

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年4月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	コア投資戦略ファンド（安定型） コア投資戦略ファンド（成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	コア投資戦略ファンド（安定型） 10兆円を上限とします。 コア投資戦略ファンド（成長型） 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

コア投資戦略ファンド（安定型）

コア投資戦略ファンド（成長型）

（以下、上記を総称して「コア投資戦略ファンド」又は「コアラップ」ということ、あるいは総称して又は個別に「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

愛称として、コア投資戦略ファンド（安定型）は「コアラップ（安定型）」、コア投資戦略ファンド（成長型）は「コアラップ（成長型）」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、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を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「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。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方からの取得申込み及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）からの取得申込み（以下「確定拠出年金によるお申込み」といいます。）は、申込手数料を無料とします。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金によるお申込みについては1円以上1円単位とします。

（7）【申込期間】

平成30年 4月11日から平成30年10月10日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（9）【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

（10）【払込取扱場所】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（11）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 1 2 ) 【その他】

## &lt; 振替受益権について &gt;

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

## &lt; 受益権の取得申込みの方法 &gt;

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

## &lt; 申込みコース &gt;

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

## &lt; 受益権の取得申込みの受付の中止等 &gt;

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## &lt; スイッチング &gt;

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

## &lt; 受付不可日 &gt;

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

各ファンドにつき上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		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

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	対象 インデックス	特殊型

株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	ファンド	(部分		
大型株	年2回			ヘッ	TOPIX	条件付運用型
中小型株			ファンド・	ジ)		
債券	年4回	日本	オブ・ファ		その他	ロング・
一般	年6回	北米	ンズ	なし	( )	ショート型/ 絶対収益追求 型
公債	(隔月)	欧州				
社債						
その他債券	年12回					その他
クレジット属	(毎月)	アジア				( )
性						
( )	日々	オセアニア				
不動産投信	その他	中南米				
	( )					
その他資産		アフリカ				
(投資信託証券						
(資産複合(株		中近東				
式、債券、不動		(中東)				
産投信、その他						
資産(バンク		エマージン				
ローン、デリバ		グ				
ティブ、為替予						
約取引等))資						
産配分変更						
型))						
資産複合						
( )						
資産配分						
固定型						
資産配分						
変更型						

(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。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

す。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 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う。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

##### [ 投資対象地域による区分 ]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

##### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

##### [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

##### [ 補足分類 ]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記す

るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### (1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株... 目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株... 目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

###### (2) 債券

一般... 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債... 目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債... 目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券... 目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性... 目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合... 以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型... 目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型... 目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

(1) 年1回... 目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2) 年2回... 目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3) 年4回... 目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4) 年6回(隔月)... 目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5) 年12回(毎月)... 目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6) 日々... 目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7) その他... 上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

##### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1) グローバル... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉と

する旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「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・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦

略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

### <ファンドの特色>

## 1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

## 2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
  - 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド<sup>\*1</sup>等に投資し、オルタナティブ運用<sup>\*2</sup>を行います。
- ※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
- ※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、MLP、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

## 3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。

従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

## 4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への 投資割合の合計 <sup>*3</sup>	運用の特徴
コア投資戦略ファンド(安定型) <sup>*4</sup> 愛称:コアラップ(安定型)	原則50%未満	安定性を重視
コア投資戦略ファンド(成長型) 愛称:コアラップ(成長型)	原則75%未満	安定性と収益性の バランスを重視

- 3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3 投資リスク

(1)ファンドのリスク 「ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

4「安定型」とは元本保証等を意味するものではなく、「成長型」と比較して安定的な運用を目指すファンドであることを意味しています。

市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針(2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。

## ？ ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

- 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。
- 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

## 〈ご参考情報〉

### 米国地方債

米国地方債は、地方公共団体等が発行する債券で、発行体自身の信用力によって元利金の支払いを保証する一般財源保証債と、インフラ施設やサービス事業の利用料等を返済原資とするレベニュー債が主に発行されています。

### MLP

MLPはマスター・リミテッド・パートナーシップ(Master Limited Partnership)の略称です。米国で行われている共同投資事業形態の1つで、米国の金融商品取引所で取引されています。MLPの多くは、エネルギー・天然資源に関連する事業を行っています。

### バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

### コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

### ヘッジファンド

ヘッジとは元々「回避する」という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド\*などがあります。

\*特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

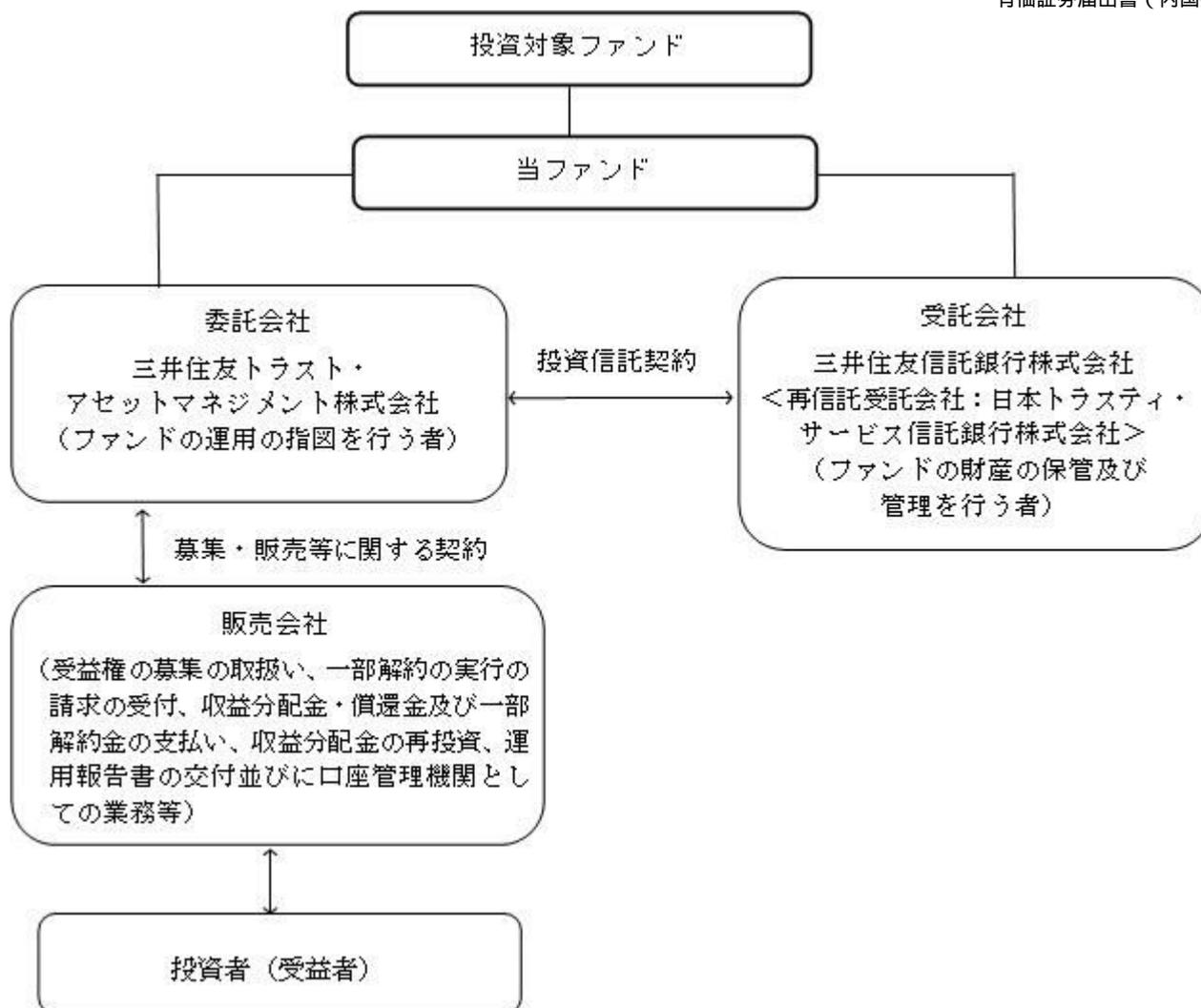
## (2) 【ファンドの沿革】

平成24年8月7日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成30年 1月31日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

- 昭和61年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 昭和62年2月20日： 投資顧問業の登録
- 昭和62年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 平成2年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 平成11年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 平成11年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 平成19年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 平成24年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

### 投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

### 投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ<sup>\*1</sup>、ヘッジファンド<sup>\*2</sup>及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

\*1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

\*2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、以下の割合とします。

コア投資戦略ファンド（安定型）	コア投資戦略ファンド（成長型）
50%未満	75%未満

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ニ．投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ヘ．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

ト．ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によって

は、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の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（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（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. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 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及び社債券（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及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

### 金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記 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

ロ．上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

### （参考）投資対象ファンドの概要

- ・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、平成30年 1月31日（（ ）のファンドに関しては平成30年4月10日）現在、委託会社が知

り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

#### 1.ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてわが国の株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式
投資態度	<p>主として、日経平均株価に採用されている株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。</p> <p>株式の売買の判断は、複数の投資判断モデルを組み合わせ、機動的に行います。その結果、株式の組入比率は、投資信託財産の純資産総額に対して大きく変動し、ゼロとなる場合もあります。</p> <p>株式以外の資産への投資は、わが国の円建短期公社債等を中心に行いません。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の一部解約又は追加信託の処理を行う前の投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を一部解約又は追加信託の処理を行う前の受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成23年11月28日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

## 2.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資するJPX日経インデックス400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）
決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0756%（税抜 年0.07%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年2月3日
信託期間	原則として平成26年2月3日から平成35年10月20日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

J P X日経インデックス400とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数は、J P Xグループ並びに日経によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P Xグループ及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

同指数を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJ P Xグループ及び日経に帰属しています。

当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループ及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

J P Xグループ及び日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

J P Xグループ及び日経は、同指数の構成銘柄、計算方法、その他同指数の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

### 3.FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本株配当マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度	<p>主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式の中から、予想配当利回りが比較的高いと判断される銘柄及び配当増が予想される銘柄群に投資します。</p> <p>株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年2月2日
信託期間	原則として平成27年2月2日から平成37年4月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 4. F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、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	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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なうこととします。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・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。 分配金額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には分配を行わないこともあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.3672%（税抜 年0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年1月30日
信託期間	平成27年1月30日から平成37年2月17日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全

ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### 5. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

#### 6. FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。</p> <p>債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年4月11日
信託期間	原則として平成26年4月11日から平成36年2月14日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 7. FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界のインフレ連動国債等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

ベンチマーク	ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）
決算日	年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、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には分配を行わないことがあります。 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年3月31日
信託期間	原則として平成29年3月31日から平成39年1月18日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス」とは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスをあらわします。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標及びサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標及びサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

#### 8. Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class

投資顧問会社	ヌビーン・アセット・マネジメント・エルエルシー
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。
投資態度	主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。 ポートフォリオの構築は、米国の地方財政や米国地方債における各セクターの幅広いテクニカル要因及びファンダメンタルズ要因等の状況を精査した上で、個別銘柄に対する詳細な分析に基づいて行います。 米国の投資適格地方債への投資割合は、原則として高位を維持します。 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	毎月
信託報酬	<p>年率0.44%（税抜0.44%）</p> <p>この他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等及びデリバティブ取引に要する費用等並びに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年2月26日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資顧問会社 Nuveen Asset Management ,LLC</li> <li>・ 受託会社 G.A.S. (Cayman) Limited</li> <li>・ 管理事務代行会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li> <li>・ 名義書換事務受託会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li> <li>・ 保管受託銀行 Sumitomo Mitsui Trust (UK) Limited</li> </ul>

