150,866,558	10,001	10,005
特定2期	(2017年 9月12日)	1,106,067,627	1,106,067,627	9,838	9,838
	2016年12月末日	1,151,267,857	―	9,999	―
	2017年 1月末日	1,129,513,238	―	9,819	―
	2月末日	1,125,396,081	―	9,783	―
	3月末日	1,119,694,527	―	9,748	―
	4月末日	1,124,008,581	―	9,786	―
	5月末日	1,115,580,610	―	9,866	―
	6月末日	1,129,270,764	―	10,035	―
	7月末日	1,117,972,320	―	9,943	―
	8月末日	1,117,383,025	―	9,938	―
	9月末日	1,104,887,683	―	10,176	―

②【分配の推移】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
特定1期	2016年12月29日～2017年 3月13日	81
特定2期	2017年 3月14日～2017年 9月12日	148

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
特定1期	2016年12月29日～2017年 3月13日	4
特定2期	2017年 3月14日～2017年 9月12日	0

③【収益率の推移】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

	収益率（%）
特定1期	0.9
特定2期	2.4

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（当該特定期間中の分配金累計額を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除したものをいいます。

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

	収益率（%）
特定1期	0.1
特定2期	△1.6

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（当該特定期間中の分配金累計額を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除したものをいいます。

（４）【設定及び解約の実績】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

	設定口数（口）	解約口数（口）
特定1期	9,724,790,653	25,033,899
特定2期	0	139,366,117

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

	設定口数（口）	解約口数（口）
特定1期	1,151,352,000	1,015,000
特定2期	0	26,000,000

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

2016年11月21日から2016年12月28日までの募集期間中において、販売会社によって当ファンドの募集の取扱いが行われました。その概要は以下の通りです。

・申込価額	１口当たり１円
・申込手数料	無手数料です。
・申込単位	お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。
・申込取扱場所	販売会社

２【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。
お買付けの販売会社にお申し出ください。
ただし、ニューヨークの取引所の休業日に当たる場合には、解約請求の受付けは行いません。
解約請求のお申込みに関しては、原則として午後３時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。
解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかか

るファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
一部解約金は、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。
一部解約価額は、解約請求受付日に応じて解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に以下の率を乗じて得た信託財産留保額を差し引いた価額となります。

解約請求受付日	信託財産留保額の率
2017年12月28日まで	3.0%
2017年12月29日から2018年12月28日まで	2.4%
2018年12月29日から2019年12月28日まで	1.8%
2019年12月29日から2020年12月28日まで	1.2%
2020年12月29日から2021年12月28日まで	0.6%
2021年12月29日以降	なし

※上記の信託財産留保額は、投資対象とする外国投資信託の換金手数料の支払いに充てられます。
※繰上償還が決定した場合においても、換金時には信託財産留保額がかかります。ただし外国投資信託を全額売却した後は、信託財産留保額を差し引かないことがあります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。
委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ　基準価額の算出方法
基準価額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

ロ　基準価額の算出頻度・照会方法
基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけます。
委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号※	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

※お問い合わせは、原則として営業日の午前９時～午後５時までとさせていただきます。

（2）【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2016年12月29日から2022年6月13日まで、もしくは下記「（５）その他 イ　信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

（４）【計算期間】

毎年３月13日から６月12日まで、６月13日から９月12日まで、９月13日から12月12日まで、および12月13日から翌年３月12日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ　信託の終了

（イ）信託契約の解約

ａ．委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドにつき残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ｂ．委託会社は、この信託が主要投資対象とする外国投資信託証券が存続しないこととなったときは、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

c. 委託会社は、上記ａの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

d. 書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

e. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

f. 上記ｂ～eまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記ｂ～eまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

（ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

（ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

ａ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。

ｂ．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

ｃ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

ａ．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ｂ．分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。）に支払われます。

（ロ）償還金

償還金は、信託終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。）に支払われます。

ハ　信託約款の変更等

（イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

（ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

（ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

（ニ）書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。

（ホ）上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

（ヘ）上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

ニ　反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支

払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ　販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の３ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に１年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

ヘ　委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト　公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。ただし、2018年2月1日以降は、以下の通り変更される予定です。

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

http://www.smam-jp.com

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ　運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は６ヵ月（原則として３月、９月の各決算時までの期間）毎に、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

４【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ　分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。）に支払われます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から５年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ　一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第２　管理及び運営　２　換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ　書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行使することができます。

ホ　帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

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

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

３．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、特定2期（平成29年 3月14日から平成29年 9月12日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

１【財務諸表】

【りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	特定1期 （平成29年 3月13日現在）	特定2期 （平成29年 9月12日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	217,478,112	-
コール・ローン	-	220,936,851
投資信託受益証券	9,593,816,671	9,544,349,544
親投資信託受益証券	10,000	9,997
未収入金	-	6,418,306
流動資産合計	9,811,304,783	9,771,714,698
資産合計	9,811,304,783	9,771,714,698
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	78,568,029	70,746,890
未払解約金	489,400	10,858,150
未払受託者報酬	647,980	791,987
未払委託者報酬	25,919,173	31,679,137
未払利息	-	605
その他未払費用	109,268	133,272
流動負債合計	105,733,850	114,210,041
負債合計	105,733,850	114,210,041
純資産の部		
元本等		
元本	9,699,756,754	9,560,390,637
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,814,179	97,114,020
元本等合計	9,705,570,933	9,657,504,657
純資産合計	9,705,570,933	9,657,504,657
負債純資産合計	9,811,304,783	9,771,714,698

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	特定1期 自　平成28年12月29日 至　平成29年 3月13日	特定2期 自　平成29年 3月14日 至　平成29年 9月12日
営業収益		
受取配当金	105,442,590	209,036,630
有価証券売買等損益	5,105,215	87,499,311
営業収益合計	110,547,805	296,535,941
営業費用		
支払利息	11,325	43,283
受託者報酬	649,184	1,585,038
委託者報酬	25,967,407	63,401,251
その他費用	111,181	277,713
営業費用合計	26,739,097	65,307,285
営業利益又は営業損失（△）	83,808,708	231,228,656
経常利益又は経常損失（△）	83,808,708	231,228,656
当期純利益又は当期純損失（△）	83,808,708	231,228,656
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	5,814,179
剰余金増加額又は欠損金減少額	573,500	2,284,177
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	573,500	2,284,177
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	78,568,029	142,212,992
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,814,179	97,114,020

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	特定2期 自　平成29年 3月14日 至　平成29年 9月12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。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	特定1期 （平成29年 3月13日現在）	特定2期 （平成29年 9月12日現在）
１.　当特定期間の末日における受益権の総数	9,699,756,754口	9,560,390,637口
２.　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.0006円 (10,000口当たりの純資産額　10,006円)	1口当たり純資産額　1.0102円 (10,000口当たりの純資産額　10,102円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	特定1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年 3月13日	特定2期 自 平成29年 3月14日 至 平成29年 9月12日

1.委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 12,981,916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 31,699,707円
2.分配金の計算過程	（自 平成28年12月29日　至 平成29年 3月13日） 第1計算期間末における費用控除後の配当等収益が78,573,732円、純資産額の元本超過額84,382,208円のうち、多い金額である84,382,208円（1万口当たり86.99円）を分配対象収益として、うち78,568,029円（1万口当たり81円）を分配金額としております。	（自 平成29年 3月14日　至 平成29年 6月12日） 第2計算期間末における費用控除後の配当等収益が72,258,115円、純資産額の元本超過額161,357,551円のうち、多い金額である161,357,551円（1万口当たり167.08円）を分配対象収益として、うち71,466,102円（1万口当たり74円）を分配金額としております。 （自 平成29年 6月13日　至 平成29年 9月12日） 第3計算期間末における費用控除後の配当等収益が70,922,349円、純資産額の元本超過額167,860,910円のうち、多い金額である167,860,910円（1万口当たり175.58円）を分配対象収益として、うち70,746,890円（1万口当たり74円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	特定2期 自 平成29年 3月14日 至 平成29年 9月12日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当特定期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 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 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3 .金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
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、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	特定2期 （平成29年 9月12日現在）
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1) 有価証券（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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

特定1期（自　平成28年12月29日　至　平成29年　3月13日）

種　類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	8,626,671円
親投資信託受益証券	―円
合計	8,626,671円

特定2期（自　平成29年　3月14日　至　平成29年　9月12日）

種　類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	6,625,592円
親投資信託受益証券	△1円
合計	6,625,591円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

特定2期 自　平成29年　3月14日 至　平成29年　9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項　目	特定1期 （平成29年　3月13日現在）	特定2期 （平成29年　9月12日現在）
設定年月日	平成28年12月29日	平成28年12月29日
設定元本額	9,724,790,653円	9,724,790,653円
期首元本額	9,724,790,653円	9,699,756,754円
元本残存率	99.7%	98.3%

（４）【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）	944,611	9,544,349,544	
投資信託受益証券合計		944,611	9,544,349,544	
親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	9,985	9,997	
親投資信託受益証券合計		9,985	9,997	
合計			9,544,359,541	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	特定1期 （平成29年 3月13日現在）	特定2期 （平成29年 9月12日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	25,213,008	-
コール・ローン	-	37,404,411
投資信託受益証券	1,128,754,942	1,072,410,196
親投資信託受益証券	10,000	9,997
流動資産合計	1,153,977,950	1,109,824,604
資産合計	1,153,977,950	1,109,824,604
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	460,134	-
未払受託者報酬	75,578	91,255
未払委託者報酬	3,023,132	3,650,273
未払利息	-	102
その他未払費用	12,682	15,347
流動負債合計	3,571,526	3,756,977
負債合計	3,571,526	3,756,977
純資産の部		
元本等		
元本	1,150,337,000	1,124,337,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	69,424	△18,269,373
元本等合計	1,150,406,424	1,106,067,627
純資産合計	1,150,406,424	1,106,067,627
負債純資産合計	1,153,977,950	1,109,824,604

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	特定1期 自　平成28年12月29日 至　平成29年 3月13日	特定2期 自　平成29年 3月14日 至　平成29年 9月12日
営業収益		
受取配当金	12,542,090	24,617,340
有価証券売買等損益	△8,936,679	△36,484,513
営業収益合計	3,605,411	△11,867,173
営業費用		
支払利息	1,197	8,626
受託者報酬	75,590	181,871
委託者報酬	3,023,639	7,274,857
その他費用	13,055	32,729
営業費用合計	3,113,481	7,498,083
営業利益又は営業損失（△）	491,930	△19,365,256
経常利益又は経常損失（△）	491,930	△19,365,256
当期純利益又は当期純損失（△）	491,930	△19,365,256
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	69,424
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,628	1,026,459
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	37,628	1,026,459
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	460,134	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	69,424	△18,269,373

