

運用報告書（全体版）

第1作成期

第1期（決算日：2017年2月17日）第2期（決算日：2017年3月17日）
第3期（決算日：2017年4月17日）第4期（決算日：2017年5月17日）
第5期（決算日：2017年6月19日）

当ファンドの仕組みは、次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／債券 |
| 信託期間 | 無期限（設定日：平成28年12月29日） |
| 運用方針 | この投資信託は、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。 |
| 主要運用対象 | 主として「SBI Bond スリランカ短期国債ファンド（適格機関投資家専用）」及び「FOFs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）」を主要投資対象とします。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。 |
| 組入制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブの直接利用は行いません。 |
| 分配方針 | 毎月17日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。分配対象額の範囲は経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配対象額については委託者が基準価額水準、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は、分配を行わないことがあります。なお、収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |

SBIスリランカ短期国債ファンド （毎月決算型）

追加型投信／海外／債券

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「SBIスリランカ短期国債ファンド（毎月決算型）」は、2017年6月19日に第5期決算を行いました。

ここに第1期～第5期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

 **SBI Asset Management**

SBIアセットマネジメント株式会社

〒106-6017 東京都港区六本木1-6-1

お問い合わせ先

電話番号 03-6229-0097

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページから、ファンドの商品概要、レポート等をご覧いただけます。
<http://www.sbiasset.com.jp/>

○設定以来の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | | 投資信託 組入比率 | 純資産額 |
|-----------|----------------------|---------------|------|----------|------------|--------------|------------|
| | | | 税分 | 込配 み金 | 期中騰落 中率 | | |
| 第1 作成期 | (設定日) 2016年12月29日 | 円 10,000 | | 円 — | % — | % — | 百万円 340 |
| | 1期(2017年2月17日) | 9,765 | | 0 | △2.4 | 97.6 | 828 |
| | 2期(2017年3月17日) | 9,576 | | 0 | △1.9 | 99.0 | 823 |
| | 3期(2017年4月17日) | 9,355 | | 45 | △1.8 | 99.5 | 794 |
| | 4期(2017年5月17日) | 9,785 | | 45 | 5.1 | 99.1 | 775 |
| | 5期(2017年6月19日) | 9,582 | | 45 | △1.6 | 99.8 | 705 |

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。また、期中騰落率は、各期末の基準価額(税込み分配金含む)を前期末基準価額(分配落)で除して算出したものです。

(注2) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注3) 当ファンドは主として「SBIボンド スリランカ短期国債ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、実質的にスリランカの短期国債等に投資し残存期間の短い債券を中心にポートフォリオを構築することで金利変動に伴う価格変動リスクの低減をはかり、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長をめざして運用を行うため、ベンチマークはありません。また適当な参考指数もないことから、参考指数等も記載しておりません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