## 9. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式
投資態度	<p>原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）」とは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### 10. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------

運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### 11. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）

投資態度	<p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成20年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

## 12.FOFs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資する新興国株式セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の株式に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、個別銘柄の収益性、収益の安定性、財務の健全性等を勘案し、各銘柄への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となる場合があります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 13. Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J（ ）（平成30年5月設定予定）

運用会社	WELLINGTON MANAGEMENT SINGAPORE PTE LTD.
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

主要投資対象	<p>金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。</p> <p>この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。</p>
投資態度	<p>MSCIエマージング・マーケット・インデックス（ ）の騰落率を上回る投資成果を追求します。</p> <p>ポートフォリオは、カンントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>運用会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	<p>年率0.9%（税抜 0.9%）</p> <p>なお、この報酬率には投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成30年5月設定予定
信託期間	原則として無期限

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 管理会社（マネージメントカンパニー） WELLINGTON LUXEMBOURG S.a r.l.</li> <li>・ 運用会社（インベストメントマネージャー） WELLINGTON MANAGEMENT SINGAPORE PTE LTD.</li> <li>・ 預託機関（デポジタリー） BROWN BROTHERS HARRIMAN (LUXEMBOURG) S.C.A.</li> <li>・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） BROWN BROTHERS HARRIMAN (LUXEMBOURG) S.C.A.</li> <li>・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） BROWN BROTHERS HARRIMAN (LUXEMBOURG) S.C.A.</li> </ul>
------	---

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### 14. 新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券
投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成20年12月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

#### 15. FOFs用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として新興国の現地通貨建債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する新興国債券セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の現地通貨建債券に直接投資することもあります。

投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の現地通貨建債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、債券の時価総額や流動性等を勘案し、各国への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の現地通貨建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の現地通貨建債券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 16.FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を含む世界各国の債券に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国の債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への実質投資割合を決定します。</p> <p>債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 17. 大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	大和住銀投信投資顧問株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。
主要投資対象	マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。</p> <p>中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。</p> <p>世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。</p> <p>マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の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の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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配金額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には分配を行わないこともあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.7452%以内（税抜：0.69%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月12日
信託期間	原則として無期限
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 18.J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	<p>わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（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及び社債券（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及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）

決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成20年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### 19. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（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及び社債券（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及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成20年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追隨するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にあ

る唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

## 20. F O F s 用 M L P インデックスファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、別に定めるMLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	インデックス マザーファンドMLP 受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券

投資態度	<p>主として、インデックス マザーファンドMLP 受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLP やMLP に関連する証券に投資を行ない、別に定めるMLP 市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。</p> <p>運用にあたって、対象指数に採用されていないMLP 等についても、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は投資を行ないます。また、対象指数に採用されているMLP 等の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合があります。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>&lt; 別に定めるMLP 市場の動きをとらえる指数 &gt; S&amp;P MLP 指数（円換算ベース）（ ）</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p>
ベンチマーク	S&P MLP 指数（円換算ベース）（平成30年1月31日現在）
決算日	年1回：11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定する。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともある。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行なう。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1512%（税抜 年0.14%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	平成26年10月8日から平成36年11月20日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「S&P MLP 指数」とはS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJ」）が公表する指数で、ニューヨーク証券取引所やNASDAQなどに上場するMLP などのうち、GICS（世界産業分類基準）においてエネルギーセクターまたは公益事業セクターのガス産業に属する銘柄を対象とした、浮動株調整後の時価総額加重を基本とする指数です。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに日興アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。同指数は、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが日興アセットマネジメント株式会社に付与されています。

投資顧問会社	Credit Suisse Asset Management, LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米ドル建の貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）に投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。
投資態度	<p>主として米ドル建のバンクローンに投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築は、個別銘柄の信用力、割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。</p> <p>米ドル建以外の資産に投資した場合、当該資産については原則として対米ドルでの為替予約取引等を行いません。</p> <p>米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。</p>
主な投資制限	<p>第一順位担保権付のバンクローンへの投資割合は、投資信託財産の純資産総額の80%以上とします。</p> <p>組入比率上位3業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の15%を上限とします。その他の業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の12%を上限とします。</p> <p>組入比率上位10銘柄への投資割合の合計は、投資信託財産の純資産総額の20%を上限とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
ベンチマーク	クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	<p>年率0.65%（税抜0.65%）</p> <p>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、受託会社・管理事務代行会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。</p> <p>この他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年10月2日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資顧問会社 Credit Suisse Asset Management, LLC</li> <li>・ 受託会社 G.A.S. (Cayman) Limited</li> <li>・ 管理事務代行会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li> <li>・ 保管受託銀行 State Street Bank and Trust Company</li> </ul>
------	--

## 22. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券
投資態度	<p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>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投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成20年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）および「ブルームバーグ（Bloomberg<sup>(R)</sup>）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブ

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（BloombergCommodity Index<sup>SM</sup>）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

### 23. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（平成30年1月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>L B M A 金価格（円ヘッジベース）（ ）（平成30年1月31日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>平成29年10月11日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

L B M A 金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後公表される金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、L B M A は、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、L B M A 金価格及びL B M A 金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

#### 24. TCAファンド（適格機関投資家専用）

<p>運用会社</p>	<p>三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社</p>
-------------	--------------------------------

運用の基本方針	この投資信託は、主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数を対象とした先物取引（以下「株価指数先物取引」といいます。）及び債券先物取引を積極的に活用し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の円建短期公社債等並びに日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引（以下「先物取引等」といいます。）を行います。</p> <p>運用にあたっては、三井住友信託銀行株式会社から助言を受けます。</p> <p>先物取引等は、原則として定量的手法に基づき行います。</p> <p>先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の75の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の500の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>ここでいう投資額とは、投資信託財産における先物取引等の種類ごとに買建玉の時価総額と売建玉の時価総額の差額の絶対値を合計した額をいいます。</p> <p>先物取引等にかかる損益等の為替リスクに対しては、原則として為替予約を行い、為替リスクの低減をはかります。</p> <p>大量の追加設定又は解約が発生したとき、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき、投資信託財産の規模その他の要因等によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	6月・12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲 経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配対象額についての分配方針 委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や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。</p> <p>留保益の運用方針 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成22年2月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として積極的な運用を行います。
主要投資対象	ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設定された海外籍特別目的会社の発行する円建債券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、円建債券への投資を通じて、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託「FRM Sigma MA Fund Limited（以下「FRM シグマファンド」といいます。）」の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM シグマファンドは、主としてシステム運用戦略に基づいて、株式、債券、金利、商品、為替等各種資産の取引（関連デリバティブ取引を含みます。）を行う複数のファンドに投資することで、テールリスク・ヘッジを行いつつ、中長期における絶対収益の獲得を目指します。なお、システム運用戦略以外のファンドに投資することもあります。</p> <p>原則として、円建債券の組入比率は高位を保ちます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。

決算日	年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 26.ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ファミリーファンド方式により、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として、ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 主として、海外の上場先物、為替取引等を投資対象とします。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。 当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、その主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI総合指数（HFRI Weighted Composite Index）（ ）を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 マザーファンドの組入れ比率は高位に保つことを原則とします。 当ファンドは、原則として対円での為替ヘッジを行います。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 <マザーファンドの投資態度> 主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 当ファンドの運用に関しては三井住友信託銀行株式会社より投資助言を受けます。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、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	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時（原則として毎年8月15日）に分配対象収益の中から、収益分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。ただし、信託財産の状況によっては、分配を行わないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.5832%（税抜 年0.54%）以内

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月8日
信託期間	原則として平成24年8月8日から平成34年6月27日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「HFR I総合指数<sup>(R)</sup> (HFR I Weighted Composite Index<sup>(R)</sup>)」(以下「HFR指数」)は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク(HFR)の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)」に関する使用のみ、BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR及びHFR指数(当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている)は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFRは、当該投資信託を發起、支持、販売又は推奨していません。HFRは、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日における当該投資信託の運用成績がHFR指数の運用成績あるいはHFR指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFRは当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR指数の過誤について通知する義務を負いません。HFRは、HFR指数の計算に使用される方法を含むHFR指数をいつでも修正、変更し、HFR指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。

HFRは、当該投資信託及び当該投資信託の投資家に対して、HFR指数の過誤を含むいかなる種類、性質の損害も賠償する責任を負いません。

HFR指数に関して、HFRは、全ての明示的あるいは暗示的な保証(特定の目的に係る商品性又は適合性、権利及び非侵害性の保証を含むがこれに限らない)を明示的に否認します。

## 27. Global Absolute Return Strategies Fund- Class D<sup>A, H, JPY</sup>

投資顧問会社	Standard Life Investments Limited
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等に投資します。
投資態度	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等の多様な資産に対して、様々な投資手法を活用した投資を行うことで、リスクの低減を図りつつ、日本円短期金利(円LIBOR 6ヶ月物)を上回る投資成果を目指します。 組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	日本円短期金利(円LIBOR 6ヶ月物)
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.85%(税抜0.85%) この他、投資信託財産に関する租税や、投資信託の運営・運用等に要する諸費用が発生します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成23年6月14日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・副投資顧問会社 Standard Life Investments (USA) Limited</li> <li>・管理事務代行会社 / 保管受託銀行 The Bank of New York Mellon SA/NV, Luxembourg Branch</li> </ul>
------	---

## 28.FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	FRM ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託証券「FRM Diversified MA Fund Limited」（以下「FRM ダイバーシファイドファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM ダイバーシファイド ファンドは、様々なヘッジファンドに分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年10月16日
信託期間	原則として、平成25年10月16日から平成30年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 29. BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	<p>わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。</p> <p>なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。</p>

投資態度	<p>主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未滿の格付の債券等に投資することもあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。</p> <p>債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>組入外貨建資産について対円で為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	<p>年率0.74%（税抜0.74%）</p> <p>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成23年5月24日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A.</li> <li>・ 投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP</li> <li>・ 副投資顧問会社 BlueBay Asset Management USA LLC</li> <li>・ 管理事務代行会社 / 名義書換事務受託会社 / 保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.</li> </ul>

## 30.FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	KIM マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、Kairos Investment Management Ltd. が運用する外国投資信託証券「SuMi-KAIROS MULTI - STRATEGY FUND」（以下「スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドは、様々なヘッジファンド等に分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 31.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 32.FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHLファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 33. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<p>この投資信託は、わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。</p>
主要投資対象	<p>わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。</p>

投資態度	<p>主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。</p> <p>運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引に係る実質投資額は原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
------	--

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、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、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年4月2日
信託期間	平成25年4月2日から平成38年3月26日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