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	特定2期 自　平成29年 3月14日 至　平成29年 9月12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。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	特定1期 （平成29年 3月13日現在）	特定2期 （平成29年 9月12日現在）
１.　当特定期間の末日における受益権の総数	1,150,337,000口	1,124,337,000口
２.　「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　—	元本の欠損　18,269,373円
３.　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.0001円 (10,000口当たりの純資産額　10,001円)	1口当たり純資産額　0.9838円 (10,000口当たりの純資産額　9,838円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	特定1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年 3月13日	特定2期 自 平成29年 3月14日 至 平成29年 9月12日
1.委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 1,511,597円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 3,636,560円
2.分配金の計算過程	（自 平成28年12月29日　至 平成29年 3月13日） 第1計算期間末における費用控除後の配当等収益が9,427,663円、純資産額の元本超過額529,558円のうち、多い金額である9,427,663円（1万口当たり81.96円）を分配対象収益として、うち460,134円（1万口当たり4円）を分配金額としております。	（自 平成29年 3月14日　至 平成29年 6月12日） 第2計算期間末における費用控除後の配当等収益が8,524,042円、純資産額の元本超過額0円のうち、多い金額である8,524,042円（1万口当たり75.39円）が分配対象収益でありますが、分配を行っておりません。 （自 平成29年 6月13日　至 平成29年 9月12日） 第3計算期間末における費用控除後の配当等収益が8,513,787円、純資産額の元本超過額0円のうち、多い金額である8,513,787円（1万口当たり75.72円）が分配対象収益でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	特定2期 自 平成29年 3月14日 至 平成29年 9月12日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当特定期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 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 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3.金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
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、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	特定2期 （平成29年 9月12日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

特定1期（自　平成28年12月29日　至　平成29年　3月13日）

種　類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△8,415,058円
親投資信託受益証券	－円
合計	△8,415,058円

特定2期（自　平成29年　3月14日　至　平成29年　9月12日）

種　類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△10,332,170円
親投資信託受益証券	△1円
合計	△10,332,171円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

特定2期 自　平成29年　3月14日 至　平成29年　9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項　目	特定1期 （平成29年　3月13日現在）	特定2期 （平成29年　9月12日現在）
設定年月日	平成28年12月29日	平成28年12月29日
設定元本額	1,151,352,000円	1,151,352,000円
期首元本額	1,151,352,000円	1,150,337,000円
元本残存率	99.9%	97.6%

（４）【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）	111,628	1,072,410,196	
投資信託受益証券合計		111,628	1,072,410,196	
親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	9,985	9,997	
親投資信託受益証券合計		9,985	9,997	
合計			1,072,420,193	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）は、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）」および「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券を、りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）は、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）」および「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券をそれぞれ主要投資対象としており、各貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はすべて各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Ｅ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＪＰＹ）」および「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ　クラスＢ-Ｊ　1612（ＵＳＤ）」は「ピムコ・バミューダ・インカムファンドＥ」の各シェアクラスです。
なお、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Ｅ

ピムコ・バミューダ・インカムファンドEは、バミューダ籍の外国投資信託で、現地での監査を受けております。
なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

●資産・負債計算書(2016年10月31日現在)

(単位：千円、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	822,849
関連ファンドに対する投資	16,548,484
金融デリバティブ商品	
OTC取引	38,957
カウンターパーティー預け金	275,323
外国通貨（時価）	49
投資有価証券売却による未収入金	1,222
未収利息および未収配当金	28
	17,686,912
負債：	
金融デリバティブ商品	
OTC取引	437,054
投資有価証券購入による未払金	34,678
カストディアンによる当座繰越	276
未払販売手数料	22,155
未払法務費用	5,440
	499,603
純資産	17,187,309
投資有価証券(原価)	816,720
関連ファンドに対する投資(原価)	16,107,661
外国通貨（原価）	49
純資産：	
B-Jクラス1605(円)	3,383,300
B-Jクラス1605(米ドル)	1,232,134
発行済口数：	
B-Jクラス1605(円)	333
B-Jクラス1605(米ドル)	127
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：	
B-Jクラス1605(円)	
(機能通貨建て：円)	10,161
B-Jクラス1605(米ドル)	
(機能通貨建て：円)	9,700

●投資明細表(2016年10月31日現在)

種類			銘柄	額面金額 通貨	額面金額 (単位：千)	時価 通貨	時価 (単位：千)
投資有価証券	パフォーマンス・リンク債		Credit Suisse International, PIMCO Bermuda Income Fund (M)				
4.8%	3.1%		満期日 06/08/2021	USD	350	JPY	38,248
			満期日 06/08/2021	JPY	105,000		108,475
			満期日 10/07/2021	USD	430		45,419
			満期日 10/07/2021	JPY	340,000		341,348
			パフォーマンス・リンク債合計 (原価： 527,361円)				533,490
	短期証券	定期性預金	ANZ National Bank				
	1.7%	1.7%	0.150% 期日 11/01/2016	USD	643		67,524

		Brown Brothers Harriman & Co.		
		0.150% 期日 11/01/2016	1	96
		Citibank N.A.		
		0.150% 期日 11/01/2016	510	53,631
		DBS Bank Ltd.		
		0.150% 期日 11/01/2016	1,013	106,420
		DnB NORBank ASA		
		0.150% 期日 11/01/2016	36	3,742
		JPMorgan Chase & Co.		
		0.150% 期日 11/01/2016	2	160
		Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
		(0.420%) 期日 11/01/2016 JPY	1	1
		0.150% 期日 11/01/2016 USD	550	57,785
				289,359
		短期証券合計		289,359
		(原価： 289,359円)		
		投資有価証券合計		822,849
		(原価： 816,720円)		
関連ファンドに対する投資	ミューチュアル・ファンド	PIMCO Bermuda Income Fund (M)		
96.3%	96.3%	(原価：16,107,661円)	13,436	16,548,484
		関連ファンドに対する投資合計		16,548,484
		(原価： 16,107,661円)		
		投資合計 101.1%	JPY	17,371,333
		(原価： 16,924,381円)		
		金融デリバティブ商品（2.3%）		(398,097)
		(原価またはプレミアム(純額）0円)		
		その他の資産および負債（純額）1.2%		214,073
		純資産 100.0%	JPY	17,187,309

ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）

ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）は、バミューダ籍の外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

●資産・負債計算書(2016年10月31日現在)

(単位：千米ドル、ただし一口当たりを除く)

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

	3,248,180
負債：	
借入およびその他資金調達取引	
買戻し未払金	49,365
空売り未払金	36,742
金融デリバティブ商品	
市場取引又は中央清算機関決済	1,064
OTC取引	14,297
投資有価証券購入による未払金	95,237
TBA購入による未払金	470,392
未払利息	6
カウンターパーティー預り金	21,593
ファンド持分一部解約による未払金	8,681
	697,377
純資産	2,550,803
投資有価証券(原価)	2,888,092
外国通貨（原価）	813
空売りによる収益	36,702
金融デリバティブ商品による収益又は費用（純額）	(17,983)

●投資明細表(2016年10月31日現在)

種類	業種	銘柄	額面金額 通貨	額面金額 (単位：千)	時価 通貨	時価 (単位：千)
投資有価証券	銀行貸付債権証券	Ancestry.com Operations, Inc.				
112.1%	3.5%	5.250% 期日 10/19/2023	USD	800	USD	803
		Avago Technologies Cayman Finance Ltd.				
		3.535% 期日 02/01/2023		67		68
		AWAS Leasing 2011-Ⅰ Ltd.				
		4.870% 期日 10/02/2021		860		876
		Boyd Gaming Corp.				
		3.534% 期日 09/15/2023		200		202
		Camelot U.S. Acquisition 1 Co.				
		4.750% 期日 10/03/2023		200		200
		Charter Communications Operating LLC				
		3.000% 期日 07/01/2020		665		667
		DaVita, Inc.				
		3.500% 期日 06/24/2021		196		196
		Diamond Resorts International, Inc.				
		7.000% 期日 08/11/2023		1,100		1,091
		Energy Future Intermediate Holding Co. LLC				
		4.250% 期日 12/19/2016		43,296		43,575
		4.250% 期日 06/30/2017		1,200		1,208
		FCA US LLC				
		3.250% 期日 12/31/2018		758		759
		HCA, Inc.				
		3.588% 期日 02/15/2024		3,024		3,052
		HD Supply, Inc.				
		3.630% 期日 10/17/2023		200		200
		Hilton Worldwide Finance LLC				
		3.034% 期日 10/25/2023		6,496		6,540
		3.500% 期日 10/26/2020		635		639
		iHeartCommunications, Inc.				
		7.284% 期日 01/30/2019		11,688		8,905
		Intelsat Jackson Holdings S.A.				
		3.750% 期日 06/30/2019		3,800		3,641
		KFC Holding Co.				
		3.286% 期日 06/16/2023		1,097		1,110
		MGM Growth Properties Operating Partnership LP				
		3.500% 期日 04/25/2023		617		620
		Mission Broadcasting, Inc.				

		3.000% 期日 09/26/2023		57	57
		Nexstar Broadcasting, Inc.			
		4.000% 期日 09/21/2023		643	646
		Nielsen Finance LLC			
		3.031% 期日 09/23/2023		100	101
		Numericable-SFR S.A.			
		4.000% 期日 01/13/2025		1,400	1,397
		Reynolds Group Holdings, Inc.			
		4.250% 期日 02/05/2023		200	201
		Sequa Corp.			
		5.250% 期日 06/19/2017		358	331
		Serta Simmons Holdings LLC			
		4.500% 期日 10/20/2023		200	202
		Tex Operations Co. LLC			
		5.000% 期日 10/17/2017		532	537
		T-Mobile USA, Inc.			
		3.500% 期日 11/09/2022		794	801
		Transdigm, Inc.			
		3.750% 期日 06/09/2023		700	699
		Univision Communications, Inc.			
		4.000% 期日 03/01/2020		6,914	6,934
		UPC Financing Partnership			
		4.080% 期日 08/31/2024		1,000	1,006
		Valeant Pharmaceuticals International, Inc.			
		5.250% 期日 08/05/2020		300	300
		5.500% 期日 04/01/2022		105	105
		Vertiv Co.			
		5.000% 期日 09/29/2023		400	399
		銀行貸付債権証券合計			88,068
		(原価：90,442米ドル)			
社債券等	銀行および金融	AerCap Aviation Solutions BV			
21.3%	13.6%	6.375% 期日 05/30/2017		1,073	1,103
		AerCap Ireland Capital Ltd.			
		3.750% 期日 05/15/2019		1,850	1,903
		4.250% 期日 07/01/2020		955	993
		4.500% 期日 05/15/2021		800	834
		AGFC Capital Trust I			
		6.000% 期日 01/15/2067		2,200	1,188
		Ally Financial, Inc.			
		2.750% 期日 01/30/2017		1,110	1,111
		3.250% 期日 09/29/2017		600	604
		3.500% 期日 01/27/2019		300	301
		4.750% 期日 09/10/2018		2,350	2,421
		5.500% 期日 02/15/2017		7,930	8,009
		6.250% 期日 12/01/2017		5,090	5,281
		American International Group, Inc.			
		3.900% 期日 04/01/2026		330	346
		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
		6.750% 期日 02/18/2020	EUR	2,200	2,332
		9.000% 期日 05/09/2018	USD	1,000	1,042
		Banco Espirito Santo S.A.			
		2.625% 期日 05/08/2017	EUR	3,100	935
		Banco Popular Espanol S.A.			
		8.250% 期日 04/10/2020		7,600	7,696
		Banco Santander S.A.			
		6.250% 期日 09/11/2021		5,700	5,844
		Bank of America Corp.			
		3.875% 期日 08/01/2025	USD	1,120	1,181
		Barclays Bank PLC			
		7.625% 期日 11/21/2022		5,640	6,306
		7.750% 期日 04/10/2023		3,000	3,161
		14.000% 期日 06/15/2019	GBP	9,970	15,031
		Barclays PLC			
		3.250% 期日 02/12/2027		1,000	1,167
		6.500% 期日 09/15/2019	EUR	2,300	2,378