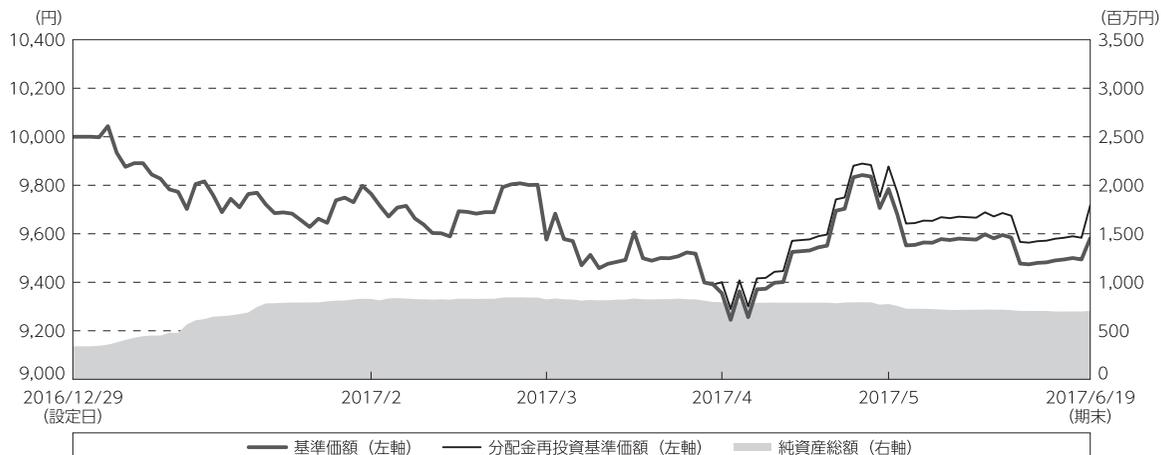
| 決 算 期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 投 資 信 託 証 組 入 比 率 |
|-------|-------------|---------|-------|------|-------------------|
| | | | 騰 落 | 率 | |
| 第 1 期 | (設定日) | 円 | | % | % |
| | 2016年12月29日 | 10,000 | | — | — |
| | 12月末 | 10,000 | | 0.0 | 100.0 |
| | 2017年1月1月末 | 9,769 | | △2.3 | 90.5 |
| 第 2 期 | (期 末) | | | | |
| | 2017年2月17日 | 9,765 | | △2.4 | 97.6 |
| | (期 首) | | | | |
| 第 2 期 | 2017年2月17日 | 9,765 | | — | 97.6 |
| | 2月末 | 9,603 | | △1.7 | 99.2 |
| | (期 末) | | | | |
| 第 3 期 | 2017年3月17日 | 9,576 | | △1.9 | 99.0 |
| | (期 首) | | | | |
| | 2017年3月17日 | 9,576 | | — | 99.0 |
| 第 3 期 | 3月末 | 9,492 | | △0.9 | 99.0 |
| | (期 末) | | | | |
| | 2017年4月17日 | 9,400 | | △1.8 | 99.5 |
| 第 4 期 | (期 首) | | | | |
| | 2017年4月17日 | 9,355 | | — | 99.5 |
| | 4月末 | 9,528 | | 1.8 | 99.3 |
| 第 4 期 | (期 末) | | | | |
| | 2017年5月17日 | 9,830 | | 5.1 | 99.1 |
| | (期 首) | | | | |
| 第 5 期 | 2017年5月17日 | 9,785 | | — | 99.1 |
| | 5月末 | 9,576 | | △2.1 | 99.8 |
| | (期 末) | | | | |
| 第 5 期 | 2017年6月19日 | 9,627 | | △1.6 | 99.8 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(注2) 当ファンドは主として「SBIボンド スリランカ短期国債ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、実質的にスリランカの短期国債等に投資し残存期間の短い債券を中心にポートフォリオを構築することで金利変動に伴う価格変動リスクの低減をはかり、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長をめざして運用を行うため、ベンチマークはありません。また適当な参考指数もないことから、参考指数等も記載しておりません。

■ 当作成期の運用状況と今後の運用方針 (2016年12月29日から2017年6月19日まで)

○ 基準価額等の推移



設定日：10,000円

第5期末：9,582円 (既払分配金(税込み)：135円)

騰落率：△ 2.8% (分配金再投資ベース)

- (注1) 当ファンドは主として「SBI債券 スリランカ短期国債ファンド (適格機関投資家専用)」への投資を通じて、実質的にスリランカの短期国債等に投資し残存期間の短い債券を中心にポートフォリオを構築することで金利変動に伴う価格変動リスクの低減をはかり、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長をめざして運用を行うため、ベンチマークはありません。また適当な参考指数もないことから、参考指数等も記載していません。
- (注2) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したとみなして計算したファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注3) 分配金の再投資についてはお客様がご利用のコース等により異なります。また、ファンドの運用経過については、当ファンドのパフォーマンスを示したものであり、ファンドの購入価額により課税条件等が異なるため、お客様の損益の状況を示すものではありません。

○ 基準価額の主な変動要因

当ファンドの分配金再投資基準価額は、2017年1月5日に当期の最高値となる10,044円を付けた後、スリランカ中央銀行(CBSL)による利上げ期待から、スリランカ国債利回りが上昇(債券価格は下落)したことから、外国為替市場で円高が進行したことから、下落基調となりました。

3月に実施されたCBSLによる利上げが好感され、海外からの資金流入によりスリランカ国債利回りが低下(債券価格は上昇)したものの、4月以降は北朝鮮情勢などを巡る地政学リスクの高まりから、通貨スリランカ・ルピーが対円で下落基調を強め、4月18日に当期の最安値となる9,289円を付けました。

その後は、投資家のリスク回避姿勢の後退などから円高が一服し、当ファンドの分配金再投資基準価額は緩やかに上昇しました。当ファンドの分配金再投資基準価額は、期を通じて△2.8%下落の9,718円となりました。

○投資環境

※以下のコメントの内容は、SBI bonds・インベストメント・マネジメント株式会社からのコメントを基にSBIアセットマネジメントが編集したものです。

【スリランカ国債市況】

期の前半は、国内経済の過熱を防ぐため、スリランカ中央銀行（CBSL）による金融引き締めの政策が行われるとの見方から、スリランカ国債市場では利回りが緩やかに上昇しました。

期の後半は、スリランカ国債利回りは低下基調となりました。3月に実施されたCBSLによる予防的な利上げが好感され、海外からの資金流入が利回り低下（債券価格は上昇）に寄与しました。