投資顧問会社	Numeric Investors LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。
投資態度	主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。 企業の財務情報、市場価格、その他のデータを収集し、モニタリングするシステム運用手法を用いてロング・ショート（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築します。
主な投資制限	投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。 受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。 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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月の最終ファンド営業日
収益の分配	収益の分配は行いません。
運用報酬	年率1.5%（税抜1.5%） 上記の他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年3月10日
信託期間	当該ファンドでは信託期間は定められておりません。
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資顧問会社 Numeric Investors LLC</li> <li>・ 管理事務代行会社 State Street (Cayman) Trust, Limited</li> <li>・ 保管受託銀行 STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY</li> </ul>

## 35. 米国株式LSマザーファンド

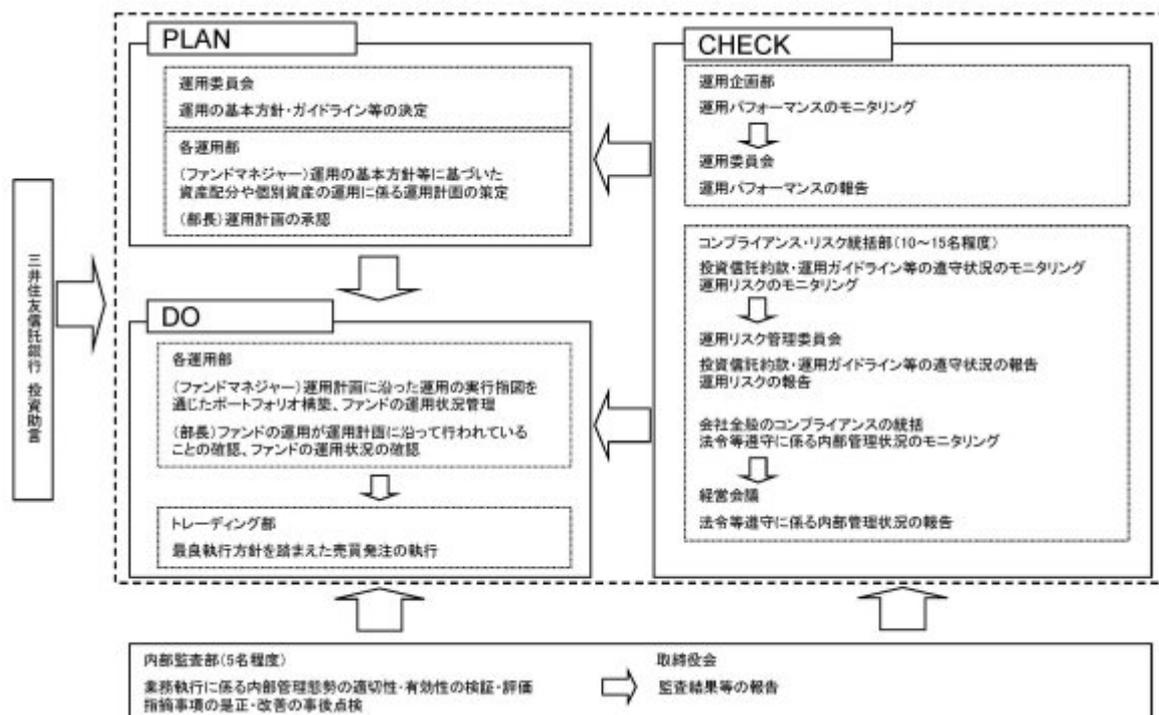
運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。</p> <p>米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。</p> <p>米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更され

ることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

#### (4) 【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、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。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### (5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

##### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

##### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

##### ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

## ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

## ヘ．公社債の借入れの指図及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

## ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

## チ．外国為替予約取引の指図

委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

## リ．資金の借入れ

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並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（一部解約に伴う支払資金の手当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、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。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に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資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又は受益者への解約代金支払開始日から投資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投資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、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

## <その他の投資制限>

イ．当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又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及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

## 3【投資リスク】

## (1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、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。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

### 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

### MLPの価格変動リスク

MLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）の多くは、エネルギー、天然資源に関わる事業を主な投資対象とするため、MLPの価格は、事業を取り巻く環境やエネルギー市況の変化、金利変動等の要因により変動し、基準価額の変動要因となります。

### 商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

### 信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受け、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

## 米国地方債に関する信用リスク

米国地方債は、元利償還財源の相違によって「レベニュー債」と「一般財源保証債」に大別されま

### <レベニュー債>

レベニュー債は、特定事業（例としては、空港、上下水道、公立病院、公立学校の整備・運営等）から生じる収入等を元利償還財源として発行されます。このため、発行体である地方公共団体や公的機関等が、レベニュー債の裏付けとしてあらかじめ定められた特定事業以外の事業等から生じた資金を保有していたとしても、その資金がレベニュー債の元利償還に充当されることはありません。したがって、発行体である地方公共団体や公的機関等の財政状況にかかわらず、レベニュー債の裏付けとなる特定事業が不振となり、当該レベニュー債に係る元利払いができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、レベニュー債の価格が下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

### <一般財源保証債>

一般財源保証債は、起債する地方公共団体の課税権を含む全信用力を担保として発行され、発行体が元利償還の全責任を負います。したがって、発行体である地方公共団体が財政難、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、一般財源保証債の価格が下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

## 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

## カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

## 資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

## ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

## 仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果

を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

#### ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があります。ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託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及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。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

## (2) リスクの管理体制

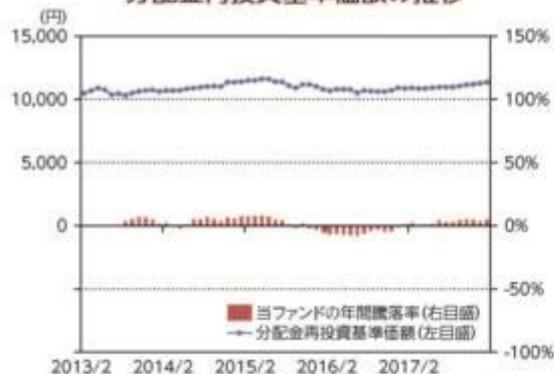
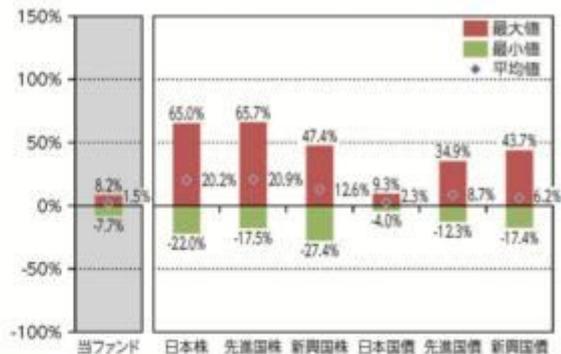
### 委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

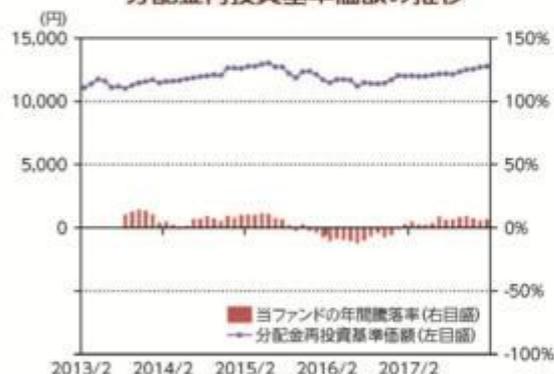
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 【参考情報】

## コア投資戦略ファンド(安定型)

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

## コア投資戦略ファンド(成長型)

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*当ファンドについては2013年8月～2018年1月の4年6ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2013年2月～2018年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

\*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>\*1</sup>

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>\*2</sup>

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>\*3</sup>

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>\*4</sup>

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>\*5</sup>

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド(円ベース)<sup>\*6</sup>

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

\*1～\*6については、後掲「各資産クラスの指数の概要」をご覧ください。

**各資産クラスの指数の概要**

- ※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- ※2 MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また、「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※3 MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また、「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 NOMURA-BP国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または誤記につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

**4【手数料等及び税金】****(1)【申込手数料】**

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

1：「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます（以下同じ。）。

「分配金再投資コース」（2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記 及び の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

確定拠出年金によるお申込みは申込手数料を無料とします。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**(2)【換金（解約）手数料】**

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.4904%（税抜1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.9504% （税抜 0.88%）	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
販売会社	年率 0.486% （税抜 0.45%）	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	年率 0.054% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

## (参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	ありません。
FOfs用JPX日経インデックス400・オープン （適格機関投資家専用）	年率 0.0756% （税抜 0.07%）
FOfs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド （適格機関投資家専用）	年率 0.3672% （税抜 0.34%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOfs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
FOfs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり （適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	年率 0.44% （税抜 0.44%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
FOfs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）

Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J (平成30年5月設定予定)	年率 0.9% (税抜 0.9%)
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)	年率 0.7452%以内 (税抜 0.69%以内)
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用MLPインデックスファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.1512% (税抜 0.14%)
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 0.65% (税抜 0.65%)
グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	ありません。
TCAファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.864% (税抜 0.8%)
FRMシグマ リンク マザーファンド	ありません。
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド ・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	年率 0.5832%以内 (税抜 0.54%以内)
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D <sup>A, H, JPY</sup>	年率 0.85% (税抜 0.85%)
FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74% (税抜 0.74%)
FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.864% (税抜 0.8%)
Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A	年率 1.5% (税抜 1.5%)
米国株式LSマザーファンド	ありません。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際的な組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬

額がかかる場合があります。

実質的な信託報酬率：年率1.4904%～1.98186%程度（税抜 1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））

#### （４）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（ ）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・FRM シグマ リンク マザーファンド

主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

・円建債券は、概ね円建債券の評価額に対して年率0.25%が発行・管理手数料等としてかかります。

・円建債券の連動対象となるFRM シグマ ファンドにおいては、運用報酬（FRM シグマ ファンドの純資産総額に対して年率0.5%）、その他管理費用、監査費用等がかかります。

・FRMシグマ ファンドが組み入れるヘッジファンドは、一般的に固定報酬（各ヘッジファンドの純資産総額に対して年率0.5%～2.0%程度）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、概ね円建債券の評価額に対して年率0.25%が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるFRM ダイバーシファイド ファンドにおいては、運用報酬（FRM ダイバーシファイド ファンドの純資産総額に対して年率0.5%）、その他管理費用、監査費用等がかかりません。
- ・FRM ダイバーシファイド ファンドが組み入れるヘッジファンドは、一般的に固定報酬（各ヘッジファンドの純資産総額に対して年率0.5%～2.0%程度）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかりません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるスミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドにおいては、運用報酬（スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドの純資産総額に対して年率0.725%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかりません。
- ・スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドが組み入れるヘッジファンド等は、一般的に固定報酬（各ヘッジファンド等の純資産総額に対して年率1.0%～2.0%程度）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかりません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して上限年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかりません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかりません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LSマザーファンド

主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかりません。
- ・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかりません。
- ・米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

##### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

##### ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

##### ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当

該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、平成30年 1月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