7.875% 期日 03/15/2022	USD	1,200	1,194
7.875% 期日 09/15/2022	GBP	5,353	6,412
8.000% 期日 12/15/2020	EUR	600	675
8.250% 期日 12/15/2018	USD	200	203
BGC Partners, Inc.			
5.125% 期日 05/27/2021		400	419
5.375% 期日 12/09/2019		1,450	1,535
BNP Paribas S.A.			
7.625% 期日 03/30/2021		600	629
BPCE S.A.			
12.500% 期日 09/30/2019		800	1,013
Brixmor Operating Partnership LP			
3.250% 期日 09/15/2023		400	400
CIT Group, Inc.			
3.875% 期日 02/19/2019		972	989
4.250% 期日 08/15/2017		40	41
5.000% 期日 05/15/2017		6,025	6,108
5.250% 期日 03/15/2018		1,611	1,672
Citigroup, Inc.			
2.255% 期日 09/01/2023		280	281
Cooperatieve Rabobank UA			
6.625% 期日 06/29/2021	EUR	1,800	2,113
6.875% 期日 03/19/2020		100	130
8.400% 期日 06/29/2017	USD	600	624
Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.			
7.500% 期日 07/08/2026	GBP	600	880
Credit Agricole S.A.			
7.500% 期日 06/23/2026		1,200	1,477
7.875% 期日 01/23/2024	USD	4,346	4,419
Credit Suisse AG			
6.500% 期日 08/08/2023		3,985	4,351
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.			
2.750% 期日 08/08/2025	GBP	600	702
3.750% 期日 03/26/2025	USD	1,300	1,292
Deutsche Bank AG			
1.350% 期日 05/30/2017		400	397
2.717% 期日 05/10/2019		80	79
4.250% 期日 10/14/2021		10,000	10,077
6.000% 期日 09/01/2017		60	62
Digital Euro Finco LLC			
2.625% 期日 04/15/2024	EUR	1,400	1,610
Host Hotels & Resorts LP			
4.000% 期日 06/15/2025	USD	400	406
HSBC Holdings PLC			
2.625% 期日 08/16/2028	GBP	360	417
4.300% 期日 03/08/2026	USD	500	532
6.000% 期日 09/29/2023	EUR	8,210	9,382
International Lease Finance Corp.			
3.875% 期日 04/15/2018	USD	600	615
8.750% 期日 03/15/2017		1,300	1,334
8.875% 期日 09/01/2017		50	53
Jefferies Finance LLC			
6.875% 期日 04/15/2022		1,000	950
Jefferies LoanCore LLC			
6.875% 期日 06/01/2020		1,200	1,140
JPMorgan Chase & Co.			
2.322% 期日 03/01/2021		1,100	1,130
2.550% 期日 03/01/2021		1,000	1,016
2.950% 期日 10/01/2026		7,150	7,085
KBC Bank NV			
8.000% 期日 01/25/2023		800	849
Kennedy Wilson Europe Real Estate PLC			
3.950% 期日 06/30/2022	GBP	500	616
Lloyds Bank PLC			
12.000% 期日 12/16/2024	USD	200	273
Lloyds Banking Group PLC			
3.100% 期日 07/06/2021		200	206

7.500% 期日 06/27/2024		2,900	2,994
7.625% 期日 06/27/2023	GBP	5,526	7,042
7.875% 期日 06/27/2029		1,700	2,213
Loews Corp.			
3.750% 期日 04/01/2026	USD	500	526
Merlin Properties Socimi S.A.			
1.875% 期日 11/02/2026	EUR	900	971
National Australia Bank Ltd.			
1.375% 期日 07/12/2019	USD	1,800	1,787
Navient Corp.			
4.625% 期日 09/25/2017		2,435	2,473
4.875% 期日 06/17/2019		300	303
5.500% 期日 01/15/2019		774	791
5.625% 期日 08/01/2033		4,953	3,950
6.625% 期日 07/26/2021		130	131
8.450% 期日 06/15/2018		585	634
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
2.000% 期日 04/01/2017	DKK	7,700	1,148
2.000% 期日 10/01/2047		2,923	420
Novo Banco S.A.			
5.000% 期日 04/04/2019	EUR	33	28
5.000% 期日 04/23/2019		4,528	3,902
5.000% 期日 05/14/2019		119	102
5.000% 期日 05/21/2019		202	174
Nykredit Realkredit A/S			
1.000% 期日 07/01/2017	DKK	183,300	27,260
2.000% 期日 04/01/2017		7,600	1,131
2.500% 期日 10/01/2047		13,797	2,050
Preferred Term Securities XVIII Ltd.			
1.230% 期日 09/23/2035	USD	1,127	935
Preferred Term Securities X XIV Ltd.			
1.150% 期日 03/22/2037		1,413	1,018
1.230% 期日 03/22/2037		5,033	2,416
Realkredit Danmark A/S			
1.000% 期日 01/01/2017	DKK	8,478	1,253
1.000% 期日 04/01/2017		17,630	2,613
1.000% 期日 01/01/2018		4,700	704
1.000% 期日 04/01/2018		11,800	1,770
2.000% 期日 01/01/2017		31,300	4,629
2.000% 期日 04/01/2017		64,315	9,573
2.500% 期日 10/01/2047		12,373	1,839
3.000% 期日 10/01/2047		10,261	1,545
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			
9.750% 期日 01/06/2027	USD	657	622
Royal Bank of Scotland Group PLC			
2.500% 期日 03/22/2023	EUR	6,700	7,380
3.875% 期日 09/12/2023	USD	5,000	4,903
4.800% 期日 04/05/2026		1,200	1,226
7.500% 期日 08/10/2020		1,900	1,748
8.000% 期日 08/10/2025		1,400	1,334
8.625% 期日 08/15/2021		2,000	1,995
Royal Bank of Scotland PLC			
9.500% 期日 03/16/2022		1,800	1,848
13.125% 期日 03/19/2022	AUD	3,700	2,920
Santander Holdings USA, Inc.			
4.500% 期日 07/17/2025	USD	2,000	2,045
Santander UK Group Holdings PLC			
2.875% 期日 08/05/2021		800	798
7.375% 期日 06/24/2022	GBP	1,900	2,332
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
3.352% 期日 11/15/2019	EUR	5,600	6,435
5.717% 期日 06/16/2021	USD	900	962
6.125% 期日 02/07/2022		10,600	11,542
SL Green Realty Corp.			
7.750% 期日 03/15/2020		500	578
Societe Generale S.A.			
7.875% 期日 12/18/2023		600	596

	8.000% 期日 09/29/2025		1,700	1,719
	Sovran Acquisition LP			
	3.500% 期日 07/01/2026		1,200	1,206
	Springleaf Finance Corp.			
	5.250% 期日 12/15/2019		250	252
	6.500% 期日 09/15/2017		400	415
	6.900% 期日 12/15/2017		4,490	4,715
	8.250% 期日 12/15/2020		15,389	16,736
	Tesco Property Finance 2 PLC			
	6.052% 期日 10/13/2039	GBP	2,773	3,567
	Tesco Property Finance 3 PLC			
	5.744% 期日 04/13/2040		167	203
	Tesco Property Finance 4 PLC			
	5.801% 期日 10/13/2040		405	480
	Tesco Property Finance 6 PLC			
	5.411% 期日 07/13/2044		1,990	2,306
	TIG FINCO PLC			
	8.500% 期日 03/02/2020		2,266	2,841
	8.750% 期日 04/02/2020		1,724	1,926
	UBS AG			
	5.125% 期日 05/15/2024	USD	500	521
	7.250% 期日 02/22/2022		10,000	10,160
	7.625% 期日 08/17/2022		1,000	1,161
	UBS Group AG			
	5.750% 期日 02/19/2022	EUR	3,200	3,674
	7.000% 期日 02/19/2025	USD	200	214
	UBS Group Funding Jersey Ltd.			
	2.950% 期日 09/24/2020		310	317
	4.125% 期日 09/24/2025		2,470	2,578
	4.125% 期日 04/15/2026		2,500	2,615
	Ventas Realty LP			
	3.250% 期日 10/15/2026		200	199
	Wells Fargo & Co.			
	2.175% 期日 03/04/2021		500	510
	2.500% 期日 03/04/2021		600	607
	3.000% 期日 10/23/2026		3,910	3,888
				347,354
産業	Aetna, Inc.			
4.8%	2.400% 期日 06/15/2021		55	56
	3.200% 期日 06/15/2026		671	675
	4.250% 期日 06/15/2036		293	298
	4.375% 期日 06/15/2046		245	250
	Altice Luxembourg S.A.			
	7.250% 期日 05/15/2022	EUR	300	350
	Amgen, Inc.			
	4.400% 期日 05/01/2045	USD	200	204
	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.			
	4.700% 期日 02/01/2036		354	393
	4.900% 期日 02/01/2046		553	634
	BMC Software Finance, Inc.			
	8.125% 期日 07/15/2021		37	34
	Boston Scientific Corp.			
	3.375% 期日 05/15/2022		2,260	2,361
	3.850% 期日 05/15/2025		200	210
	Boxer Parent Co., Inc.			
	9.000% 期日 10/15/2019		519	480
	Caesars Entertainment Operating Co., Inc.			
	8.500% 期日 02/15/2020		5,726	5,912
	9.000% 期日 02/15/2020		8,739	8,977
	11.250% 期日 06/01/2017		9,816	9,963
	California Resources Corp.			
	8.000% 期日 12/15/2022		4,045	2,751
	Charter Communications Operating LLC			
	3.579% 期日 07/23/2020		441	458
	4.464% 期日 07/23/2022		661	705
	4.908% 期日 07/23/2025		992	1,072
	6.384% 期日 10/23/2035		220	254