【スリランカ国債市況推移】



出所：Bloombergのデータを基にSBIアセットマネジメントが作成

【為替市況】

期の前半は、為替市場では円高基調となりました。米国新政権が掲げる政策への期待感の剥落から米ドルが円に対して下落し、米ドルと概ね連動するスリランカ・ルピーも円に対して下落しました。

期の後半は、為替市場ではスリランカ・ルピーが対円で概ね横ばいで推移しました。米ドル円が110円前半で推移したことや、CBSLによる予防的な利上げを好んだ海外からの資金流入が、スリランカ・ルピーを下支えしました。

期を通じてみると、スリランカ・ルピーに対する円の上昇幅が大きく、円高スリランカ・ルピー安となりました。

【為替市況推移】



出所：Bloombergのデータを基にSBIアセットマネジメントが作成

○当ファンドのポートフォリオ

<当ファンド>

主として「SBI債券 スリランカ短期国債ファンド（適格機関投資家専用）」への投資を通じて、実質的にスリランカの短期国債等に投資し、残存期間の短い債券を中心にポートフォリオを構築することで金利変動に伴う価格変動リスクの低減をはかり、安定したインカムゲインの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行いました。

<SBI債券 スリランカ短期国債ファンド（適格機関投資家専用）>

スリランカの短期国債等（国債、政府保証債、政府機関債）及び国際機関債を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

なお、直近5月末時点のポートフォリオについては以下の通りとなっております。

ポートフォリオ構成

| | |
|----------------|------|
| 平均残存期間（年） | 1.4 |
| 平均修正デュレーション（年） | 1.2 |
| 平均クーポン（%） | 8.35 |
| 平均直接利回り（%） | 8.44 |
| 平均最終利回り（%） | 9.59 |
| 平均格付け | B+ |

資産別構成

| | |
|--------|-------|
| 債券（%） | 98.1% |
| 現金等（%） | 1.9% |

（注1）平均格付とは、基準日時点での本ファンドの組入投資信託証券にかかる信用格付を加重平均したものです。そのため、本ファンドにかかる格付ではありません。

格付はS&P、ムーディーズ、フィッチの高いものを使用しています。

（注2）デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す指標です。金利変動に対する債券価格の反応度（リスクの大きさ）を表しています。なお、デュレーションが長いほど債券価格の反応は大きくなります。

（注3）最終利回りは、債券購入日から償還日までに得る受取利息や償還差損益（額面と購入価額の差）等、合計額が投資元本に対して1年あたりどの程度となるかを示すものです。

（注4）クーポンは額面金額に対する単年での利息の割合を表します。

（注5）平均直接利回りは平均時価単価に対する平均クーポンの割合です。

（注1）現金等には信託報酬および為替ヘッジに伴う含み損益等も含まれます。

※上表については、SBI債券・インベストメント・マネジメント株式会社の資料を基に、SBIアセットマネジメントが作成しています。

<FOFs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）>

主要投資対象である「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れ、これを維持しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは主としてSBI bonds・インベストメント・マネジメント株式会社が実質的な運用を行う「SBI bonds スリランカ短期国債ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、実質的にスリランカの短期国債等に投資し、残存期間の短い債券を中心にポートフォリオを構築することで金利変動に伴う価格変動リスクの低減をはかり、安定したインカムゲインの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行うため、ベンチマークはありません。また、適当な参考指数もないことから、参考指数等も記載しておりません。

○分配金

当作成期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案し、下表の通りといたしました。
なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり、税込み)

| 項 目 | 第1期 | 第2期 | 第3期 | 第4期 | 第5期 |
|-----------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2016年12月29日～ 2017年2月17日 | 2017年2月18日～ 2017年3月17日 | 2017年3月18日～ 2017年4月17日 | 2017年4月18日～ 2017年5月17日 | 2017年5月18日～ 2017年6月19日 |
| 当期分配金 | — | — | 45 | 45 | 45 |
| (対基準価額比率) | —% | —% | 0.479% | 0.458% | 0.467% |
| 当期の収益 | — | — | 45 | 45 | 45 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | — | — | 3 | 13 | 18 |

(注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の見通しと運用方針

<当ファンド>

引き続き、「SBI債券 スリランカ短期国債ファンド（適格機関投資家専用）」への投資を通じて、実質的にスリランカの短期国債等に投資し、残存期間の短い債券を中心にポートフォリオを構築することで金利変動に伴う価格変動リスクの低減をはかり、安定したインカムゲインの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。

<SBI債券 スリランカ短期国債ファンド（適格機関投資家専用）>

当該投資信託を運用している、SBI債券・インベストメント・マネジメント株式会社は、以下のようにコメントをしています。

スリランカ中央銀行（CBSL）は、2017年3月にインフレ圧力を抑制するため政策金利を7.00%から7.25%へ引き上げました。市場では、CBSLによるやや金融引き締めのスタンス及び政府による構造的な財政赤字削減に向けての取り組みなどが評価されており、スリランカ国債市場は利上げ後においても安定的に推移しています。