以下は、平成30年 1月31日現在の状況について記載してあります。

### 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

#### （1）【投資状況】

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	日本	47,637,696,565	49.78
	ケイマン	10,019,274,614	10.47
	小計	57,656,971,179	60.25
投資証券	ルクセンブルク	7,975,872,360	8.33
	ケイマン	1,596,896,930	1.67
	小計	9,572,769,290	10.00
親投資信託受益証券	日本	27,775,800,670	29.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		687,268,112	0.72
合計(純資産総額)		95,692,809,251	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資信託受益証券	FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	9,533,505,689	1.0527	10,035,921,438	1.0554	10,061,661,904	10.51
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	3,232,388,840	2.2871	7,392,796,516	2.5345	8,192,489,514	8.56
日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6,988,013,703	1.0772	7,527,865,713	1.1225	7,844,045,381	8.20
日本	投資信託受益証券	FOFs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	3,317,137,923	1.4305	4,745,397,998	1.6391	5,437,120,769	5.68
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	4,489,787.0186	1,114.36	5,003,239,062	1,125.84	5,054,797,531	5.28
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,814,076,825	2.7330	4,957,871,963	2.7420	4,974,198,654	5.20
ケイマン	投資信託受益証券	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	524,533.4812	9,613.15	5,042,419,034	9,464.55	4,964,477,083	5.19
日本	親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	3,007,840,081	1.4835	4,462,130,761	1.6007	4,814,649,617	5.03
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies A, H, JPY Fund-Class D	2,497,181.575	1,864	4,654,746,455	1,914	4,779,605,534	4.99
日本	投資信託受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	3,072,015,031	0.9799	3,010,267,528	1.0413	3,198,889,251	3.34
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	310,551.438	9,922.86	3,081,558,442	10,292.23	3,196,266,826	3.34
日本	投資信託受益証券	FOFs用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,996,242,660	1.0308	3,088,526,933	1.0564	3,165,230,746	3.31
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	2,828,816,487	0.9973	2,821,178,683	1.0261	2,902,648,597	3.03
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	1,967,376,921	1.2194	2,399,082,373	1.3884	2,731,506,117	2.85
日本	投資信託受益証券	FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用)	2,607,611,332	0.9783	2,551,026,166	0.9914	2,585,185,874	2.70

日本	投資信託受益証券	F O F s用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	2,473,372,793	0.9831	2,431,572,792	0.9982	2,468,920,721	2.58
日本	投資信託受益証券	大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	2,470,659,976	0.955	2,359,480,277	0.9246	2,284,372,213	2.39
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	5,693,028,591	0.3228	1,837,709,630	0.3316	1,887,808,280	1.97
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,075,423,177	1.7145	1,843,813,037	1.6649	1,790,472,047	1.87
日本	投資信託受益証券	F O F s用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	1,665,693,066	0.8316	1,385,190,353	0.9829	1,637,209,714	1.71
日本	親投資信託受益証券	FRMシグマ リンク マザーファンド	1,629,926,001	0.8794	1,433,356,926	0.9919	1,616,723,600	1.69
ケイマン	投資証券	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A	170,114	9,504.42	1,616,834,903	9,387.21	1,596,896,930	1.67
日本	親投資信託受益証券	米国株式LSマザーファンド	1,595,533,934	0.9953	1,588,034,925	1.0008	1,596,810,361	1.67
日本	投資信託受益証券	F O F s用 K I M マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	1,448,344,333	1.0498	1,520,471,880	1.0967	1,588,399,230	1.66
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	1,528,431,764	0.9819	1,500,767,149	1.0266	1,569,088,048	1.64
日本	投資信託受益証券	F O F s用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）	755,970,438	1.0624	803,142,993	1.2179	920,696,396	0.96
日本	投資信託受益証券	F O F s用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	651,348,417	1.2024	783,235,398	1.4082	917,228,840	0.96
日本	投資信託受益証券	F O F s用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,360,389,047	0.6676	908,195,727	0.6721	914,317,478	0.96
日本	投資信託受益証券	F O F s用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用）	331,702,657	0.9001	298,565,561	0.9461	313,823,883	0.33

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	60.25
投資証券	10.00
親投資信託受益証券	29.03

合計	99.28
----	-------

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (平成25年 7月10日)	23,516,126,542	23,516,126,542	10,490	10,490
第2期計算期間末 (平成26年 7月10日)	58,342,334,619	58,342,334,619	10,895	10,895
第3期計算期間末 (平成27年 7月10日)	154,496,842,663	154,496,842,663	11,242	11,242
第4期計算期間末 (平成28年 7月11日)	137,347,490,072	137,347,490,072	10,513	10,513
第5期計算期間末 (平成29年 7月10日)	110,817,992,128	110,817,992,128	10,925	10,925
平成29年 1月末日	124,967,875,639		10,855	
2月末日	123,234,086,687		10,892	
3月末日	119,756,086,633		10,844	
4月末日	117,707,315,402		10,853	
5月末日	114,893,322,616		10,911	
6月末日	111,900,718,435		10,954	
7月末日	109,174,630,805		10,965	
8月末日	106,595,627,271		10,951	
9月末日	104,769,061,871		11,038	
10月末日	102,748,233,118		11,139	
11月末日	99,860,565,719		11,187	
12月末日	97,813,337,887		11,265	
平成30年 1月末日	95,692,809,251		11,338	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成24年 8月 7日～平成25年 7月10日	0

第2期計算期間	平成25年 7月11日～平成26年 7月10日	0
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	0
第4期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	0
第5期計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 7月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成24年 8月 7日～平成25年 7月10日	4.9
第2期計算期間	平成25年 7月11日～平成26年 7月10日	3.9
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	3.2
第4期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	6.5
第5期計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 7月10日	3.9
第6期中間計算期間	平成29年 7月11日～平成30年 1月10日	4.0

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	平成24年 8月 7日～平成25年 7月10日	27,864,099,720	5,445,932,097	22,418,167,623
第2期計算期間	平成25年 7月11日～平成26年 7月10日	41,397,767,660	10,267,152,046	53,548,783,237
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	103,350,778,566	19,468,922,195	137,430,639,608
第4期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	33,825,686,496	40,608,431,436	130,647,894,668
第5期計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 7月10日	9,405,671,580	38,617,124,601	101,436,441,647
第6期中間計算期間	平成29年 7月11日～平成30年 1月10日	2,553,364,701	17,496,445,469	86,493,360,879

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

## (1) 【投資状況】

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	日本	65,098,784,176	46.62
	ケイマン	6,487,880,449	4.65
	小計	71,586,664,625	51.27
投資証券	ルクセンブルク	8,970,923,535	6.42
	ケイマン	1,780,435,785	1.28
	小計	10,751,359,320	7.70

親投資信託受益証券	日本	56,301,047,824	40.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		999,430,871	0.72
合計(純資産総額)		139,638,502,640	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	7,502,812,662	2.2871	17,159,682,840	2.5345	19,015,878,691	13.62
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	5,018,176,826	2.7330	13,714,677,266	2.7420	13,759,840,856	9.85
日本	投資信託受益証券	FOFs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	8,198,608,933	1.4212	11,652,486,109	1.6391	13,438,339,902	9.62
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	5,309,837,116	1.4801	7,859,089,916	1.6007	8,499,456,271	6.09
日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,449,288,925	1.0762	8,016,939,639	1.1225	8,361,826,818	5.99
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4,843,831,645	1.2104	5,863,424,299	1.3884	6,725,175,855	4.82
日本	投資信託受益証券	FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6,332,387,984	1.0527	6,666,232,744	1.0554	6,683,202,278	4.79
日本	投資信託受益証券	大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)	6,766,485,319	0.955	6,461,993,479	0.9246	6,256,292,325	4.48
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies A, H, JPY Fund-Class D	2,800,232.628	1,864	5,219,633,618	1,914	5,359,645,249	3.84
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	2,611,083,123	1.7145	4,476,702,015	1.6649	4,347,192,291	3.11
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	4,163,100,045	0.9973	4,151,859,675	1.0261	4,271,756,956	3.06
日本	投資信託受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	3,474,285,990	0.9799	3,404,452,841	1.0413	3,617,774,001	2.59

ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	350,874.231	9,922.86	3,481,675,871	10,292.23	3,611,278,286	2.59
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	3,333,878,914	1.0308	3,436,562,384	1.0564	3,521,909,684	2.52
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	2,914,393.7114	1,114.36	3,247,683,776	1,125.84	3,281,151,216	2.35
ケイマン	投資信託受益証券	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	338,814.5055	9,612.68	3,256,917,664	9,464.55	3,206,729,233	2.30
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	8,372,602,313	0.3177	2,659,975,755	0.3316	2,776,354,926	1.99
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 M L P インデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,460,709,899	0.6676	2,310,369,928	0.6721	2,325,943,123	1.67
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	1,583,902,084	1.1952	1,893,155,798	1.4082	2,230,450,914	1.60
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）	1,749,882,971	1.0624	1,859,075,668	1.2179	2,131,182,470	1.53
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	1,857,589,208	0.8316	1,544,771,185	0.9829	1,825,824,432	1.31
日本	親投資信託受益証券	米国株式 L S マザーファンド	1,821,297,185	0.9953	1,812,737,089	1.0008	1,822,754,222	1.31
日本	親投資信託受益証券	F R M シグマ リンク マザーファンド	1,822,576,481	0.8794	1,602,773,758	0.9919	1,807,813,611	1.29
ケイマン	投資証券	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A	189,666	9,504.42	1,802,665,323	9,387.21	1,780,435,785	1.28
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 K I M マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	1,618,940,486	1.0498	1,699,563,722	1.0967	1,775,492,030	1.27
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	1,708,760,310	0.9819	1,677,831,748	1.0266	1,754,213,334	1.26
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	1,739,607,246	0.9783	1,701,857,768	0.9914	1,724,646,623	1.24
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	1,645,979,549	0.9831	1,618,162,494	0.9982	1,643,016,785	1.18
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用）	1,145,221,015	0.9001	1,030,813,435	0.9461	1,083,493,602	0.78

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	51.27
投資証券	7.70
親投資信託受益証券	40.32
合計	99.28

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末（平成25年 7月10日）	13,582,006,627	13,582,006,627	11,293	11,293
第2期計算期間末（平成26年 7月10日）	63,378,377,545	63,378,377,545	11,880	11,880
第3期計算期間末（平成27年 7月10日）	239,900,173,382	239,900,173,382	12,488	12,488
第4期計算期間末（平成28年 7月11日）	202,671,985,249	202,671,985,249	11,145	11,145
第5期計算期間末（平成29年 7月10日）	167,571,594,666	167,571,594,666	12,161	12,161
平成29年 1月末日	188,325,859,595		11,998	
2月末日	184,542,163,812		12,020	
3月末日	178,727,742,429		11,973	
4月末日	176,084,937,175		11,988	
5月末日	172,254,072,801		12,072	
6月末日	168,926,645,791		12,166	
7月末日	164,403,076,850		12,187	
8月末日	159,736,588,982		12,143	
9月末日	157,142,120,595		12,337	
10月末日	152,067,419,953		12,496	
11月末日	146,215,612,747		12,545	
12月末日	143,448,059,865		12,694	

平成30年 1月末日	139,638,502,640		12,771	
------------	-----------------	--	--------	--

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成24年 8月 7日～平成25年 7月10日	0
第2期計算期間	平成25年 7月11日～平成26年 7月10日	0
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	0
第4期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	0
第5期計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 7月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成24年 8月 7日～平成25年 7月10日	12.9
第2期計算期間	平成25年 7月11日～平成26年 7月10日	5.2
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	5.1
第4期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	10.8
第5期計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 7月10日	9.1
第6期中間計算期間	平成29年 7月11日～平成30年 1月10日	5.6