Chesapeake Energy Corp.			
4.130% 期日 04/15/2019		189	175
CNPC General Capital Ltd.			
1.720% 期日 11/25/2017		1,500	1,506
CVS Pass-Through Trust			
7.507% 期日 01/10/2032		782	995
Diamond Resorts International, Inc.			
7.750% 期日 09/01/2023		2,949	2,905
Enterprise Inns PLC			
6.375% 期日 02/15/2022	GBP	5,600	6,837
6.500% 期日 12/06/2018		6,560	8,791
6.875% 期日 02/15/2021		50	66
Express Scripts Holding Co.			
4.800% 期日 07/15/2046	USD	219	219
First Quantum Minerals Ltd.			
6.750% 期日 02/15/2020		900	866
7.000% 期日 02/15/2021		500	477
7.250% 期日 10/15/2019		300	297
HCA, Inc.			
3.750% 期日 03/15/2019		1,045	1,071
Hellenic Railways Organization S.A.			
4.028% 期日 03/17/2017	EUR	400	432
4.500% 期日 12/06/2016	JPY	26,000	246
5.014% 期日 12/27/2017	EUR	180	190
Hilton Domestic Operating Co., Inc.			
4.250% 期日 09/01/2024	USD	700	705
Hyatt Hotels Corp.			
4.850% 期日 03/15/2026		200	220
iHeartCommunications, Inc.			
9.000% 期日 03/01/2021		4,900	3,522
9.000% 期日 09/15/2022		966	690
IHO Verwaltungs GmbH			
3.750% 期日 09/15/2026	EUR	100	109
Intrepid Aviation Group Holdings LLC			
6.875% 期日 02/15/2019	USD	2,406	2,190
Kinder Morgan, Inc.			
7.250% 期日 06/01/2018		200	216
Kraft Heinz Foods Co.			
3.000% 期日 06/01/2026		300	297
3.950% 期日 07/15/2025		155	166
4.375% 期日 06/01/2046		326	332
Lennox International, Inc.			
3.000% 期日 11/15/2023		450	450
Norwegian Air Shuttle ASA 2016-1 Class A Pass-Through Trust			
4.875% 期日 05/10/2028		500	502
Perstorp Holding AB			
8.750% 期日 05/15/2017		7,370	7,390
9.000% 期日 05/15/2017	EUR	3,600	3,963
QVC, Inc.			
5.450% 期日 08/15/2034	USD	50	46
RCI Banque S.A.			
3.500% 期日 04/03/2018		1,824	1,872
Russian Railways via RZD Capital PLC			
7.487% 期日 03/25/2031	GBP	6,300	8,726
Sabine Pass LNG LP			
7.500% 期日 11/30/2016	USD	1,240	1,246
SBA Tower Trust			
2.877% 期日 07/15/2021		1,500	1,521
Sequa Corp.			
7.000% 期日 12/15/2017		399	219
SFR Group S.A.			
5.625% 期日 05/15/2024	EUR	3,420	3,944
7.375% 期日 05/01/2026	USD	5,025	5,082
Spanish Broadcasting System, Inc.			
12.500% 期日 04/15/2017		900	898
Spirit Issuer PLC			

	3.076% 期日 12/28/2031	GBP	760	864
	6.582% 期日 12/28/2027		450	595
	Sprint Spectrum Co. LLC			
	3.360% 期日 09/20/2021	USD	300	302
	Times Square Hotel Trust			
	8.528% 期日 08/01/2026		2,178	2,563
	Transocean, Inc.			
	9.000% 期日 07/15/2023		280	275
	UAL 2009-1 Pass-Through Trust			
	10.400% 期日 11/01/2016		4,890	4,911
	Unique Pub Finance Co. PLC			
	5.659% 期日 06/30/2027	GBP	1,669	2,160
	6.542% 期日 03/30/2021		1,247	1,635
	United Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust			
	3.100% 期日 07/07/2028	USD	500	513
	Valeant Pharmaceuticals International, Inc.			
	4.500% 期日 05/15/2023	EUR	800	674
	Viacom, Inc.			
	2.750% 期日 12/15/2019	USD	400	407
	Volkswagen Bank GmbH			
	0.112% 期日 11/27/2017	EUR	200	218
	Volkswagen Group of America Finance LLC			
	1.650% 期日 05/22/2018	USD	300	299
	Westmoreland Coal Co.			
	8.750% 期日 01/01/2022		710	561
				121,393
公共事業	AT&T, Inc.			
2.9%	5.650% 期日 02/15/2047		264	292
	El Paso Natural Gas Co. LLC			
	8.625% 期日 01/15/2022		1,900	2,374
	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
	4.375% 期日 09/19/2022		5,950	5,887
	6.000% 期日 11/27/2023		12,200	12,948
	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.			
	4.950% 期日 02/06/2028		800	787
	5.999% 期日 01/23/2021		1,622	1,744
	6.510% 期日 03/07/2022		6,398	7,025
	6.605% 期日 02/13/2018	EUR	100	117
	7.288% 期日 08/16/2037	USD	937	1,068
	8.146% 期日 04/11/2018		300	323
	8.625% 期日 04/28/2034		2,622	3,376
	9.250% 期日 04/23/2019		7,200	8,231
	Illinois Power Generating Co.			
	6.300% 期日 04/01/2020		35	14
	7.000% 期日 04/15/2018		5,000	1,900
	Kinder Morgan Energy Partners LP			
	3.450% 期日 02/15/2023		100	100
	Petrobras Global Finance BV			
	3.250% 期日 04/01/2019	EUR	320	355
	3.737% 期日 03/17/2020	USD	2,899	2,858
	4.250% 期日 10/02/2023	EUR	1,400	1,470
	4.375% 期日 05/20/2023	USD	600	545
	4.875% 期日 03/17/2020		1,269	1,281
	5.375% 期日 01/27/2021		1,203	1,194
	5.625% 期日 05/20/2043		75	59
	5.750% 期日 01/20/2020		825	853
	5.875% 期日 03/07/2022	EUR	1,000	1,154
	6.250% 期日 03/17/2024	USD	30	30
	6.250% 期日 12/14/2026	GBP	1,600	1,872
	6.625% 期日 01/16/2034		900	999
	6.750% 期日 01/27/2041	USD	710	633
	6.850% 期日 06/05/2115		2,144	1,833
	6.875% 期日 01/20/2040		464	418
	7.875% 期日 03/15/2019		2,500	2,694
	8.375% 期日 05/23/2021		1,620	1,796
	8.750% 期日 05/23/2026		540	610
	Sprint Communications, Inc.			

	6.000% 期日 12/01/2016		305	306
	7.000% 期日 08/15/2020		500	521
	8.375% 期日 08/15/2017		5,478	5,711
	9.125% 期日 03/01/2017		1,400	1,432
	Sprint Corp.			
	7.125% 期日 06/15/2024		270	254
	Verizon Communications, Inc.			
	4.125% 期日 08/15/2046		270	259
	5.150% 期日 09/15/2023		100	115
				75,438
	社債券等合計			544,185
	（原価：554,144米ドル）			
地方債 0.1%	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			
	6.630% 期日 02/01/2035		655	699
	6.725% 期日 04/01/2035		90	96
	7.350% 期日 07/01/2035		400	449
	Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015			
	7.375% 期日 01/01/2033		440	474
	7.750% 期日 01/01/2042		780	828
	地方債合計			2,546
	（原価：2,434米ドル）			
米国政府機関債 12.3%	Fannie Mae			
	2.500% 期日 10/01/2022		765	788
	3.000% 期日 03/01/2031		8,592	8,999
	3.500% 期日 08/01/2042		85	89
	3.500% 期日 02/01/2045		8,531	8,971
	3.500% 期日 07/01/2045		206	217
	3.500% 期日 12/01/2045		862	907
	3.500% 期日 02/01/2046	USD	20,023	21,026
	4.534% 期日 05/25/2025		180	186
	Fannie Mae, TBA			
	2.500% 期日 12/01/2031		3,000	3,082
	3.000% 期日 12/01/2031		3,000	3,136
	3.000% 期日 12/01/2046		107,200	110,160
	3.000% 期日 01/01/2047		5,000	5,128
	3.500% 期日 12/01/2046		22,000	23,075
	Freddie Mac			
	3.000% 期日 08/01/2046		4,941	5,093
	3.784% 期日 05/25/2025		250	258
	6.015% 期日 06/15/2042		116	28
	Freddie Mac, TBA			
	3.000% 期日 12/01/2046		83,000	85,282
	Ginnie Mae			
	4.000% 期日 02/20/2046		330	353
	4.000% 期日 03/20/2046		34,000	36,447
	米国政府機関債合計			313,225
	（原価：313,905米ドル）			
米国財務省証券 9.4%	Treasury Inflation Protected Securities			
	0.125% 期日 04/15/2020		1,131	1,153
	0.625% 期日 07/15/2021		85	90
	2.375% 期日 01/15/2025		25,325	30,004
	U.S. Treasury Bonds			
	3.125% 期日 02/15/2043		78	87
	3.625% 期日 08/15/2043		263	320
	3.625% 期日 02/15/2044		300	365
	3.750% 期日 11/15/2043		120	149
	U.S. Treasury Notes			
	1.125% 期日 09/30/2021		37,390	37,038
	1.250% 期日 10/31/2021		21,800	21,735
	1.375% 期日 08/31/2023		56,200	55,368
	1.500% 期日 01/31/2022		6,300	6,333

	1.625% 期日 02/15/2026		106	104
	1.875% 期日 08/31/2022		12,600	12,870
	2.000% 期日 02/15/2025		13,421	13,680
	2.000% 期日 08/15/2025		10,100	10,275
	2.125% 期日 08/15/2021		42,900	44,465
	2.250% 期日 11/15/2025		6,000	6,224
	米国財務省証券合計			240,260
	(原価：240,871米ドル)			
モーゲージ証券 45.1%	Accredited Mortgage Loan Trust			
	0.794% 期日 09/25/2036		1,600	1,419
	1.164% 期日 07/25/2035		9,806	7,829
	ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
	0.689% 期日 08/25/2036		6,510	5,703
	1.434% 期日 08/25/2035		5,023	4,062
	ALESCO Preferred Funding X I Ltd.			
	1.313% 期日 12/23/2036		5,000	2,475
	Alternative Loan Trust			
	0.704% 期日 01/25/2037		23,219	21,394
	0.704% 期日 07/25/2046		18,779	16,621
	0.714% 期日 07/25/2036		17,799	13,628
	0.716% 期日 09/20/2046		3,767	2,766
	0.736% 期日 03/20/2046		13,814	10,331
	0.784% 期日 12/25/2046		27,787	17,097
	2.959% 期日 08/25/2035		1,327	1,081
	3.173% 期日 09/25/2034		3,106	3,047
	5.500% 期日 08/25/2035		171	165
	5.500% 期日 02/25/2036		37	32
	6.000% 期日 07/25/2037		93	89
	Ameriquest Mortgage Securities Trust			
	0.944% 期日 03/25/2036	USD	27,500	20,247
	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
	1.596% 期日 09/25/2032		833	773
	2.289% 期日 10/25/2034		9,000	6,661
	Argent Securities Trust			
	0.714% 期日 04/25/2036		9,708	3,949
	Argent Securities, Inc.			
	3.234% 期日 09/25/2033		2,992	2,895
	Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
	1.194% 期日 06/25/2035		456	456
	Asset-Backed Funding Certificates Trust			
	1.269% 期日 06/25/2035		12,354	10,682
	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust			
	1.335% 期日 06/15/2028		5,000	4,995
	Banc of America Alternative Loan Trust			
	5.768% 期日 04/25/2022		484	469
	6.000% 期日 07/25/2046		4,672	4,099
	BCAP LLC Trust			
	0.685% 期日 03/26/2037		968	961
	0.732% 期日 07/26/2036		1,107	1,052
	1.045% 期日 11/26/2035		657	648
	1.265% 期日 01/26/2036		70	70
	BCRR Trust			
	5.858% 期日 07/17/2040		14,720	14,792
	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
	3.154% 期日 11/25/2034		680	654
	Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust			
	0.734% 期日 04/25/2037		11,411	12,147
	0.774% 期日 02/25/2037		12,309	10,795
	0.894% 期日 04/25/2036		12,900	12,134
	0.964% 期日 12/25/2035		9,109	8,551
	1.034% 期日 12/25/2035		6,400	6,015
	1.234% 期日 11/25/2035		7,344	6,495
	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			