今後は海外投資家による継続的な資金流入が期待できること、天候不順による食料品価格の上昇で一時的に高まった消費者物価も沈静化の兆しを見せていることなどから、政策金利は現状の水準で推移する公算が高く、スリランカ国債利回りも安定的に推移する見通しです。

また、為替市場については、米ドル/円に概ね連動するスリランカ・ルピー/円は、米国の金融政策の影響を受けつつも、レンジ内で推移するものと見ています。

こうした環境下においては、短期的には主に為替市場の影響を受けて変動する局面も想定されるものの、長期的にはスリランカ国債の相対的に高いインカム収益を中心にファンドの収益が積み上がっていくことを想定しています。

今後の運用においては、スリランカ現地通貨建て短期国債の比率を引き上げることにより、ポートフォリオの平均利回りを徐々に引き上げていく方針です。

<FOFs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）>

主として、短期金融資産 マザーファンドの受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等（短期公社債および短期金融商品を含みます。）を中心に投資を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月29日～2017年6月19日)

| 項 目 | 第1期～第5期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|---------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 27 | % 0.279 | (a) 信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (5) | (0.051) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (21) | (0.215) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (1) | (0.013) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 13 | 0.131 | (b) その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (3) | (0.030) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ 印 刷 ） | (10) | (0.100) | 開示資料等の作成・印刷費用等 |
| 合 計 | 40 | 0.410 | |
| 作成期中の平均基準価額は、9,661円です。 | | | |

(注1) 作成期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○ 売買及び取引の状況

(2016年12月29日～2017年6月19日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 第1期～第5期 | | | |
|-----|---------------------------------|-------------|---------|-------------|---------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | SBI債券 スリランカ短期国債ファンド (適格機関投資家専用) | 866,000,000 | 852,779 | 131,000,000 | 124,294 |
| | FOFs用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用) | 1,004,319 | 1,000 | — | — |
| | 合 計 | 867,004,319 | 853,779 | 131,000,000 | 124,294 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月29日～2017年6月19日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 第1期～第5期 | | | | | |
|--------|------------|--------------------|---------------|------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 853 | 百万円 852 | % 99.9 | 百万円 124 | 百万円 124 | % 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社SBI証券です。

○組入資産の明細

(2017年6月19日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘 | 柄 | 第1作成期末 | | |
|--------|---------------------------|------------------|---------------|-----------|
| | | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| SBIボンド | スリランカ短期国債ファンド (適格機関投資家専用) | 口 735,000,000 | 千円 702,586 | % 99.6 |
| FOFs | 用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用) | 1,004,319 | 998 | 0.1 |
| 合 | 計 | 736,004,319 | 703,585 | 99.8 |

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2017年6月19日現在)

| 項 目 | 第1作成期末 | |
|--------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 703,585 | % 98.0 |
| コール・ローン等、その他 | 14,398 | 2.0 |
| 投資信託財産総額 | 717,983 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○特定資産の価格等の調査

該当事項はありません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第1期末 | 第2期末 | 第3期末 | 第4期末 | 第5期末 |
|-----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 2017年2月17日現在 | 2017年3月17日現在 | 2017年4月17日現在 | 2017年5月17日現在 | 2017年6月19日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 830,405,230 | 826,790,204 | 825,280,107 | 811,364,474 | 717,983,682 |
| コール・ローン等 | 21,545,031 | 11,278,606 | 15,846,110 | 27,736,978 | 8,756,386 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 808,860,199 | 815,511,598 | 789,891,397 | 769,032,496 | 703,585,496 |
| 未収入金 | — | — | 19,542,600 | 14,595,000 | 5,641,800 |
| (B) 負債 | 2,070,474 | 3,249,591 | 31,200,343 | 35,541,602 | 12,738,871 |
| 未払収益分配金 | — | — | 3,819,605 | 3,567,972 | 3,311,921 |
| 未払解約金 | 1,370,740 | 2,492,061 | 26,413,856 | 30,865,080 | 8,119,066 |
| 未払信託報酬 | 475,831 | 375,456 | 409,645 | 381,781 | 380,951 |
| 未払利息 | 59 | 30 | 43 | 75 | 23 |
| その他未払費用 | 223,844 | 382,044 | 557,194 | 726,694 | 926,910 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 828,334,756 | 823,540,613 | 794,079,764 | 775,822,872 | 705,244,811 |
| 元本 | 848,305,339 | 860,008,970 | 848,801,199 | 792,882,736 | 735,982,584 |
| 次期繰越損益金 | △ 19,970,583 | △ 36,468,357 | △ 54,721,435 | △ 17,059,864 | △ 30,737,773 |
| (D) 受益権総口数 | 848,305,339口 | 860,008,970口 | 848,801,199口 | 792,882,736口 | 735,982,584口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,765円 | 9,576円 | 9,355円 | 9,785円 | 9,582円 |