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	平成24年 8月 7日～平成25年 7月10日	14,478,879,831	2,452,422,804	12,026,457,027
第2期計算期間	平成25年 7月11日～平成26年 7月10日	48,255,669,701	6,931,810,820	53,350,315,908
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	171,361,388,735	32,604,317,568	192,107,387,075
第4期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	40,597,680,153	50,860,276,579	181,844,790,649
第5期計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 7月10日	7,631,317,501	51,677,037,389	137,799,070,761
第6期中間計算期間	平成29年 7月11日～平成30年 1月10日	3,110,822,361	28,788,606,473	112,121,286,649

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

## (参考)

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	199,724,601,236	58.76
	イギリス	22,451,998,711	6.61
	ドイツ	13,284,974,439	3.91
	フランス	13,113,815,664	3.86
	カナダ	12,327,598,904	3.63
	スイス	11,818,340,612	3.48
	オーストラリア	8,071,896,777	2.37
	オランダ	6,662,360,891	1.96
	アイルランド	4,626,423,583	1.36
	スペイン	4,467,241,043	1.31
	スウェーデン	3,615,971,982	1.06
	香港	3,062,992,869	0.90
	イタリア	2,705,591,384	0.80
	デンマーク	2,427,045,394	0.71
	シンガポール	2,414,105,509	0.71
	ジャージー	1,640,374,697	0.48
	ベルギー	1,503,139,182	0.44
	バミューダ	1,490,126,025	0.44
	フィンランド	1,273,982,016	0.37
	ケイマン	985,104,181	0.29
	ノルウェー	894,200,490	0.26
	キュラソー	885,646,999	0.26
	イスラエル	620,296,666	0.18
	ルクセンブルク	495,965,787	0.15
	オーストリア	363,002,186	0.11
	ニュージーランド	223,692,306	0.07
	パナマ	212,136,146	0.06
	ポルトガル	205,753,416	0.06
	リベリア	201,325,991	0.06
	英ヴァージン諸島	84,064,779	0.02
パプアニューギニア	80,398,215	0.02	
マン島	47,950,880	0.01	
モーリシャス	13,382,692	0.00	
	小計	321,995,501,652	94.74
投資信託受益証券	オーストラリア	176,695,215	0.05
	香港	58,037,736	0.02
	シンガポール	21,093,184	0.01
	小計	255,826,135	0.08
投資証券	アメリカ	5,533,557,824	1.63
	オーストラリア	697,512,333	0.21

	フランス	437,644,942	0.13
	イギリス	269,823,300	0.08
	香港	172,906,516	0.05
	シンガポール	148,473,512	0.04
	カナダ	65,128,473	0.02
	小計	7,325,046,900	2.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,307,719,888	3.03
合計(純資産総額)		339,884,094,575	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,698,646,339	1.97
	買建	カナダ	449,227,296	0.13
	買建	ドイツ	1,591,349,420	0.47
	買建	イギリス	801,309,920	0.24
	買建	オーストラリア	444,744,140	0.13

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		308,302,100	0.09
	売建		243,935,800	0.07

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
----------	----	-----	----	----	---------------	---------------	--------------	--------------	-----------------

アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	404,059	16,715.58	6,754,081,953	18,164.66	7,339,596,900	2.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	572,164	7,615.29	4,357,200,509	10,089.18	5,772,668,217	1.70
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	31,930	108,308.06	3,458,276,365	156,420.43	4,994,504,579	1.47
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	185,241	16,582.85	3,071,825,514	20,356.78	3,770,911,173	1.11
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	274,639	9,289.57	2,551,280,440	12,522.81	3,439,253,911	1.01
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	209,855	13,809.80	2,898,056,125	15,494.95	3,251,694,768	0.96
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	330,663	8,852.24	2,927,108,996	9,440.79	3,121,721,994	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	24,569	105,643.79	2,595,562,356	126,597.83	3,110,382,211	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,276	108,001.27	2,513,837,619	128,086.08	2,981,331,652	0.88
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	782,115	2,528.27	1,977,405,399	3,468.22	2,712,550,952	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	367,734	5,699.50	2,095,902,912	7,101.81	2,611,577,440	0.77
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	98,775	18,082.90	1,786,139,400	23,325.66	2,303,992,452	0.68
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	243,211	9,643.06	2,345,300,357	9,367.15	2,278,194,697	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	91,849	16,851.57	1,547,799,944	21,954.90	2,016,536,519	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	147,685	11,396.84	1,683,142,374	13,623.77	2,012,026,723	0.59
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	75,819	19,347.21	1,466,886,388	25,745.15	1,951,971,793	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	478,488	4,145.98	1,983,804,979	4,073.09	1,948,928,324	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	366,486	3,942.54	1,444,889,233	5,307.86	1,945,257,883	0.57
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	142,669	10,304.58	1,470,145,379	13,441.00	1,917,614,671	0.56
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	464,230	3,498.68	1,624,195,187	4,112.26	1,909,035,388	0.56
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	198,756	9,498.45	1,887,874,902	9,459.29	1,880,090,743	0.55
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	320,438	4,933.62	1,580,921,408	5,863.78	1,878,978,256	0.55
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,577,916	1,040.83	1,642,353,671	1,171.09	1,847,890,831	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	212,257	6,756.94	1,434,209,279	8,553.06	1,815,448,937	0.53
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	393,079	3,426.88	1,347,036,529	4,596.37	1,806,739,471	0.53
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	174,408	9,152.94	1,596,346,029	10,016.77	1,747,006,008	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	366,191	4,449.51	1,629,370,883	4,606.16	1,686,737,486	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	315,568	4,937.97	1,558,267,873	5,157.73	1,627,615,771	0.48

アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	43,686	20,299.12	886,787,623	36,739.47	1,605,000,526	0.47
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	125,153	7,200.81	901,202,987	12,606.58	1,577,751,958	0.46

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.48
		素材	4.96
		資本財	7.42
		商業・専門サービス	0.96
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.58
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.79
		メディア	2.24
		小売	4.17
		食品・生活必需品小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	5.01
		家庭用品・パーソナル用品	1.89
		ヘルスケア機器・サービス	4.08
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.92
		銀行	9.62
		各種金融	4.56
		保険	4.01
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	10.25
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.80		
電気通信サービス	2.38		
公益事業	2.78		
半導体・半導体製造装置	2.86		
		小計	94.74
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.16
合計			96.97

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	436	アメリカドル	59,329,379.5	6,454,443,196	61,574,100	6,698,646,339	1.97
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	27	カナダドル	5,181,003.5	456,964,509	5,093,280	449,227,296	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	3,554,846	413,855,171	3,552,240	413,551,780	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	242	ユーロ	8,660,659	1,169,881,817	8,719,260	1,177,797,640	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	34	オーストラリアドル	5,090,313	446,878,578	5,066,000	444,744,140	0.13
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	69	イギリスポンド	5,211,993.75	802,490,677	5,204,325	801,309,920	0.24

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,900,000.00	207,157,000	206,682,000	0.06
	カナダドル	買建	150,000.00	13,245,000	13,228,500	0.00
	ユーロ	買建	320,000.00	43,172,480	43,225,600	0.01
	デンマーククローネ	買建	900,000.00	16,314,300	16,335,000	0.00
	香港ドル	買建	1,000,000.00	13,947,000	13,900,000	0.00
	シンガポールドドル	買建	180,000.00	14,963,040	14,931,000	0.00
	アメリカドル	売建	1,550,000.00	168,593,500	168,593,500	0.05
	カナダドル	売建	170,000.00	14,991,110	14,992,300	0.00
	ユーロ	売建	310,000.00	41,872,010	41,874,800	0.01
	イギリスポンド	売建	120,000.00	18,475,680	18,475,200	0.01

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	106,014,810,030	40.64
	フランス	26,387,574,527	10.11
	イタリア	25,458,756,232	9.76
	ドイツ	18,779,040,523	7.20
	イギリス	18,458,346,801	7.08
	スペイン	15,294,485,470	5.86
	ベルギー	6,622,583,213	2.54
	オランダ	5,740,936,141	2.20
	オーストラリア	5,655,436,641	2.17
	カナダ	5,520,835,993	2.12
	オーストリア	4,086,736,202	1.57
	アイルランド	2,070,373,545	0.79
	メキシコ	1,946,054,438	0.75
	ポーランド	1,697,885,697	0.65
	フィンランド	1,600,273,256	0.61
	デンマーク	1,506,508,558	0.58
	南アフリカ	1,463,295,152	0.56
	スウェーデン	1,230,488,292	0.47
	マレーシア	1,200,702,037	0.46
	シンガポール	986,200,622	0.38
ノルウェー	775,668,306	0.30	
スイス	448,091,429	0.17	
	小計	252,945,083,105	96.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,942,607,730	3.04
合計(純資産総額)		260,887,690,835	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,662,221,145	0.64
	買建	ドイツ	2,377,990,870	0.91

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		5,792,803,700	2.22

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	30,000,000	11,266.84	3,380,054,539	11,033.77	3,310,133,215	3.125	2019/5/15	1.27
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	17,150,000	10,892.45	1,868,055,695	10,726.58	1,839,609,344	2.875	2043/5/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,775.06	1,885,636,976	10,455.59	1,829,728,436	1.750	2023/5/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	16,900,000	11,194.48	1,891,867,309	10,801.71	1,825,489,804	2.500	2024/5/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	17,050,000	9,974.95	1,700,729,845	9,895.13	1,687,121,112	2.500	2046/2/15	0.65
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	15,015.86	1,651,744,800	14,688.46	1,615,731,054	3.500	2020/4/25	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,775.18	1,578,565,232	10,582.56	1,550,345,626	1.875	2022/10/31	0.59
アメリカ	国債証券	T 1.875% 12/15/20	12,500,000	10,840.81	1,355,101,839	10,762.95	1,345,369,308	1.875	2020/12/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,463.23	1,375,588,168	11,204.65	1,344,558,094	3.125	2044/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	11,008.20	1,376,025,916	10,706.01	1,338,252,444	2.375	2024/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,214.79	1,348,352,976	9,873.58	1,303,313,193	1.500	2026/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,734.01	1,320,284,075	10,373.70	1,275,966,122	2.000	2025/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,950,000	10,934.11	1,306,626,484	10,568.24	1,262,905,480	2.375	2027/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/19	11,500,000	10,855.28	1,248,357,634	10,762.56	1,237,694,724	1.250	2019/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,262.61	1,238,887,492	10,984.91	1,208,340,340	2.625	2020/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,839.19	1,213,990,177	10,578.21	1,184,759,740	1.750	2022/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,794.16	1,176,564,222	10,682.83	1,164,429,475	2.875	2045/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	10,750,000	10,864.15	1,167,897,040	10,445.18	1,122,856,974	2.250	2027/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,532.89	1,134,414,824	9,362.14	1,114,095,053	2.250	2046/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,759.39	1,129,736,826	10,473.89	1,099,759,235	2.000	2024/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 06/30/19	10,000,000	10,926.10	1,092,610,607	10,819.78	1,081,978,364	1.625	2019/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,982.85	1,114,759,546	10,606.85	1,076,596,021	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/15/19	10,000,000	10,797.95	1,079,795,145	10,735.43	1,073,543,669	0.875	2019/4/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	10,871.38	1,087,138,470	10,687.29	1,068,729,157	1.500	2020/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,760.41	1,092,182,144	10,526.24	1,068,413,673	1.750	2022/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,673.38	1,067,338,690	10,438.31	1,043,831,107	1.250	2021/10/31	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000	15,568.98	1,066,475,375	15,207.44	1,041,709,741	3.250	2021/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,638.07	1,042,531,700	10,445.76	1,023,684,686	1.125	2021/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,856.44	1,036,790,040	10,588.09	1,011,163,394	1.750	2022/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,852.34	1,036,399,086	10,565.73	1,009,027,729	1.750	2022/5/31	0.39