0.794% 期日 10/25/2036		9,606	9,261
2.550% 期日 06/25/2035		3,853	3,514
Blackstone CQP Holdco LP			
9.625% 期日 03/19/2019		9,304	9,409
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage			
5.540% 期日 01/25/2039		3,004	2,239
Celtic Residential Irish Mortgage Securitisation No.12 Ltd.			
0.000% 期日 03/18/2049	EUR	8,647	9,277
Centex Home Equity Loan Trust			
1.179% 期日 03/25/2035	USD	5,514	4,821
CGCMT Trust			
5.858% 期日 07/17/2040		1,028	1,028
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
0.894% 期日 03/25/2035		1,176	1,061
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
0.097% 期日 03/10/2047		25,400	457
Citigroup Mortgage Loan Trust			
0.874% 期日 01/25/2036		197	194
1.154% 期日 12/25/2035		15,398	14,773
2.789% 期日 08/25/2036		8,912	7,439
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
0.794% 期日 01/25/2037		1,860	1,630
1.114% 期日 07/25/2035		3,174	3,063
Commercial Mortgage Trust			
0.151% 期日 04/10/2047		33,000	388
Conseco Financial Corp.			
7.500% 期日 03/01/2030		68,771	57,424
7.700% 期日 09/15/2026		3,881	4,240
Countrywide Asset-Backed Certificates			
0.674% 期日 06/25/2035		1,942	1,510
0.674% 期日 07/25/2037	USD	4,552	3,815
0.704% 期日 06/25/2047		5,255	4,979
1.034% 期日 08/26/2033		36	32
2.139% 期日 01/25/2034		1,500	1,433
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
0.684% 期日 04/25/2046		1,562	1,536
0.774% 期日 03/25/2037		33,000	26,114
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2.954% 期日 06/25/2034		4	4
3.032% 期日 11/25/2034		30	29
5.500% 期日 11/25/2035		8,810	8,282
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
5.695% 期日 10/26/2036		633	466
CWABS Asset-Backed Certificates Trust			
1.659% 期日 12/25/2034		3,150	3,064
Deco 10 - Pan Europe 4 PLC			
0.000% 期日 10/27/2019	EUR	838	915
DECO 12-UK 4 PLC			
0.595% 期日 01/27/2020	GBP	3,655	4,432
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
0.662% 期日 11/27/2036	USD	8,706	8,017
EMC Mortgage Loan Trust			
1.534% 期日 04/25/2042		2,475	2,402
Eurosail PLC			
0.550% 期日 09/10/2044	GBP	1,987	2,391
Eurosail-UK PLC			
1.149% 期日 09/13/2045		8,260	9,130
1.329% 期日 06/13/2045		20,854	23,683
FBR Securitization Trust			
1.209% 期日 10/25/2035	USD	13,418	6,371
1.214% 期日 10/25/2035		19,913	18,641
1.299% 期日 09/25/2035		7,500	5,932
First Franklin Mortgage Loan Trust			
0.684% 期日 07/25/2036		2,167	2,092
0.694% 期日 04/25/2036		10,934	9,690

FORT CRE LLC			
2.025% 期日 05/21/2036		10,299	10,303
GE Business Loan Trust			
0.715% 期日 11/15/2034		5,007	4,644
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
0.814% 期日 11/25/2045		129	93
Grifonas Finance PLC			
0.088% 期日 08/28/2039	EUR	1,435	1,185
GS Mortgage Securities Trust			
5.794% 期日 08/10/2045	USD	16,093	16,287
GSAA Home Equity Trust			
6.500% 期日 11/25/2037		31	22
GSAMP Trust			
0.684% 期日 06/25/2036		8,421	8,043
0.694% 期日 05/25/2046		2,103	1,974
0.964% 期日 11/25/2035		8,032	5,028
HarborView Mortgage Loan Trust			
0.768% 期日 12/19/2036		2,304	1,729
Hawksmoor Mortgages PLC			
1.796% 期日 05/25/2053	GBP	9,800	12,057
Home Equity Asset Trust			
0.844% 期日 07/25/2036	USD	785	773
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
0.714% 期日 06/25/2036		7,769	7,293
1.194% 期日 08/25/2035		5,750	4,816
Jefferies Resecuritization Trust			
6.503% 期日 06/25/2047		1,503	1,399
JPMorgan Alternative Loan Trust			
2.991% 期日 03/25/2036		1,029	811
5.730% 期日 03/25/2036		1,391	1,356
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.			
1.985% 期日 01/15/2033		1,900	1,906
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
5.336% 期日 05/15/2047		955	954
5.431% 期日 06/12/2047	USD	17,149	17,204
5.882% 期日 02/12/2051		5,830	6,018
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			
0.714% 期日 03/25/2036		18,762	17,279
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
0.704% 期日 04/25/2036		1,472	1,454
0.734% 期日 05/25/2036		20,379	19,712
0.804% 期日 05/25/2036		12,851	10,508
0.804% 期日 08/25/2036		8,600	6,282
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			
0.000% 期日 06/15/2045	EUR	8,030	6,752
LB-UBS Commercial Mortgage Trust			
6.114% 期日 07/15/2040	USD	1,500	1,539
6.832% 期日 06/15/2036		1,307	1,307
Long Beach Mortgage Loan Trust			
0.724% 期日 02/25/2036		9,295	6,255
0.724% 期日 03/25/2046		20,393	10,362
0.774% 期日 01/25/2046		1,541	1,463
2.634% 期日 06/25/2034		2,390	2,310
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
3.784% 期日 03/25/2032		3,600	3,660
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
2.705% 期日 04/25/2034		6	6
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
0.754% 期日 11/25/2036		44	29
1.684% 期日 08/25/2037		21,789	17,173
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
0.914% 期日 08/25/2035		66	64
2.625% 期日 02/25/2033		40	39
Merrill Lynch-CFC Commercial Mortgage Trust			
5.485% 期日 03/12/2051		3,450	3,477
Morgan Stanley ABS Capital Ⅰ, Inc. Trust			
1.269% 期日 07/25/2035		5,512	4,566

1.534% 期日 03/25/2033		176	169
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital Ⅰ, Inc. Trust			
1.239% 期日 07/25/2035		4,400	4,224
Morgan Stanley Capital Ⅰ Trust			
5.422% 期日 02/12/2044		1,495	1,496
5.642% 期日 06/11/2042		5,418	5,562
Morgan Stanley Dean Witter Capital Ⅰ Trust			
7.562% 期日 07/15/2033		6,431	6,853
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
0.954% 期日 12/25/2035		27,533	23,504
Morgan Stanley Re-REMIC Trust			
5.794% 期日 08/15/2045		4,519	4,544
Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates			
6.450% 期日 01/22/2026		1,046	1,048
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
1.044% 期日 05/25/2035		7,400	6,100
5.745% 期日 10/25/2036		28,246	14,094
Nomura Resecuritization Trust			
2.880% 期日 11/26/2036		9,970	9,824
NovaStar Mortgage Funding Trust			
0.694% 期日 10/25/2036		8,492	4,708
1.014% 期日 10/25/2035		2,500	2,175
Oncilla Mortgage Funding PLC			
1.780% 期日 12/12/2043	GBP	14,321	17,537
Option One Mortgage Loan Trust			
0.634% 期日 02/25/2037	USD	7,523	4,477
Paragon Mortgages No.13 PLC			
0.641% 期日 01/15/2039	GBP	4,624	5,164
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
0.694% 期日 09/25/2036	USD	30,743	9,897
Quest Trust			
1.484% 期日 03/25/2035		6,060	5,257
RBSCF Trust			
5.509% 期日 04/16/2047		25	25
RBSGC Mortgage Loan Trust			
6.000% 期日 01/25/2037	USD	22	20
RBSSP Resecuritization Trust			
1.022% 期日 04/26/2037		294	277
Renaissance Home Equity Loan Trust			
0.894% 期日 11/25/2034		73	64
1.534% 期日 09/25/2037		81	63
5.612% 期日 04/25/2037		9,461	4,634
5.675% 期日 06/25/2037		3,971	1,925
Residential Accredit Securities Corporation Trust			
0.684% 期日 01/25/2037		3,520	3,301
0.694% 期日 11/25/2036		11,396	10,350
0.825% 期日 01/25/2037		39,641	22,337
1.299% 期日 03/25/2034		4,782	4,523
Residential Asset Mortgage Products Trust			
0.745% 期日 10/25/2034		8,974	8,492
0.974% 期日 10/25/2035		5,000	4,828
0.984% 期日 11/25/2035		13,000	10,382
1.034% 期日 09/25/2035		12,591	9,734
Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC			
0.620% 期日 06/12/2036	GBP	5,859	6,537
Rochester Financing No.2 PLC			
1.679% 期日 06/20/2045		11,153	13,716
Saxon Asset Securities Trust			
1.329% 期日 03/25/2035	USD	1,532	1,416
1.584% 期日 06/25/2033		1,895	1,798
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
0.804% 期日 03/25/2036		12,226	9,963
Sequoia Mortgage Trust			
1.046% 期日 06/20/2034		87	81

	Slate No.1 PLC			
	1.851% 期日 01/24/2051	GBP	7,819	9,407
	2.251% 期日 01/24/2051		2,600	3,075
	Soundview Home Loan Trust			
	0.814% 期日 06/25/2036	USD	5,975	2,568
	0.844% 期日 06/25/2036		47,590	21,728
	1.184% 期日 03/25/2036		8,102	4,814
	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
	1.509% 期日 12/25/2035		4,017	3,653
	SRERS Funding Ltd.			
	0.780% 期日 05/09/2046		4,215	4,199
	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
	0.854% 期日 10/25/2035		14,543	12,196
	1.942% 期日 05/25/2035		183	128
	Structured Asset Investment Loan Trust			
	0.684% 期日 06/25/2036		19,626	17,558
	1.254% 期日 04/25/2035		4,440	3,897
	1.734% 期日 12/25/2034		12,273	11,649
	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
	1.188% 期日 09/19/2032		101	99
	Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			
	0.794% 期日 04/25/2036		1,462	1,431
	1.034% 期日 04/25/2031		8,945	7,793
	Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates			
	5.500% 期日 07/25/2033		28	29
	Taurus CMBS UK Ltd.			
	1.893% 期日 05/01/2022	GBP	1,790	2,194
	Theatre Hospitals No.1 PLC			
	3.401% 期日 10/15/2031		1,519	1,783
	Theatre Hospitals No.2 PLC			
	3.401% 期日 10/15/2031		716	830
	Titan Europe Ltd.			
	0.000% 期日 04/23/2017	EUR	227	241
	Trinity Square PLC			
	1.551% 期日 07/15/2051	GBP	869	1,061
	Ulysses European Loan Conduit No.27 PLC			
	0.561% 期日 07/25/2017		15,550	18,890
	VOLT XXII LLC			
	3.500% 期日 02/25/2055		1,782	1,788
	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust			
	5.500% 期日 04/15/2047		9,750	9,859
	Waldorf Astoria Boca Raton Trust			
	1.885% 期日 06/15/2029		6,100	6,104
	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
	1.254% 期日 01/25/2045		219	200
	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust			
	1.373% 期日 10/25/2046		28,949	17,365
	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
	0.744% 期日 03/25/2037		4,140	3,558
	0.804% 期日 07/25/2036		10,000	9,058
	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
	3.066% 期日 10/25/2036		60	56
	WF-RBS Commercial Mortgage Trust			
	0.430% 期日 03/15/2047		8,800	272
	モーゲージ証券合計			**1,149,171**
	(原価1,159,142米ドル)			
資産担保証券	ACA Euro CLO PLC			
12.9%	0.542% 期日 06/15/2024	EUR	906	994
	Aircraft Certificate Owner Trust			
	7.001% 期日 09/20/2022	USD	1,718	1,823
	Ares European CLO II BV			