<注記事項(運用報告書作成時には監査未了)>

(貸借対照表関係)

| | |
|---------------|--------------|
| 作成期首元本額 | 340,136,359円 |
| 第1～5期中追加設定元本額 | 629,778,064円 |
| 第1～5期中一部解約元本額 | 233,931,839円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第1期 | 第2期 | 第3期 | 第4期 | 第5期 |
|------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2016年12月29日～ 2017年2月17日 | 2017年2月18日～ 2017年3月17日 | 2017年3月18日～ 2017年4月17日 | 2017年4月18日～ 2017年5月17日 | 2017年5月18日～ 2017年6月19日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 3,861 | △ 1,392 | 4,668,703 | 4,376,987 | 4,078,439 |
| 受取配当金 | - | - | 4,669,728 | 4,378,088 | 4,079,236 |
| 支払利息 | △ 3,861 | △ 1,392 | △ 1,025 | △ 1,101 | △ 797 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 8,988,156 | △15,426,858 | △18,817,886 | 33,123,851 | △15,025,389 |
| 売買益 | 327,573 | 137,919 | 491,734 | 34,687,176 | 1,053,357 |
| 売買損 | △ 9,315,729 | △15,564,777 | △19,309,620 | △ 1,563,325 | △16,078,746 |
| (C) 信託報酬等 | △ 699,675 | △ 533,656 | △ 584,795 | △ 551,281 | △ 581,167 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 9,691,692 | △15,961,906 | △14,733,978 | 36,949,557 | △11,528,117 |
| (E) 前期繰越損益金 | - | △ 9,359,180 | △24,264,040 | △38,704,717 | △ 4,723,660 |
| (F) 追加信託差損益金 | △10,278,891 | △11,147,271 | △11,903,812 | △11,736,732 | △11,174,075 |
| (配当等相当額) | (△ 1,547) | (△ 1,594) | (7,545) | (99,227) | (116,082) |
| (売買損益相当額) | (△10,277,344) | (△11,145,677) | (△11,911,357) | (△11,835,959) | (△11,290,157) |
| (G) 計(D+E+F) | △19,970,583 | △36,468,357 | △50,901,830 | △13,491,892 | △27,425,852 |
| (H) 収益分配金 | 0 | 0 | △ 3,819,605 | △ 3,567,972 | △ 3,311,921 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △19,970,583 | △36,468,357 | △54,721,435 | △17,059,864 | △30,737,773 |
| 追加信託差損益金 | △10,278,891 | △11,147,271 | △11,903,812 | △11,736,732 | △11,174,075 |
| (配当等相当額) | (△ 1,547) | (△ 1,594) | (7,545) | (99,227) | (116,082) |
| (売買損益相当額) | (△10,277,344) | (△11,145,677) | (△11,911,357) | (△11,835,959) | (△11,290,157) |
| 分配準備積立金 | - | - | 264,303 | 1,009,346 | 1,253,764 |
| 繰越損益金 | △ 9,691,692 | △25,321,086 | △43,081,926 | △ 6,332,478 | △20,817,462 |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 第1期計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)より分配対象収益は0円(10,000口当たり0円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注5) 第2期計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)より分配対象収益は0円(10,000口当たり0円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注6) 第3期計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,083,908円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、および信託約款に規定する収益調整金(7,545円)より分配対象収益は4,091,453円(10,000口当たり48円)であり、うち3,819,605円(10,000口当たり45円)を分配金額としております。

(注7) 第4期計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,312,653円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(99,227円)および分配準備積立金(264,665円)より分配対象収益は4,676,545円(10,000口当たり58円)であり、うち3,567,972円(10,000口当たり45円)を分配金額としております。

(注8) 第5期計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,497,272円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(116,082円)および分配準備積立金(1,068,413円)より分配対象収益は4,681,767円(10,000口当たり63円)であり、うち3,311,921円(10,000口当たり45円)を分配金額としております。

<ご参考>

主要投資対象の投資信託証券の概要

| | |
|---------------|---|
| 名称 | SBI ボンド スリランカ短期国債ファンド (適格機関投資家専用) |
| 形態 | 国内投資信託 |
| 運用目的・ 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> スリランカの短期国債等(国債、政府保証債、政府機関債)及び国際機関債を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。 債券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。 重大な投資環境の変化が生じた場合には、信託財産の保全の観点から、委託会社の判断により主要投資対象への投資を大幅に縮小する場合があります。 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。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> 株式への投資割合は、転換社債の転換及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 収益分配 | <ul style="list-style-type: none"> 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 |
| 信託期間 | 原則として無期限(設定日:2016年12月30日) |
| 決算日 | 毎月7日(休業日の場合は翌営業日) |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し年0.3888%(税抜:年0.36%) |
| 委託会社 | SBI ボンド・インベストメント・マネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