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.96
合計	96.96

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	62	アメリカドル	7,158,279.32	778,749,206	7,119,828.28	774,566,118	0.30
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	38	アメリカドル	4,668,433.33	507,878,862	4,622,343.94	502,864,797	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	24	アメリカドル	3,606,283.5	392,327,582	3,537,000	384,790,230	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	33	ユーロ	3,692,737	498,814,914	3,689,895	498,431,017	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	36	ユーロ	4,722,474	637,911,788	4,697,640	634,557,211	0.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	58	ユーロ	9,320,752	1,259,047,180	9,216,780	1,245,002,642	0.48

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	24,320,000.00	2,681,589,435	2,643,340,800	1.01
	カナダドル	買建	2,920,000.00	258,847,248	257,339,600	0.10
	ユーロ	買建	18,150,000.00	2,450,004,275	2,451,883,500	0.94
	イギリスポンド	買建	2,860,000.00	436,398,209	440,239,800	0.17

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	87,605,102,000	97.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,109,501,568	2.35
合計(純資産総額)		89,714,603,568	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	2,058,804,000	2.29

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,676	536,629.2	5,729,053,339	585,000	6,245,460,000	6.96
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,421	519,635.22	5,415,118,627	561,000	5,846,181,000	6.52
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,629	137,825.64	4,359,287,167	152,000	4,807,608,000	5.36
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,209	199,292.71	4,226,799,086	217,500	4,612,957,500	5.14
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,316	160,083.25	3,892,584,307	172,500	4,194,510,000	4.68
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,271	153,430.31	3,263,616,124	168,100	3,575,655,100	3.99
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	13,867	233,008.42	3,231,127,760	250,500	3,473,683,500	3.87
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	11,339	258,352.07	2,929,454,121	268,200	3,041,119,800	3.39
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,207	263,321.12	2,687,718,671	280,000	2,857,960,000	3.19
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,961	359,727.91	2,504,065,981	386,000	2,686,946,000	2.99
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,820	75,168.42	2,391,859,124	80,900	2,574,238,000	2.87
日本	投資証券	G L P投資法人	19,302	111,794.44	2,157,856,280	126,600	2,443,633,200	2.72
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	4,988	445,915.62	2,224,227,112	485,500	2,421,674,000	2.70
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,223	591,465.46	1,906,293,177	689,000	2,220,647,000	2.48

日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,664	437,770.22	1,603,990,086	494,500	1,811,848,000	2.02
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,750	439,706.48	1,648,899,300	456,000	1,710,000,000	1.91
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,843	131,333.93	1,555,387,732	137,100	1,623,675,300	1.81
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	30,237	46,646.94	1,410,463,524	50,600	1,529,992,200	1.71
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,344	203,522.28	1,494,667,624	205,900	1,512,129,600	1.69
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,379	548,961.68	1,305,979,845	630,000	1,498,770,000	1.67
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	11,980	116,152.39	1,391,505,632	124,800	1,495,104,000	1.67
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	9,873	130,684.01	1,290,243,230	139,000	1,372,347,000	1.53
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	7,879	159,500.26	1,256,702,548	162,900	1,283,489,100	1.43
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,487	158,084.01	1,183,574,982	171,200	1,281,774,400	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,469	113,630.06	1,189,593,098	119,500	1,251,045,500	1.39
日本	投資証券	プレミアム投資法人	9,958	99,608.14	991,897,858	116,400	1,159,111,200	1.29
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	12,401	78,402.72	972,272,130	86,200	1,068,966,200	1.19
日本	投資証券	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	8,359	108,442.68	906,472,362	125,600	1,049,890,400	1.17
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	6,916	123,960.91	857,313,653	148,500	1,027,026,000	1.14
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,392	131,816.31	974,386,163	138,900	1,026,748,800	1.14

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.65
合計	97.65

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,188	円	1,946,894,400	2,058,804,000	2.29

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### グローバルREITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	40,654,459,500	68.50
	オーストラリア	4,865,932,484	8.20
	イギリス	3,520,512,779	5.93
	フランス	2,989,425,938	5.04
	シンガポール	2,266,513,276	3.82
	香港	1,225,421,898	2.06
	カナダ	1,175,304,743	1.98
	スペイン	688,361,179	1.16
	ベルギー	461,118,760	0.78
	オランダ	304,084,586	0.51
	ニュージーランド	277,005,414	0.47
	アイルランド	171,536,606	0.29
	ドイツ	154,343,225	0.26
	イタリア	67,497,793	0.11
	ガーンジー	44,618,966	0.08
	イスラエル	35,692,999	0.06
	マン島	32,226,537	0.05
	小計	58,934,056,683	99.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		416,539,942	0.70
合計(純資産総額)		59,350,596,625	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		155,570,200	0.26

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	150,260	17,552.21	2,637,395,860	17,690.34	2,658,150,774	4.48

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	256,310	7,220.21	1,850,612,238	6,842.89	1,753,901,392	2.96
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	72,140	22,953.71	1,655,880,986	21,061.74	1,519,394,212	2.56
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	47,840	29,664.66	1,419,157,643	27,623.85	1,321,525,462	2.23
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,000	20,337.92	1,362,640,982	18,153.78	1,216,303,749	2.05
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	176,340	7,585.81	1,337,682,449	6,589.41	1,161,976,612	1.96
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	99,170	13,258.70	1,314,866,023	11,592.66	1,149,644,330	1.94
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	178,760	7,405.04	1,323,725,997	6,367.47	1,138,250,492	1.92
香港	投資証券	LINK REIT	1,066,000	962.00	1,025,492,882	963.26	1,026,843,155	1.73
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	172,050	7,023.36	1,208,369,189	5,945.37	1,022,901,511	1.72
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	74,560	13,704.05	1,021,774,610	12,991.70	968,661,286	1.63
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,589,050	363.28	940,556,080	354.67	918,262,506	1.55
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	360,300	2,178.29	784,839,440	2,266.09	816,474,281	1.38
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	32,150	27,853.02	895,474,763	24,668.13	793,080,460	1.34
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	134,780	6,115.61	824,263,164	5,707.12	769,206,092	1.30
アメリカ	投資証券	GGP INC	297,710	2,396.38	713,428,882	2,514.13	748,483,696	1.26
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	922,690	712.80	657,697,898	795.37	733,886,773	1.24
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	48,470	13,717.33	664,879,418	13,680.34	663,086,201	1.12
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	84,160	8,175.74	688,070,787	7,637.05	642,734,801	1.08
アメリカ	投資証券	HCP INC	227,810	2,928.39	667,117,490	2,565.26	584,393,749	0.98
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	365,340	1,463.74	534,763,830	1,532.30	559,813,931	0.94
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	61,590	9,287.67	572,027,915	9,019.77	555,528,182	0.94
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	53,958	11,489.31	619,940,292	10,113.11	545,683,643	0.92
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	773,010	764.16	590,703,823	689.15	532,721,001	0.90
アメリカ	投資証券	UDR INC	131,050	4,320.43	566,193,348	3,904.47	511,681,200	0.86
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	47,470	10,743.88	510,012,272	10,682.09	507,078,817	0.85
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	487,310	924.79	450,659,600	1,034.37	504,059,069	0.85
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	135,850	4,389.09	596,258,502	3,691.24	501,455,592	0.84
フランス	投資証券	KLEPIERRE	98,690	4,702.81	464,120,339	5,041.18	497,514,607	0.84
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	174,610	3,135.82	547,546,403	2,795.90	488,192,623	0.82

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.30
合計	99.30

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,120,000.00	122,004,400	121,829,400	0.21
	ユーロ	買建	170,000.00	22,946,370	22,963,600	0.04
	イギリスポンド	買建	70,000.00	10,777,480	10,777,200	0.02

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	10,412,900,124	47.23
	ルクセンブルク	7,912,166,152	35.89
	イギリス	2,289,533,417	10.39
	アメリカ	410,410,275	1.86
	ジャージー	397,736,240	1.80
	小計	21,422,746,208	97.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		623,255,854	2.83
合計(純資産総額)		22,046,002,062	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 005 11/15/18	93,000,000	10,879.00	10,117,470,000	11,196.66	10,412,900,124	0.000	2018/11/15	47.23
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 007 07/31/18	19,000,000	11,078.54	2,104,923,315	11,335.91	2,153,824,420	0.000	2018/7/31	9.77
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 008 09/28/18	19,000,000	11,056.78	2,100,789,295	11,298.92	2,146,796,586	0.000	2018/9/28	9.74
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 006 05/31/18	16,000,000	11,037.42	1,765,988,070	11,628.56	1,860,570,096	0.000	2018/5/31	8.44
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 005 03/29/18	15,000,000	11,058.50	1,658,775,525	11,673.16	1,750,975,050	0.000	2018/3/29	7.94
イギリス	社債券	CS USD COM 014 10/31/18	12,000,000	10,922.51	1,310,701,920	11,452.32	1,374,278,796	0.000	2018/10/31	6.23

イギリス	社債券	BAR USD COM 035 11/30/18	8,000,000	10,748.45	859,876,159	11,440.68	915,254,621	0.000	2018/11/30	4.15
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	2,498.90	374,835,945	2,736.06	410,410,275	0.000	2036/6/12	1.86
ジャー ジー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	919.27	367,710,200	994.34	397,736,240	0.000	9999/99/99	1.80

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(注3) 償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
社債券	97.17
合計	97.17

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 投資状況

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	アメリカ	13,176,820,495	96.65
現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		457,371,678	3.35
合計 (純資産総額)		13,634,192,173	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		25,019,400	0.18
	売建		13,314,841,620	97.66

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益 証券	ISHARES GOLD TRUST	9,440,500	1,345.84	12,705,451,919	1,395.77	13,176,820,495	96.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	96.65
合計	96.65

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	230,000.00	25,018,687	25,019,400	0.18
	アメリカドル	売建	122,446,467.00	13,773,661,341	13,314,841,620	97.66

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

### F R Mシグマ リンク マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

社債券	ケイマン	14,570,073,750	97.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		354,995,844	2.38
合計(純資産総額)		14,925,069,594	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
ケイマン	社債券	SIGNUM SIGMA2 0% 05/12/25	14,675,000,000	93.87	13,776,148,250	99.28	14,570,073,750	0.000	2025/5/12	97.62

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.62
合計	97.62

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 米国株式LSマザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	13,096,572,096	92.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,077,647,528	7.60
合計(純資産総額)		14,174,219,624	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		13,027,200,000	91.91

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/22	119,000,000	10,879.00	12,946,010,000	11,005.52	13,096,572,096	0.000	2022/10/18	92.40