2.302% 期日 03/14/2025	EUR	6,000	6,604
Attentus CDO II Ltd.			
1.116% 期日 10/09/2041	USD	1,924	1,790
AVANT Loans Funding Trust			
3.920% 期日 08/15/2019		227	228
Business Loan Express Business Loan Trust			
0.824% 期日 09/25/2038		3,271	2,865
1.084% 期日 09/25/2038		1,586	1,360
1.634% 期日 09/25/2038		115	97
Cadogan Square CLO III BV			
0.360% 期日 01/17/2023	EUR	1,500	1,621
Capitalsource Real Estate Loan Trust			
1.266% 期日 01/20/2037	USD	4,722	4,390
CVP Cascade CLO-1 Ltd.			
2.330% 期日 01/16/2026		12,000	11,952
DT Auto Owner Trust			
1.440% 期日 11/15/2019		1,500	1,500
Eastland CLO Ltd.			
1.087% 期日 05/01/2022		8,000	7,922
Egret Funding CLO I PLC			
0.290% 期日 12/20/2022	EUR	288	316
0.490% 期日 12/20/2022		1,400	1,535
Finn Square CLO Ltd.			
2.052% 期日 12/24/2023	USD	4,500	4,501
Flatiron CLO Ltd.			
2.430% 期日 01/15/2023		4,464	4,472
Gallatin CLO VII Ltd.			
2.150% 期日 07/15/2023		1,809	1,809
Galleria CDO V Ltd.			
1.377% 期日 09/19/2037		3,725	3,561
Gramercy Real Estate CDO Ltd.			
1.332% 期日 07/25/2035		135	135
1.582% 期日 07/25/2035		24,500	24,003
Harbourmaster CLO 7 BV			
0.299% 期日 09/22/2022	EUR	329	361
Harbourmaster CLO 9 BV			
0.127% 期日 05/08/2023		5,000	5,353
Harbourmaster Pro-rata CLO 2 BV			
0.049% 期日 10/15/2022		5,461	5,935
Harvest CLO V PLC			
0.037% 期日 04/05/2024		2,473	2,707
Jubilee CDO V BV			
0.169% 期日 08/21/2021		6,000	6,551
LNR CDO Ltd.			
6.727% 期日 07/24/2037		470	471
Lockwood Grove CLO LTD			
2.330% 期日 04/25/2025		13,025	13,025
Mariner CLO LLC			
2.221% 期日 07/23/2026		4,800	4,805
MKP CBO I Ltd.			
1.788% 期日 05/08/2039		3,323	3,227
MMcapS FundingXVII Ltd.			
1.192% 期日 12/01/2035		2,381	1,928
National CollegiateIII Commutation Trust			
3.705% 期日 03/25/2038		2,909	2,873
National Collegiate Student Loan Trust			
0.664% 期日 06/26/2028		1,494	1,473
Navient Private Education Loan Trust 2016-A			
2.685% 期日 12/15/2045		10,000	10,568
Navient Student Loan Trust			
1.670% 期日 03/25/2066		4,552	4,558
1.775% 期日 06/25/2065		2,857	2,899
Nelnet Student Loan Trust			
1.377% 期日 09/25/2065		8,000	8,007
OCP CLO Ltd.			
2.330% 期日 07/17/2026		5,000	4,997
OHA Credit PartnersVI Ltd.			

	2.038% 期日 05/15/2023		7,505	7,510
	OZLMVI Ltd.			
	2.430% 期日 04/17/2026		17,000	17,002
	Palmer Square CLO Ltd.			
	2.280% 期日 10/17/2025		1,900	1,898
	Pangaea ABS SPV			
	0.000% 期日 12/28/2096	EUR	1,237	1,316
	Panther CDO V BV			
	0.082% 期日 10/15/2084		2,881	3,103
	Progress Residential Trust			
	2.035% 期日 09/17/2033	USD	10,000	10,131
	Putnam Structured Product CDO Ltd.			
	1.209% 期日 01/10/2038		7,318	7,248
	2.030% 期日 01/10/2038		11,236	10,899
	RAIT Preferred FundingII Ltd.			
	0.824% 期日 06/25/2045		818	815
	Santander Drive Auto Receivables Trust			
	1.340% 期日 11/15/2019		8,700	8,704
	ShacklettonII CLO Ltd.			
	2.064% 期日 10/20/2023		4,300	4,300
	Silver Arrow S.A. 7			
	0.000% 期日 07/15/2024	EUR	4,045	4,450
	SLM Private Education Loan Trust			
	1.850% 期日 06/17/2030	USD	9,895	9,887
	SMB Private Education Loan Trust			
	1.235% 期日 02/15/2023		557	558
	1.435% 期日 07/15/2022		1,262	1,265
	Sorin Real Estate CDOIV Ltd.			
	1.043% 期日 10/28/2046		7,770	7,614
	SpringCastle America Funding LLC			
	3.050% 期日 04/25/2029		4,000	4,040
	Telos CLO Ltd.			
	2.530% 期日 04/17/2025		2,909	2,915
	THL Credit Wind River CLO Ltd.			
	2.330% 期日 01/15/2026		10,000	10,017
	TICC CLO LLC			
	2.575% 期日 08/25/2023		9,307	9,332
	Tralee CLO III Ltd.			
	2.231% 期日 07/20/2026		7,000	6,983
	Tropic CDO V Ltd.			
	1.200% 期日 07/15/2036		18,465	13,295
	Utah State Board of Regents			
	1.281% 期日 09/25/2056		1,900	1,886
	VERTICAL BRIDGE CC LLC			
	5.193% 期日 10/15/2046		400	399
	Voya CLO Ltd.			
	2.056% 期日 03/14/2022		6,075	6,082
	WhiteHorse VI Ltd.			
	2.078% 期日 02/03/2025		10,000	9,993
	Wood Street CLO III BV			
	0.208% 期日 08/27/2022	EUR	2,700	2,938
	資産担保証券合計			327,796
	(原価：327,260米ドル)			
ソブリン債	Argentina Government International Bond			
1.8%	3.875% 期日 01/15/2022		3,400	3,671
	5.000% 期日 01/15/2027		3,800	3,963
	6.250% 期日 04/22/2019	USD	500	531
	Autonomous Community of Catalonia			
	4.300% 期日 11/15/2016	EUR	150	164
	4.900% 期日 09/15/2021		1,250	1,467
	Brazil Government International Bond			
	5.625% 期日 02/21/2047	USD	13,200	12,672
	Corp. Andina de Fomento			
	3.950% 期日 10/15/2021	MXN	659	35
	Costa Rica Government International Bond			
	7.000% 期日 04/04/2044	USD	200	208

		Greece Government International Bond			
		3.800% 期日 08/08/2017	JPY	5,000	47
		4.500% 期日 11/08/2016		120,000	1,143
		4.500% 期日 07/03/2017		20,000	186
		Indonesia Government International Bond			
		2.625% 期日 06/14/2023	EUR	3,500	3,994
		3.750% 期日 06/14/2028		1,200	1,414
		KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds			
		0.000% 期日 01/14/2032		2,800	2,744
		Mexico Government International Bond			
		4.000% 期日 03/15/2115		200	199
		Russia Government International Bond			
		5.625% 期日 04/04/2042	USD	2,000	2,213
		Saudi Government International Bond			
		2.375% 期日 10/26/2021		1,000	998
		3.250% 期日 10/26/2026		1,000	987
		4.500% 期日 10/26/2046		6,600	6,499
		South Africa Government International Bond			
		10.500% 期日 12/21/2026	ZAR	43,100	3,544
		ソブリン債合計			46,679
		(原価：46,405米ドル)			
				株式数	
普通株式		Eurobank Ergasias S.A.		10,169,333	5,998
0.2%		National Bank of Greece S.A.		1,025,700	209
		Towergate Finance PLC		296,778	268
		普通株式合計			6,475
		(原価：11,543米ドル)			
優先証券		GMAC Capital Trust I			
0.0%		6.602% 期日 02/15/2040		11,800	301
		Stichting AK Rabobank Certificaten			
		6.500%		4,870	603
		優先証券合計			904
		（原価： 900米ドル）			
短期証券	銀行引受手形	Bank of Montreal		元本金額	
5.5%	1.7%	0.757% 期日 11/07/2016	CAD	12,700	9,475
		0.757% 期日 11/02/2016		22,300	16,638
		Bank of Nova Scotia			
		0.772% 期日 11/03/2016		11,100	8,279
		TD Bank			
		0.777% 期日 11/04/2016		12,700	9,474
					43,866
	定期預金証書	Barclays Bank PLC			
	2.5%	1.641% 期日 09/08/2017	USD	4,000	4,003
		1.745% 期日 11/06/2017		4,440	4,441
		Credit Suisse AG			
		1.645% 期日 09/12/2017		10,800	10,815
		Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.			
		1.577% 期日 09/19/2017		2,500	2,505
		Natixis S.A.			
		1.553% 期日 09/25/2017		7,000	7,022
		Norinchukin Bank			
		1.589% 期日 10/12/2017		27,500	27,529
		Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
		1.550% 期日 09/15/2017		4,300	4,309
		Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
		1.574% 期日 10/06/2017		2,670	2,674
					63,298
	定期性預金	ANZ National Bank			
	1.2%	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	163	200
		0.150% 期日 11/01/2016	USD	6,207	6,207

	Brown Brothers Harriman & Co.			
	(0.568%) 期日 11/01/2016	EUR	1	1
	(0.500%) 期日 11/01/2016	DKK	1	0
	(0.420%) 期日 11/01/2016	JPY	212	2
	0.050% 期日 11/01/2016	CAD	6	4
	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	3	4
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	9	9
	0.728% 期日 11/01/2016	AUD	22	17
	6.550% 期日 11/01/2016	ZAR	8	1
	Citibank N.A.			
	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	1	1
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	4,930	4,930
	DBS Bank Ltd.			
	0.150% 期日 11/01/2016		9,782	9,782
	Deutsche Bank AG			
	(0.568%) 期日 11/01/2016	EUR	415	455
	DnB NORBank ASA			
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	344	344
	0.728% 期日 11/01/2016	AUD	1,640	1,248
	JPMorgan Chase & Co.			
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	15	15
	National Australia Bank Ltd.			
	0.728% 期日 11/01/2016	AUD	284	216
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
	(0.568%) 期日 11/01/2016	EUR	224	246
	(0.420%) 期日 11/01/2016	JPY	47,759	454
	0.050% 期日 11/01/2016	GBP	989	1,207
	0.150% 期日 11/01/2016	USD	5,311	5,311
	Wells Fargo Bank			
	6.550% 期日 11/01/2016	ZAR	504	37
				30,691
米国財務省証券	0.471% 期日 03/09/2017	USD	2,670	2,666
0.1%	短期証券合計			140,521
	(原価：141,046米ドル)			
	投資有価証券合計 112.1%			2,859,830
	(原価：2,888,092米ドル)			
	金融デリバティブ商品 0.4%			9,398
	(原価またはプレミアム(純額)(17,983)米ドル)			
	その他の資産および負債（純額）(12.5%)			(318,425)
	純資産 100.0%			2,550,803