■ SBI ボンド スリランカ短期国債ファンド（適格機関投資家専用）の状況

2017年6月19日現在入手している最新（第5期決算日（2017年6月7日現在））の状況です。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 第1期～第5期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|---------|-----------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 16 | % 0.17 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (15) | (0.16) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (0) | (0) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (1) | (0.01) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 12 | 0.12 | (b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (5) | (0.05) | 保管費用は、海外における保管銀行に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (1) | (0.01) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (6) | (0.06) | 信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合 計 | 28 | 0.29 | |
| 作成期間の平均基準価額は、9,662円です。 | | | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」と期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■組入資産の明細

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
|-------|------------------------|------------------------|---------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|-----------|
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| スリランカ | 千スリランカルピー 1,200,000 | 千スリランカルピー 1,173,467 | 千円 844,896 | % 86.5 | % — | % — | % 18.2 | % 68.3 |
| スリランカ | 千米ドル 500 | 千米ドル 518 | 56,750 | 5.8 | — | — | — | 5.8 |
| 合 計 | — | — | 901,646 | 92.3 | — | — | 18.2 | 74.1 |

(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切捨て。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | | 第 1 作 成 期 末 | | | | | 償還年月日 |
|-------|------|-------------|-----------|-----------|---------|-----------|-------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 債 権 年 月 日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| スリランカ | | % | 千スリランカルピー | 千スリランカルピー | 千円 | | |
| | 国債証券 | 10.75 | 100,000 | 99,660 | 71,755 | 2019/1/15 | |
| | | 8.5 | 100,000 | 97,972 | 70,539 | 2018/6/1 | |
| | | 10.75 | 50,000 | 49,830 | 35,877 | 2019/1/15 | |
| | | 8.5 | 500,000 | 487,953 | 351,326 | 2018/4/1 | |
| | | 10.6 | 250,000 | 247,278 | 178,040 | 2019/9/15 | |
| | | 7.5 | 200,000 | 190,774 | 137,357 | 2018/8/15 | |
| 小 | 計 | | | | 702,601 | | |
| スリランカ | | | 千米ドル | 千米ドル | | | |
| | 国債証券 | 6 | 500 | 518 | 56,750 | 2019/1/14 | |
| 小 | 計 | | | | 56,750 | | |
| 合 | 計 | | | | 901,646 | | |

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第1期末 | 第2期末 | 第3期末 | 第4期末 | 第5期末 |
|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2017年2月7日現在 | 2017年3月7日現在 | 2017年4月7日現在 | 2017年5月8日現在 | 2017年6月7日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 1,032,841,195 | 1,096,831,440 | 1,096,328,652 | 1,074,586,267 | 1,054,775,874 |
| コール・ローン等 | 465,657,355 | 73,910,647 | 80,490,044 | 35,313,348 | 136,844,033 |
| 公社債 | 563,959,784 | 994,079,384 | 1,005,246,029 | 1,024,140,759 | 901,646,903 |
| 未收利息 | 307,303 | 2,796,652 | 6,234,983 | 12,434,747 | 15,209,178 |
| 前払費用 | 2,916,753 | 26,033,015 | 4,324,319 | 2,639,410 | 1,026,095 |
| その他未収収益 | — | 11,742 | 33,277 | 58,003 | 49,665 |
| (B) 負債 | 317,959 | 340,926 | 6,732,440 | 6,479,971 | 77,920,679 |
| 未払金 | — | — | — | — | 71,858,736 |
| 未払収益分配金 | — | — | 6,347,795 | 6,105,815 | 5,714,067 |
| 未払信託報酬 | 290,286 | 320,699 | 361,865 | 351,156 | 325,989 |
| 未払利息 | 1,138 | 67 | 109 | 89 | 47 |
| その他未払費用 | 26,535 | 20,160 | 22,671 | 22,911 | 21,840 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,032,523,236 | 1,096,490,514 | 1,089,596,212 | 1,068,106,296 | 976,855,195 |
| 元本 | 1,075,348,617 | 1,133,710,758 | 1,154,144,645 | 1,110,148,290 | 1,038,921,387 |
| 次期繰越損益金 | △ 42,825,381 | △ 37,220,244 | △ 64,548,433 | △ 42,041,994 | △ 62,066,192 |
| (D) 受益権総口数 | 1,075,348,617口 | 1,133,710,758口 | 1,154,144,645口 | 1,110,148,290口 | 1,038,921,387口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,602円 | 9,672円 | 9,441円 | 9,621円 | 9,403円 |