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
社債券	92.40
合計	92.40

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（％）
為替予約取引	アメリカドル	売建	120,000,000.00	13,038,540,000	13,027,200,000	91.91

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 参考情報

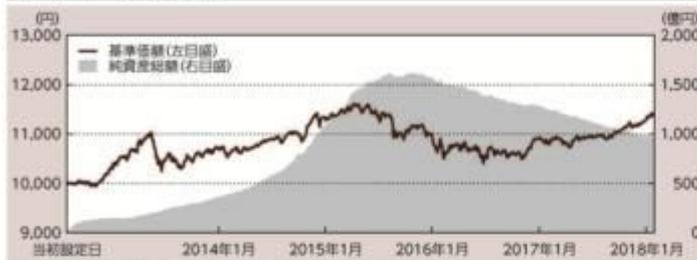
## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2012年8月7日  
作成基準日：2018年1月31日

## コア投資戦略ファンド(安定型)

## 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

## 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額0円

決算期	2013年7月	2014年7月	2015年7月	2016年7月	2017年7月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

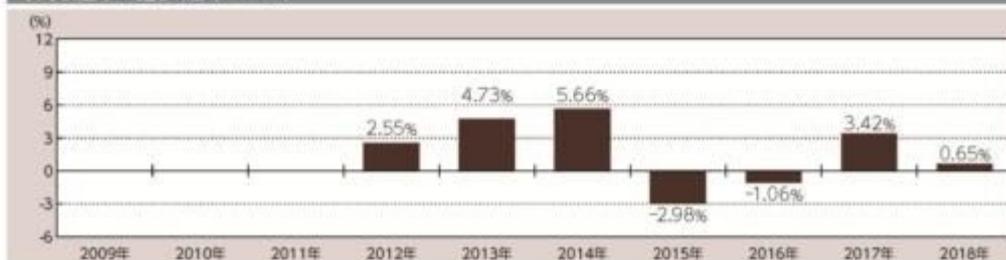
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
FOFs 用世界/ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	10.5%
外国株式インデックス マザーファンド	8.6%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド:為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	8.2%
FOFs 用JPX 日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	5.7%
HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス	5.3%
外国債券インデックス マザーファンド	5.2%
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	5.2%
J-REIT インデックス マザーファンド	5.0%
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D	5.0%
FOFs 用FRM ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	3.3%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2012年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2018年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

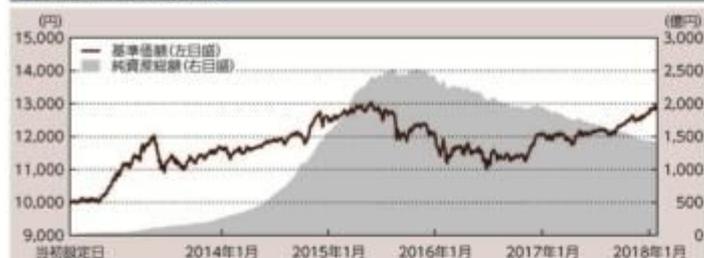
最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

コアラップ

当初設定日：2012年8月7日  
作成基準日：2018年1月31日

## コア投資戦略ファンド(成長型)

## 基準価額・純資産の推移



基準価額	12,771円
純資産総額	1,396.39億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

## 分配の推移(1万口当たり、税引前)

## 設定来分配金合計額0円

決算期	2013年7月	2014年7月	2015年7月	2016年7月	2017年7月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

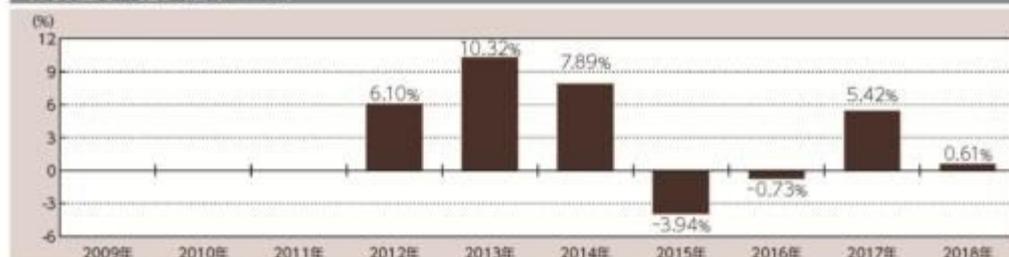
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	13.6%
外国債券インデックス マザーファンド	9.9%
FOFs 用JPX 日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	9.6%
J-REIT インデックス マザーファンド	6.1%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6.0%
FOFs 用国内株式エンハンスド運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4.8%
FOFs 用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	4.8%
大和住銀/ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)	4.5%
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D <sup>1</sup> ほか	3.8%
グローバルREIT インデックス マザーファンド	3.1%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2012年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2016年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## &lt; 申込手続 &gt;

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

## &lt; 申込コース &gt;

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」( )の2つの申込方法があ

ります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### < 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

ただし、確定拠出年金によるお申込みは1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと

引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### <スイッチング>

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。上記受付不可日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

#### <一部解約の受付>

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### <一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

#### <解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

#### <一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠ることとなります。

#### <受付不可日>

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引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を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、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。ただし、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、当該受益権の一部解約の価額は、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「解約価額」の規定に準じて計算された価額とします。

#### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基つき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### <その他>

一部解約の実行の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係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係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又は記録が行われます。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

## （１）【資産の評価】

### < 基準価額の算出方法 >

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及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投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「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。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

### < 基準価額の算出頻度 >

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。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法  
原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

・公社債等（仕組債を含みます。）

計算日（ ）における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （２）【保管】

該当事項はありません。

## （３）【信託期間】

無期限とします。（平成24年 8月 7日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## （４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は平成24年8月7日から平成25年7月10日までとします。

なお、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されるものとします。ただし、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】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（１）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還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、この投資信託契約に係る知っ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發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）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、知っている受益者が議決権を行使

しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の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。

上記からまでの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又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、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記からまでの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

#### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

##### (1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

##### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（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。）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、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及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、この投資信託約款に係る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發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の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。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又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。

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、当該併合に係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、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### <受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

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。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社

の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 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。

#### < 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）

に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

#### (2)償還金に対する請求権

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、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又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係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

#### (3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

#### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又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【財務諸表】

## 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

(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)」並びに同規則第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)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成28年 7月12日から平成29年 7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (平成28年 7月11日現在)	第5期 (平成29年 7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,837,508,224	1,378,771,311
投資信託受益証券	88,829,614,733	72,173,129,497
投資証券	16,977,363,124	13,474,681,998
親投資信託受益証券	30,543,760,259	24,293,992,005
未収入金	701,420,808	780,324,203
流動資産合計	138,889,667,148	112,100,899,014
資産合計	138,889,667,148	112,100,899,014
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	447,817,331	406,285,143
未払受託者報酬	39,608,618	31,723,958
未払委託者報酬	1,053,589,245	843,857,215
未払利息	3,928	2,639
その他未払費用	1,157,954	1,037,931
流動負債合計	1,542,177,076	1,282,906,886
負債合計	1,542,177,076	1,282,906,886
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	130,647,894,668	101,436,441,647
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,699,595,404	9,381,550,481
(分配準備積立金)	1,698,556,772	1,609,866,333
元本等合計	137,347,490,072	110,817,992,128
純資産合計	137,347,490,072	110,817,992,128
負債純資産合計	138,889,667,148	112,100,899,014

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日	自	平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日
営業収益				
受取配当金		-		36,910,366
受取利息		649,235		2,052
有価証券売買等損益		7,952,925,470		6,808,941,143
その他収益		-		3,237
営業収益合計		7,952,276,235		6,845,856,798
営業費用				
支払利息		257,244		1,195,595
受託者報酬		82,746,402		67,698,502
委託者報酬		2,201,054,299		1,800,780,062
その他費用		2,388,066		2,151,209
営業費用合計		2,286,446,011		1,871,825,368
営業利益又は営業損失（ ）		10,238,722,246		4,974,031,430
経常利益又は経常損失（ ）		10,238,722,246		4,974,031,430
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,238,722,246		4,974,031,430
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（ ）		1,348,906,252		977,768,120
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		17,066,203,055		6,699,595,404
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,487,252,221		696,367,209
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,487,252,221		696,367,209
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,964,043,878		2,010,675,442
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,964,043,878		2,010,675,442
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,699,595,404		9,381,550,481

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
3. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は平成28年 7月12日から平成29年 7月10日までとなっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	第4期 (平成28年 7月11日現在)	第5期 (平成29年 7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	130,647,894,668口	101,436,441,647口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0513円 (10,513円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0925円 (10,925円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日			第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	391,805,122円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	5,001,038,632円	収益調整金額	C	7,771,684,148円
分配準備積立金額	D	1,698,556,772円	分配準備積立金額	D	1,218,061,211円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,699,595,404円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,381,550,481円
当ファンドの期末残存口数	F	130,647,894,668口	当ファンドの期末残存口数	F	101,436,441,647口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	512円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	924円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、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、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (平成29年 7月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 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合理的に算定された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。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	第4期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日	第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	137,430,639,608円	130,647,894,668円
期中追加設定元本額	33,825,686,496円	9,405,671,580円
期中一部解約元本額	40,608,431,436円	38,617,124,601円

( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	第4期 (平成28年 7月11日現在)	第5期 (平成29年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	4,502,342,366	2,353,903,125
投資証券	850,371,547	291,726,814
親投資信託受益証券	2,249,285,073	2,220,980,415
合計	7,601,998,986	4,866,610,354

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	2,090,134,453	2,515,894,841	
	F O F s用MLPインデックスファンド(適格 機関投資家専用)	1,588,948,047	1,060,781,716	
	TCAファンド(適格機関投資家専用)	4,928,278,893	4,576,399,780	
	大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド (適格機関投資家専用)	2,820,570,976	2,693,645,282	
	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファン ド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6,378,234,581	6,848,310,469	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資 家専用)	2,314,593,764	2,272,699,616	
	F0Fs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為 替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	11,060,568,689	11,643,460,658	
	F0Fs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投 資家専用)	496,458,657	446,862,437	
	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格 機関投資家専用)	3,562,987,304	5,039,132,944	

	F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用)	2,890,682,332	2,827,954,525
	F0Fs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用)	1,007,310,438	1,070,166,609
	F O F s 用 K I M マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,241,840,333	2,353,483,981
	F0Fs用日本株配当オープン(適格機関投資家専用)	695,289,694	827,672,851
	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	4,516,758,660	4,655,874,826
	F0Fs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	7,025,790,031	6,884,571,651
	F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,674,652,066	2,224,240,658
	F O F s 用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	2,731,792,793	2,685,625,494
	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	5,215,135.0496	5,811,570,749
	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	596,555.343	5,734,780,410
投資信託受益証券合計		59,030,703,401.3926	72,173,129,497
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund- A, H, JPY Class D	3,654,926.631	6,812,783,240
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	459,273.274	4,557,304,399
	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A	221,433	2,104,594,359
投資証券合計		4,335,632.905	13,474,681,998
親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	2,184,074,061	3,231,992,795
	グローバル R E I T インデックス マザーファンド	1,288,884,039	2,209,791,684
	外国株式インデックス マザーファンド	4,253,528,400	9,728,244,803
	外国債券インデックス マザーファンド	2,151,786,617	5,880,832,824
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	3,442,221,784	1,093,593,860
	F R M シグマ リンク マザーファンド	2,444,321,173	2,149,536,039
親投資信託受益証券合計		15,764,816,074	24,293,992,005
合計			109,941,803,500