マネー・オープン・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成29年 3月13日現在）	（平成29年 9月12日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	22,434,815	-
コール・ローン	-	20,567,525
特殊債券	52,591,740	54,460,180
未収利息	256,371	269,386
前払費用	66,585	652
流動資産合計	75,349,511	75,297,743
資産合計	75,349,511	75,297,743
負債の部		
流動負債		
未払利息	-	56
その他未払費用	300	135
流動負債合計	300	191

	（平成29年 3月13日現在）	（平成29年 9月12日現在）
負債合計	300	191
純資産の部		
元本等		
元本	75,232,566	75,202,622
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	116,645	94,930
元本等合計	75,349,211	75,297,552
純資産合計	75,349,211	75,297,552
負債純資産合計	75,349,511	75,297,743

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 平成29年 3月14日 至 平成29年 9月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	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。 （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。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（平成29年 3月13日現在）	（平成29年 9月12日現在）
1．当計算期間の末日における受益権の総数	75,232,566口	75,202,622口
2．1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0016円 (10,000口当たりの純資産額 10,016円)	1口当たり純資産額 1.0013円 (10,000口当たりの純資産額 10,013円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 平成29年 3月14日 至 平成29年 9月12日

1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、特殊債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 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 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
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、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（平成29年 9月12日現在）
１.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1) 有価証券（特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 3月14日 至 平成29年 9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成29年 3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	75,212,596円
同期中における追加設定元本額	19,970円
同期中における一部解約元本額	-円
平成29年 3月13日現在における元本の内訳	
アジア・ハイイールド債券ファンド毎月分配型（通貨アクティブヘッジコース）	30,000,000円
メキシコ債券ファンド（毎月分配型）	9,994,004円
メキシコ債券ファンド（資産成長型）	4,997,002円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・ラグジュアリーファンド	29,982,011円
ＳＭＢＣ・日興資産成長ナビゲーション	49,961円
アジア・ハイイールド債券ファンド毎月分配型（ヘッジなしコース）	29,944円
アジア・ハイイールド債券ファンド毎月分配型（通貨プレミアムコース）	29,944円

三井住友・グローバルＣＢ戦略ファンド（為替ヘッジあり）	9,981円
三井住友・グローバルＣＢ戦略ファンド（為替ヘッジなし）	9,981円
三井住友・公益インフラ優先証券ファンド２０１５０８	9,980円
ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド（為替ヘッジなし）	9,980円
ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド（限定為替ヘッジ）	9,980円
あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド２０１６－０２	9,976円
三井住友・公益インフラ優先証券ファンド２０１６０３	9,978円
あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド２０１６－０５	9,978円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０５（為替ヘッジあり）	9,978円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０５（為替ヘッジなし）	9,978円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０９（為替ヘッジあり）	9,980円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０９（為替ヘッジなし）	9,980円
あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド２０１６－０９	9,980円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）	9,985円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）	9,985円
合計	75,232,566円

（平成29年 9月12日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	75,232,566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	29,944円
平成29年 9月12日現在における元本の内訳	
アジア・ハイイールド債券ファンド毎月分配型（通貨アクティブヘッジコース）	30,000,000円
メキシコ債券ファンド（毎月分配型）	9,994,004円
メキシコ債券ファンド（資産成長型）	4,997,002円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・ラグジュアリーファンド	29,982,011円
ＳＭＢＣ・日興資産成長ナビゲーション	49,961円
アジア・ハイイールド債券ファンド毎月分配型（ヘッジなしコース）	29,944円
三井住友・グローバルＣＢ戦略ファンド（為替ヘッジあり）	9,981円
三井住友・グローバルＣＢ戦略ファンド（為替ヘッジなし）	9,981円
三井住友・公益インフラ優先証券ファンド２０１５０８	9,980円
ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド（為替ヘッジなし）	9,980円
ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド（限定為替ヘッジ）	9,980円
あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド２０１６－０２	9,976円
三井住友・公益インフラ優先証券ファンド２０１６０３	9,978円
あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド２０１６－０５	9,978円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０５（為替ヘッジあり）	9,978円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０５（為替ヘッジなし）	9,978円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０９（為替ヘッジあり）	9,980円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－０９（為替ヘッジなし）	9,980円
あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド２０１６－０９	9,980円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）	9,985円
りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）	9,985円
合計	75,202,622円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	第５６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	12,000,000	12,103,320	
	第６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	14,000,000	14,213,220	
	第８８０回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,043,680	
	第８８２回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,099,960	
合計		54,000,000	54,460,180	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）

2017年 9月29日現在

Ⅰ　資産総額	9,589,953,031円
Ⅱ　負債総額	5,958,929円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,583,994,102円
Ⅳ　発行済口数	9,485,177,624口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0104円
（1万口当たり純資産額）	（10,104円）

りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）

2017年 9月29日現在

Ⅰ　資産総額	1,120,871,216円
Ⅱ　負債総額	15,983,533円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,104,887,683円
Ⅳ　発行済口数	1,085,822,475口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0176円
（1万口当たり純資産額）	（10,176円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ　名義書換
該当事項はありません。
ロ　受益者名簿
作成しません。
ハ　受益者に対する特典
ありません。
ニ　受益権の譲渡および譲渡制限等
（イ）受益権の譲渡
ａ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
ｂ．上記ａの申請のある場合には、上記ａの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受

益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記ａの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

ｃ．上記ａの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ　償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ヘ　質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

イ　資本金の額および株式数

	2017年 9月29日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ　最近５年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ　会社の機構

委託会社の取締役は７名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

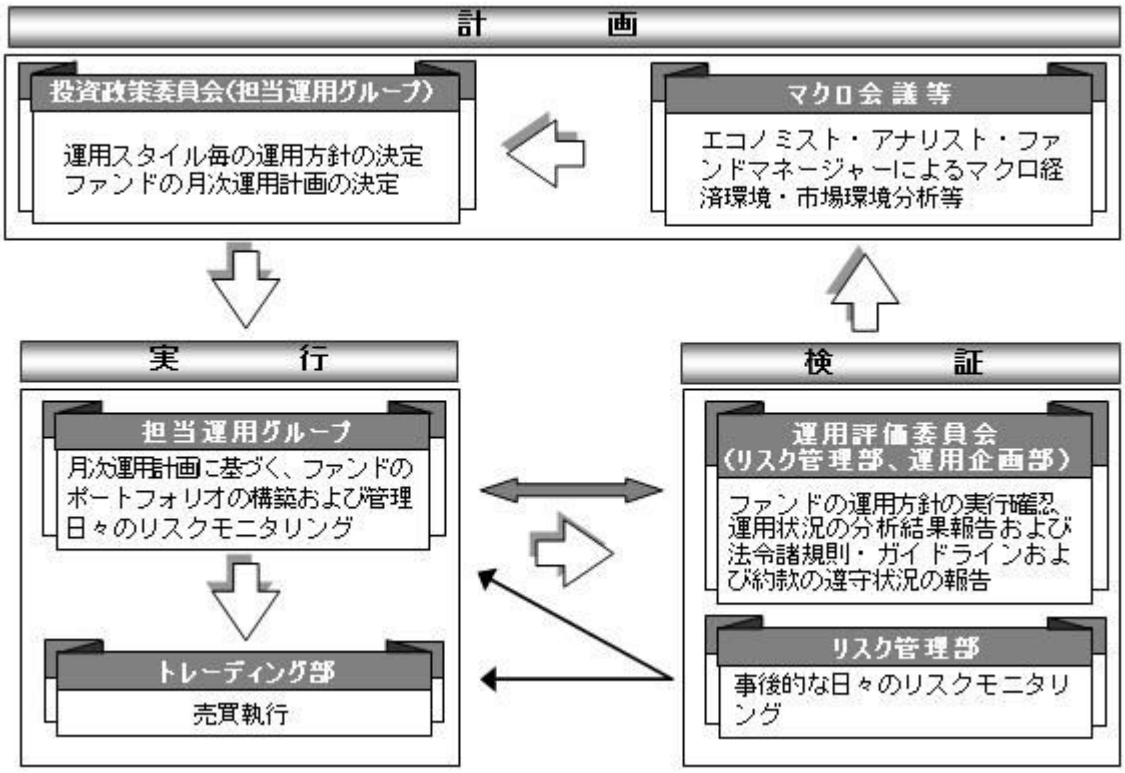
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を１名選定します。

ニ　投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。
2017年9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。

（2017年9月29日現在）

		本　数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	75 (　27)	204,777 (　107,082)
	追加型	449 (　190)	5,365,442 (　2,790,734)
	計	524 (　217)	5,570,219 (　2,897,816)
公社債投資信託	単位型	104 (　104)	410,244 (　410,244)
	追加型	1 (　0)	29,799 (　0)
	計	105 (　104)	440,043 (　410,244)
合　計		629 (　321)	6,010,263 (　3,308,061)

※（　）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

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。

2　当社は、当事業年度（平成28年４月１日から平成29年３月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 （平成28年３月31日）	当事業年度 （平成29年３月31日）
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	※２	10,857,507	13,279,384
顧客分別金信託		20,006	20,008
前払費用		324,934	351,526
未収入金		81,347	40,544
未収委託者報酬		5,418,116	5,511,715
未収運用受託報酬		1,635,461	1,297,104
未収投資助言報酬		382,911	343,523
未収収益		28,813	20,789

繰延税金資産		494,032	482,535
その他の流動資産		6,226	5,560
流動資産合計		19,249,357	21,352,691
固定資産			
有形固定資産	※1		
建物		154,246	198,767
器具備品		240,748	261,096
有形固定資産合計		394,995	459,864
無形固定資産			
ソフトウェア		449,034	493,806
ソフトウェア仮勘定		146,452	141,025
電話加入権		79	68
商標権		60	3
無形固定資産合計		595,627	634,903
投資その他の資産			
投資有価証券		13,115,106	12,098,372
関係会社株式		10,412,523	10,412,523
長期差入保証金		603,625	677,681
長期前払費用		32,533	61,282
会員権		17,299	7,819
繰延税金資産		750,481	871,577
投資その他の資産合計		24,931,569	24,129,257
固定資産合計		25,922,192	25,224,025
資産合計		45,171,549	46,576,717

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年３月31日）	当事業年度 （平成29年３月31日）
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	0	304
その他の預り金	73,103	80,380
未払金		
未払収益分配金	154	655
未払償還金	141,808	140,124
未払手数料	2,479,778	2,424,318
その他未払金	58,453	52,903
未払費用	2,092,669	2,564,625
未払消費税等	317,444	160,571
未払法人税等	992,491	661,467
賞与引当金	982,654	1,001,068
その他の流動負債	-	445
流動負債合計	7,138,557	7,086,864
固定負債		
退職給付引当金	3,028,212	3,177,131
賞与引当金	51,310	40,167
その他の固定負債	693	2,174
固定負債合計	3,080,216	3,219,473
負債合計	10,218,774	10,306,337
純資産の部		
株主資本		