■損益の状況

| 項 目 | 第1期 | 第2期 | 第3期 | 第4期 | 第5期 |
|------------------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2016年12月30日～ 2017年2月7日 | 2017年2月8日～ 2017年3月7日 | 2017年3月8日～ 2017年4月7日 | 2017年4月8日～ 2017年5月8日 | 2017年5月9日～ 2017年6月7日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 281,437 | 2,728,643 | 7,053,916 | 7,202,490 | 6,552,888 |
| 受取利息 | 307,301 | 2,729,538 | 7,034,609 | 7,205,495 | 6,600,044 |
| その他収益金 | — | 11,742 | 21,535 | △ 2,490 | △ 58,246 |
| 支払利息 | △ 25,864 | △ 12,637 | △ 2,228 | △ 515 | 11,090 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 1,751,122 | △ 1,600,928 | 2,306,364 | 4,765,906 | 1,884,847 |
| 売買益 | — | 4,887,616 | 2,494,945 | 4,765,906 | 3,525,060 |
| 売買損 | △ 1,751,122 | △ 6,488,544 | △ 188,581 | 0 | △ 1,640,213 |
| (C) 信託報酬等 | △ 867,321 | △ 397,204 | △ 525,834 | △ 373,716 | △ 605,065 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 2,337,006 | 730,511 | 8,834,446 | 11,594,680 | 7,832,670 |
| (E) 前期繰越損益金 | — | △28,461,256 | △21,095,472 | △45,110,976 | △23,323,496 |
| (F) 追加信託差損益金 | △14,364,125 | △16,124,772 | △17,039,661 | △16,900,378 | △15,933,488 |
| (配当等相当額) | (△ 10,081) | (11,121) | (128,709) | (168,910) | (180,455) |
| (売買損益相当額) | (△14,354,044) | (△16,135,893) | (△17,168,370) | (△17,069,288) | (△16,113,943) |
| (G) 合計(D+E+F) | △16,701,131 | △43,855,517 | △29,300,687 | △50,416,674 | △31,424,314 |
| (H) 収益分配金 | 0 | 0 | △ 6,347,795 | △ 6,105,815 | △ 5,714,067 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △42,825,381 | △37,220,244 | △64,548,433 | △42,041,994 | △62,066,192 |
| 追加信託差損益金 | △14,364,125 | △16,124,772 | △17,039,661 | △16,900,378 | △15,933,488 |
| (配当等相当額) | (△ 10,081) | (11,121) | (128,709) | (168,910) | (180,455) |
| (売買損益相当額) | (△14,354,044) | (△16,135,893) | (△17,168,370) | (△17,069,288) | (△16,113,943) |
| 分配準備積立金 | — | 2,589,025 | 2,769,312 | 3,700,364 | 3,782,010 |
| 繰越損益金 | △28,461,256 | △23,684,497 | △50,278,084 | △28,841,980 | △49,914,714 |

■ F O F s用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）の状況

2017年6月19日現在入手している最新（第6期決算日（2016年9月26日現在））の状況です。

■1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|-------------------------|---------|---|
| | (2015年9月26日～2016年9月26日) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 | % | (a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,969円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (投 信 会 社) | (11) | (0.108) | |
| (販 売 会 社) | (1) | (0.011) | |
| (受 託 会 社) | (2) | (0.022) | |
| (b) そ の 他 費 用 | 1 | 0.005 | (b) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.004) | その他は、金銭信託預入に係る手数料等 |
| 合 計 | 15 | 0.146 | |

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含まず。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■組入資産の明細 親投資信託残高

| | 当期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 短期金融資産 マザーファンド | 千口 2,259 | 千口 4,029 | 千円 4,090 |

(注) 親投資信託の当期末における受益権総口数は7,544,440千口です。

■投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 期 末 | |
|----------------|-------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 短期金融資産 マザーファンド | 千円 4,090 | % 99.9 |
| コール・ローン等、その他 | 3 | 0.1 |
| 投資信託財産総額 | 4,093 | 100.0 |

■資産、負債、元本および基準価額の状況 (2016年9月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------|------------|
| (A) 資 産 | 4,093,367円 |
| コール・ローン等 | 2,368 |
| 短期金融資産 マザーファンド(評価額) | 4,090,719 |
| 未 収 入 金 | 280 |
| (B) 負 債 | 2,448 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 2,406 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 42 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 4,090,919 |
| 元 本 | 4,106,396 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △15,477 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 4,106,396口 |
| 1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C / D) | 9,962円 |