資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,984,811	23,493,074
利益剰余金合計	23,806,015	25,314,279
株主資本計	34,434,999	35,943,263
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,775	327,116
評価・換算差額等合計	517,775	327,116
純資産合計	34,952,774	36,270,379
負債・純資産合計	45,171,549	46,576,717

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成27年４月 1日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月 1日 至　平成29年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	32,339,255	31,628,014
運用受託報酬	7,401,835	5,649,190
投資助言報酬	1,909,892	1,726,511
その他営業収益		
情報提供コンサルタント		
業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	8,546	-
サービス支援手数料	74,038	61,268
その他	55,319	54,261
営業収益計	41,793,887	39,124,246
営業費用		
支払手数料	16,006,652	14,908,517
広告宣伝費	615,596	366,227
公告費	4,507	1,140
調査費		
調査費	1,624,477	1,325,978
委託調査費	4,106,366	4,343,104
営業雑経費		
通信費	43,662	46,030
印刷費	399,236	338,254
協会費	23,328	21,669
諸会費	22,650	20,054
情報機器関連費	2,557,200	2,516,497
販売促進費	31,271	24,896
その他	161,974	149,177
営業費用合計	25,596,925	24,061,549

一般管理費			
給料			
役員報酬		181,739	225,885
給料・手当		5,824,767	6,121,741
賞与		609,597	610,533
賞与引当金繰入額		1,033,964	989,925
交際費		26,912	23,136
寄付金		23	-
事務委託費		540,251	317,928
旅費交通費		277,212	229,248
租税公課		161,628	268,527
不動産賃借料		595,051	622,662
退職給付費用		701,070	423,954
固定資産減価償却費		334,024	384,068
諸経費		354,884	335,840
一般管理費合計		10,641,129	10,553,451
営業利益		5,555,832	4,509,246
営業外収益			
受取配当金	※１	36,102	106,651
受取利息	※１	3,728	745
時効成立分配金・償還金		1,394	1,721
原稿・講演料		1,766	1,474
雑収入		19,472	12,592
営業外収益合計		62,465	123,184
営業外費用			
為替差損		51,385	9,737
雑損失		-	1,084
営業外費用合計		51,385	10,821
経常利益		5,566,912	4,621,608
特別利益			
投資有価証券償還益		13,036	353,462
投資有価証券売却益		38,823	2,579
投資有価証券清算益		29,214	-
特別利益合計		81,075	356,041
特別損失			
固定資産除却損	※２	5,300	8,157
投資有価証券償還損		2,313	43,644
投資有価証券売却損		8,184	15,012
ゴルフ会員権売却損		-	3,894
事務所移転費用		-	21,175
特別損失合計		15,798	91,884
税引前当期純利益		5,632,188	4,885,765
法人税、住民税及び事業税		1,598,176	1,391,996
法人税等調整額		△41,999	△25,454
法人税等合計		1,556,177	1,366,541
当期純利益		4,076,011	3,519,223

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金合計	
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当期変動額									
剰余金の配当			－				△952,560	△952,560	△952,560
当期純利益			－				4,076,011	4,076,011	4,076,011
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			－					－	－
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	3,123,451	3,123,451	3,123,451
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	634,478	634,478	31,946,027
当期変動額			
剰余金の配当		－	△ 952,560
当期純利益		－	4,076,011
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 116,703	△ 116,703	△ 116,703
当期変動額合計	△ 116,703	△ 116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

当事業年度（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	

当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当		－	△ 2,010,960
当期純利益		－	3,519,223
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 190,658	△ 190,658	△ 190,658
当期変動額合計	△ 190,658	△ 190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

[注記事項]

(重要な会計方針)

１.有価証券の評価基準及び評価方法

(1)満期保有目的の債券

償却原価法

(2)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3)その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

２.固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　３～50年

器具備品　　３～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

３.引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)退職給付引当金

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

①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。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。
数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

４.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
消費税等の会計処理
消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)
法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号　平成28年６月17日）を当事業年度に適用し、平成28年４月１日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。
この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ2,218千円増加しております。

(追加情報)
「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号　平成28年３月28日)を当事業年度から適用しております。

(貸借対照表関係)
※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

※２　関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成28年３月31日)	当事業年度 (平成29年３月31日)
現金及び預金	4,716,352千円	－千円

３　当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行１行と当座借越契約を締結しております。当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年３月31日)	当事業年度 (平成29年３月31日)
当座借越極度額の総額 借入実行残高 差引額	10,000,000千円 －　　千円 10,000,000千円	10,000,000千円 －　　千円 10,000,000千円

４　保証債務
当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年６月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成28年３月31日)	当事業年度 (平成29年３月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	296,815千円	256,031千円

(損益計算書関係)

※１ 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

※２ 固定資産除却損

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成27年４月１日 至 平成28年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

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

２.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年６月30日 定時株主総会	普通株式	952,560	54,000	平成27年 ３月31日	平成27年 ７月１日

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

平成28年６月27日開催の第31回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

当事業年度(自 平成28年４月１日 至 平成29年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

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

２.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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

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

平成29年６月27日開催の第32回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

（借主側）

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

１.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて１年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスクの管理

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

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

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

②市場リスクの管理

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

報告しています。

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

２.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成28年３月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	10,857,507	10,857,507	―
(2)顧客分別金信託	20,006	20,006	―
(3)未収委託者報酬	5,418,116	5,418,116	―
(4)未収運用受託報酬	1,635,461	1,635,461	―
(5)未収投資助言報酬	382,911	382,911	―
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	13,114,808	13,114,808	―
(7)長期差入保証金	603,625	603,625	―
資産計	32,032,437	32,032,437	―
(1)顧客からの預り金	0	0	―
(2)未払手数料	2,479,778	2,479,778	―
負債計	2,479,778	2,479,778	―

当事業年度（平成29年３月31日）

(単位：千円)

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

(注１)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資　産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負　債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

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

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)①その他有価証券」には含めておりません。

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

(注３)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年３月31日）

(単位：千円)

区分	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超
現金及び預金	10,857,507	―	―	―
顧客分別金信託	20,006	―	―	―
未収委託者報酬	5,418,116	―	―	―
未収運用受託報酬	1,635,461	―	―	―
未収投資助言報酬	382,911	―	―	―
長期差入保証金	537,057	66,567	―	―
合計	18,851,060	66,567	―	―

当事業年度（平成29年３月31日）

(単位：千円)

区分	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超

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

(有価証券関係)

１.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成28年３月31日）

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

当事業年度（平成29年３月31日）

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

２.その他有価証券

前事業年度（平成28年３月31日）

(単位：千円)

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

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

当事業年度（平成29年３月31日）

(単位：千円)

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

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

３.当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成27年４月１日　至 平成28年３月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
327,278	38,823	8,184

当事業年度(自 平成28年４月１日　至 平成29年３月31日)

(単位：千円)

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

(退職給付関係)

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

（注）その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額になります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度125,210千円、当事業年度137,310千円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 （平成28年３月31日）	当事業年度 （平成29年３月31日）
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	303,247	308,929
調査費	74,734	79,381
未払金	44,028	45,745
未払事業税	67,598	46,406
その他	7,369	2,071
繰延税金資産小計	496,977	482,535
評価性引当額	△2,945	-
繰延税金資産合計	494,032	482,535
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	927,238	972,837
特定外国子会社留保金額	205,413	-
ソフトウェア償却	35,707	18,718
賞与引当金	15,834	12,299
投資有価証券評価損	95	95
その他	5,971	14,592
繰延税金資産小計	1,190,261	1,018,544
評価性引当額	△211,267	△2,597
繰延税金資産合計	978,994	1,015,946
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	228,513	144,368
繰延税金負債合計	228,513	144,368
繰延税金資産の純額	1,244,513	1,354,113

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成27年４月１日 至 平成28年３月31日)

１.セグメント情報

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

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

２.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	32,339,255	7,401,835	1,909,892	142,903	41,793,887

(2)地域ごとの情報

①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。

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金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

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

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年４月１日 至 平成29年３月31日)
１.セグメント情報
当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。
従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

２.関連情報
(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報
①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。

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金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。
(3)主要な顧客ごとの情報
外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

(関連当事者情報)
前事業年度(自 平成27年４月１日 至 平成28年３月31日)
１．関連当事者との取引
(1)親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% (被所有) 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(2)兄弟会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% —	投信の販売委託 役員の兼任	子会社株式の取得	9,877,717	—	—
							委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年４月１日 至 平成29年３月31日)

１．関連当事者との取引

(1)子会社及び関連会社等

（単位：千円）

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

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2)兄弟会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% ―	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,737,677	未払手数料	489,567
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% ―	投信の販売委託	委託販売手数料	5,485,934	未払手数料	862,697

（注） 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。
3. (株)三井住友銀行の属性が、平成28年７月29日付けで、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月１日付けで「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。
4. SMBC日興証券(株)の属性が、平成28年10月１日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。
なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

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

(１株当たり情報)

	前事業年度 （自 平成27年４月 １日 至 平成28年３月31日）	当事業年度 （自 平成28年４月 １日 至 平成29年３月31日）
１株当たり純資産額	1,981,449.82円	2,056,143.98円
１株当たり当期純利益金額	231,066.40円	199,502.47円

（注）１．潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成27年４月 １日 至 平成28年３月31日）	当事業年度 （自 平成28年４月 １日 至 平成29年３月31日）
１株当たり当期純利益金額		
当期純利益（千円）	4,076,011	3,519,223
普通株主に帰属しない金額（千円）	―	―
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	4,076,011	3,519,223
期中平均株式数（株）	17,640	17,640

(重要な後発事象)
該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

イ　自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ロ　運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ハ　通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ　委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

ホ　上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ　定款の変更、その他の重要事項

2017年6月27日付で、定款について以下の変更を行いました。

（イ）監査体制の見直しにより監査役の員数を１名減員し５名以内とする定款の変更

（ロ）公告の方法を日本経済新聞に掲載する方法から、電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由が生じた場合は、日本経済新聞に掲載）とする2018年2月1日付効力発生の定款の変更

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ　受託会社

（イ）名称　　株式会社りそな銀行

（ロ）資本金の額　　279,928百万円（2017年3月末現在）

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

・　名称　　日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・　資本金の額　　51,000百万円（2017年3月末現在）

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

ロ　販売会社

（イ）名称	（ロ）資本金の額※	（ハ）事業の内容
株式会社近畿大阪銀行	38,971百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	

※資本金の額は、2017年3月末現在。

ハ　投資顧問会社（運用の委託先）
（イ）名称　　ピムコジャパンリミテッド
（ロ）資本金の額　　13,411千米ドル（2017年３月末現在）
（ハ）事業の内容　　金融商品取引法に基づき投資運用業等を営んでいます。

２【関係業務の概要】

イ　受託会社
信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ　販売会社
委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

３【資本関係】

該当ありません。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2017年 3月23日	臨時報告書
2017年 6月12日	有価証券報告書
2017年 6月21日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成29年６月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年４月１日から平成29年３月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任
　経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
　当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
　監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
　当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成29年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年10月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小 澤　陽 一　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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」に掲げられているりそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）の平成29年3月14日から平成29年9月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジあり）の平成29年9月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係
三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年10月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小 澤　陽 一　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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」に掲げられているりそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）の平成29年3月14日から平成29年9月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・ストラテジック・インカムファンド２０１６－１２（為替ヘッジなし）の平成29年9月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

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