■損益の状況 (自2015年9月26日 至2016年9月26日)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------|------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 62円 |
| 売 買 益 | 833 |
| 売 買 損 | △771 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △3,883 |
| (C) 当 期 損 益 金 (A + B) | △3,821 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | △4,551 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △7,105 |
| (配 当 等 相 当 額) | (102,280) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△109,385) |
| (F) 計 (C + D + E) | △15,477 |
| (G) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (F + G) | △15,477 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △7,105 |
| (配 当 等 相 当 額) | (102,562) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△109,667) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 95,831 |
| 繰 越 損 益 金 | △104,203 |

(注1) (A) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (B) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

当ファンド（FOFs 用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用））が投資対象としている「短期金融資産マザーファンド（第9期決算日（2016年9月26日現在））」の組入資産の内容等の状況

■1 万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|-------------------------|------------|--|
| | (2015年9月26日～2016年9月26日) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 0 | % 0.003 | (a)その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ その他は、金銭信託預入に係る手数料等 |
| (そ の 他) | (0) | (0.003) | |
| 合 計 | 0 | 0.003 | |

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | |
|---------------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-----------------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地方債証券 | 300,000 (300,000) | 300,499 (300,499) | 3.9 (3.9) | — (—) | — (—) | — (—) | 3.9 (3.9) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 2,243,000 (2,243,000) | 2,250,392 (2,250,392) | 29.4 (29.4) | — (—) | — (—) | — (—) | 29.4 (29.4) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 200,000 (200,000) | 202,911 (202,911) | 2.6 (2.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 2.6 (2.6) |
| 合 計 | 2,743,000 (2,743,000) | 2,753,802 (2,753,802) | 36.0 (36.0) | — (—) | — (—) | — (—) | 36.0 (36.0) |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

| | 当 | 期 | 末 | | |
|---------------------------|-------|-----------|-----------|------------|--|
| 銘柄名 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 | |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | | |
| 平成18年度第6回静岡県公募公債 | 1.91 | 100,000 | 100,309 | 2016/11/28 | |
| 平成23年度第10回愛知県公募公債(5年) | 0.325 | 100,000 | 100,020 | 2016/10/19 | |
| 平成23年度第11回埼玉県公募公債(5年) | 0.34 | 100,000 | 100,170 | 2017/3/28 | |
| 小計 | | 300,000 | 300,499 | | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 第10回政府保証中日本高速道路債券 | 1.8 | 100,000 | 100,266 | 2016/11/18 | |
| 第3回政府保証西日本高速道路債券 | 1.8 | 240,000 | 240,758 | 2016/11/28 | |
| 第869回政府保証公営企業債券 | 1.8 | 600,000 | 601,686 | 2016/11/21 | |
| 第871回政府保証公営企業債券 | 1.8 | 422,000 | 424,565 | 2017/1/25 | |
| 第19回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.8 | 476,000 | 476,066 | 2016/9/29 | |
| 第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.8 | 100,000 | 100,326 | 2016/11/30 | |
| 第6回政府保証東日本高速道路債券 | 1.8 | 205,000 | 205,606 | 2016/11/24 | |
| 第8回政府保証西日本高速道路債券 | 1.7 | 100,000 | 101,117 | 2017/5/19 | |
| 小計 | | 2,243,000 | 2,250,392 | | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| 第306回中国電力株式会社社債 | 3.6 | 100,000 | 100,277 | 2016/10/25 | |
| 第310回中国電力株式会社社債 | 3.225 | 100,000 | 102,634 | 2017/7/25 | |
| 小計 | | 200,000 | 202,911 | | |
| 合計 | | 2,743,000 | 2,753,802 | | |

■投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 2,753,802 | % 35.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,907,068 | 64.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 7,660,870 | 100.0 |

■資産、負債、元本および基準価額の状況 (2016年9月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 7,660,870,057円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 4,893,084,185 |
| 公 社 債 (評 価 額) | 2,753,802,600 |
| 未 取 利 息 | 13,809,301 |
| 前 払 費 用 | 173,971 |
| (B) 負 債 | 1,245,918 |
| 未 払 解 約 金 | 1,230,280 |
| 未 払 利 息 | 11,390 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 4,248 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 7,659,624,139 |
| 元 本 | 7,544,440,838 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 115,183,301 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 7,544,440,838口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 10,153円 |

■損益の状況 (自2015年9月26日至2016年9月26日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|-------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 63,646,485円 |
| 受 取 利 息 | 64,923,230 |
| 支 払 利 息 | △1,276,745 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △62,089,450 |
| 売 買 損 | △62,089,450 |
| (C) そ の 他 費 用 | △233,618 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 1,323,417 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 110,485,572 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 6,131,769 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △2,757,457 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 115,183,301 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 115,183,301 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。