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 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。

## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

(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)」並びに同規則第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)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成28年 7月12日から平成29年 7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (平成28年 7月11日現在)	第5期 (平成29年 7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,757,073,852	1,944,154,011
投資信託受益証券	117,994,761,006	91,515,541,944
投資証券	19,057,074,685	15,161,685,425
親投資信託受益証券	64,432,554,039	59,543,261,108
未収入金	757,346,836	1,441,101,125
流動資産合計	204,998,810,418	169,605,743,613
資産合計	204,998,810,418	169,605,743,613
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	677,981,079	719,274,609
未払受託者報酬	59,690,778	47,596,853
未払委託者報酬	1,587,774,635	1,266,076,089
未払利息	5,894	3,722
その他未払費用	1,372,783	1,197,674
流動負債合計	2,326,825,169	2,034,148,947
負債合計	2,326,825,169	2,034,148,947
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	181,844,790,649	137,799,070,761
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	20,827,194,600	29,772,523,905
(分配準備積立金)	2,526,489,264	2,925,964,690
元本等合計	202,671,985,249	167,571,594,666
純資産合計	202,671,985,249	167,571,594,666
負債純資産合計	204,998,810,418	169,605,743,613

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日	自	平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日
営業収益				
受取配当金		-		23,683,080
受取利息		988,370		2,803
有価証券売買等損益		22,743,579,499		19,709,068,029
その他収益		-		1,921
営業収益合計		22,742,591,129		19,732,755,833
営業費用				
支払利息		346,863		1,732,589
受託者報酬		126,721,174		101,464,338
委託者報酬		3,370,783,058		2,698,951,221
その他費用		2,860,269		2,498,866
営業費用合計		3,500,711,364		2,804,647,014
営業利益又は営業損失（ ）		26,243,302,493		16,928,108,819
経常利益又は経常損失（ ）		26,243,302,493		16,928,108,819
当期純利益又は当期純損失（ ）		26,243,302,493		16,928,108,819
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（ ）		2,841,521,018		3,361,054,739
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		47,792,786,307		20,827,194,600
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,971,802,043		1,355,986,286
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,971,802,043		1,355,986,286
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,535,612,275		5,977,711,061
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,535,612,275		5,977,711,061
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,827,194,600		29,772,523,905

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
3. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は平成28年 7月12日から平成29年 7月10日までとなっております。</p>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

	第4期 (平成28年 7月11日現在)	第5期 (平成29年 7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	181,844,790,649口	137,799,070,761口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.1145円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (11,145円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.2161円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,161円)</p>

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第4期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日			第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	1,100,974,498円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	18,300,705,336円	収益調整金額	C	26,846,559,215円
分配準備積立金額	D	2,526,489,264円	分配準備積立金額	D	1,824,990,192円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	20,827,194,600円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,772,523,905円
当ファンドの期末残存口数	F	181,844,790,649口	当ファンドの期末残存口数	F	137,799,070,761口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,145円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,160円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、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、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (平成29年 7月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.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合理的に算定された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。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	第4期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日	第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	192,107,387,075円	181,844,790,649円
期中追加設定元本額	40,597,680,153円	7,631,317,501円
期中一部解約元本額	50,860,276,579円	51,677,037,389円

( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	第4期 (平成28年 7月11日現在)	第5期 (平成29年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	13,790,706,216	7,526,317,332
投資証券	960,563,053	333,108,187
親投資信託受益証券	6,584,892,626	6,259,924,274
合計	21,336,161,895	14,119,349,793

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	5,909,758,614	7,113,576,443	
	F O F s用MLPインデックスファンド(適格 機関投資家専用)	3,987,681,899	2,662,176,435	
	TCAファンド(適格機関投資家専用)	5,726,967,669	5,318,062,177	
	大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド (適格機関投資家専用)	8,177,520,319	7,809,531,904	
	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファン ド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,327,632,369	7,867,678,874	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資 家専用)	2,799,170,310	2,748,505,327	
	F0Fs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為 替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,576,342,581	7,975,615,835	
	F0Fs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投 資家専用)	1,445,963,015	1,301,511,309	
	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格 機関投資家専用)	10,042,387,516	14,202,948,663	

	F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用)	1,899,222,246	1,858,009,123
	F0Fs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用)	2,430,946,971	2,582,638,061
	F O F s 用 K I M マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,627,580,486	2,758,433,994
	F0Fs用日本株配当オープン(適格機関投資家専用)	1,990,736,361	2,369,772,564
	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	5,159,063,914	5,317,963,082
	F0Fs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	7,982,096,990	7,821,656,840
	F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	3,085,196,208	2,565,649,166
	F O F s 用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	1,722,469,549	1,693,359,813
	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	3,435,610.9913	3,828,529,108
	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	386,961.6476	3,719,923,226
投資信託受益証券合計		79,894,559,589.6389	91,515,541,944
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund- A, H, JPY Class D	4,049,347.366	7,547,983,490
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	534,744.772	5,306,197,508
	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A	242,782	2,307,504,427
投資証券合計		4,826,874.138	15,161,685,425
親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	5,464,002,574	8,085,631,009
	グローバル R E I T インデックス マザーファンド	3,315,377,612	5,684,214,915
	外国株式インデックス マザーファンド	10,102,643,363	23,105,755,635
	外国債券インデックス マザーファンド	6,184,038,564	16,900,977,395
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	10,570,659,975	3,358,298,674
	F R M シグマ リンク マザーファンド	2,738,666,682	2,408,383,480
親投資信託受益証券合計		38,375,388,770	59,543,261,108
合計			166,220,488,477

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 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）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

	平成29年 7月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	9,651,861,003
コール・ローン	682,675,520
株式	296,543,274,887
投資信託受益証券	274,872,337
投資証券	7,558,262,683
派生商品評価勘定	1,318,776
未収入金	4,194,531
未収配当金	447,646,733
前払金	48,280,717
差入委託証拠金	1,386,264,301
流動資産合計	316,598,651,488
資産合計	316,598,651,488
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	54,342,533
未払解約金	1,252,222,599
未払利息	1,306
その他未払費用	638
流動負債合計	1,306,567,076
負債合計	1,306,567,076
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	137,857,037,299
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	177,435,047,113
元本等合計	315,292,084,412
純資産合計	315,292,084,412
負債純資産合計	316,598,651,488

注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p>

	平成29年 7月10日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成29年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,857,037,299口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2871円 (1万口当たり純資産額) (22,871円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年 7月10日現在
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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、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、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

	平成29年 7月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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合理的に算定された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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	141,124,176,372円
期中追加設定元本額	28,172,892,346円
期中一部解約元本額	31,440,031,419円
期末元本額	137,857,037,299円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,485,159,259円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,233,160円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,396,432,607円
世界経済インデックスファンド	5,574,982,707円
外国株式インデックス・オープン	894,818,466円
D C マイセレクション 2 5	914,673,532円
D C マイセレクション 5 0	4,614,215,028円
D C マイセレクション 7 5	5,007,620,000円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,977,959,374円
D C マイセレクション S 2 5	371,206,517円
D C マイセレクション S 5 0	1,819,597,444円
D C マイセレクション S 7 5	1,393,025,650円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	138,281,219円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	186,395,491円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	101,853,404円
D C 世界経済インデックスファンド	4,601,564,111円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,695,719,821円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	25,259,945円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,817,085円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	96,645,106円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	119,024,916円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	445,749,948円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	66,817,600円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	525,212,044円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,119,880,354円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	548,791,355円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,558,738,090円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,624,696,216円

区分	平成29年 7月10日現在
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	349,129,584円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	529,608,966円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	550,202,258円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	172,825,776円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,621,592,406円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,858,144,447円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,406,959,051円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,253,528,400円
コア投資戦略ファンド（成長型）	10,102,643,363円
分散投資コア戦略ファンドA	1,835,348,819円
分散投資コア戦略ファンドS	3,509,993,043円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	421,253,098円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	558,543,150円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,685,667,722円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	781,297,172円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	47,683,723円
SMT インデックスバランス・オープン	336,697,213円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	3,131,254,006円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,184,605,488円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	2,184,689,165円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,331,165,639
投資信託受益証券	4,387,585
投資証券	119,886,996
合計	1,455,440,220

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成29年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,473,054,658	-	6,424,773,941	48,280,717

合計	6,473,054,658	-	6,424,773,941	48,280,717
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(平成29年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	5,014,175,960	-	5,018,919,000	4,743,040
	アメリカドル	3,273,135,000	-	3,276,138,000	3,003,000
	カナダドル	201,509,000	-	201,985,200	476,200
	ユーロ	652,762,860	-	653,302,800	539,940
	イギリスポンド	359,130,640	-	359,314,400	183,760
	スイスフラン	169,220,760	-	169,340,600	119,840
	スウェーデンクローナ	70,219,600	-	70,408,000	188,400
	デンマーククローネ	47,241,900	-	47,250,000	8,100
	オーストラリアドル	142,149,600	-	142,387,000	237,400
	香港ドル	65,763,000	-	65,745,000	18,000
	シンガポールドル	33,043,600	-	33,048,000	4,400
合計		5,014,175,960	-	5,018,919,000	4,743,040

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,380	43.36	1,924,316.80	

ANTERO RESOURCES CORP	12,683	20.66	262,030.78
APACHE CORP	29,810	45.11	1,344,729.10
BAKER HUGHES A GE CO	31,676	37.91	1,200,837.16
CABOT OIL & GAS CORP	39,315	24.26	953,781.90
CHENIERE ENERGY INC	15,691	47.24	741,242.84
CHEVRON CORP	150,419	103.49	15,566,862.31
CIMAREX ENERGY CO	7,599	91.60	696,068.40
CONCHO RESOURCES INC	11,793	120.75	1,424,004.75
CONOCOPHILLIPS	99,645	43.00	4,284,735.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	30.03	229,639.41
CORE LABORATORIES N.V.	3,346	102.68	343,567.28
DEVON ENERGY CORPORATION	37,019	29.54	1,093,541.26
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,511	86.09	646,621.99
EOG RESOURCES INC	46,361	88.44	4,100,166.84
EQT CORPORATION	13,878	58.74	815,193.72
EXXON MOBIL	329,749	80.22	26,452,464.78
HALLIBURTON CO	69,072	41.78	2,885,828.16
HELMERICH & PAYNE	8,315	52.88	439,697.20
HESS CORP	23,898	41.79	998,697.42
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	27.09	337,216.32
KINDER MORGAN INC	158,279	19.17	3,034,208.43
MARATHON OIL CORP	71,172	11.47	816,342.84
MARATHON PETROLEUM CORP	41,702	54.07	2,254,827.14
MURPHY OIL CORP	13,898	24.47	340,084.06
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	32.01	970,255.11
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	26.09	419,344.57
NOBLE ENERGY INC	34,708	27.00	937,116.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,334	58.68	3,599,079.12
ONEOK INC	17,740	51.69	916,980.60
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16,134	26.90	434,004.60
PHILLIPS 66	34,624	82.60	2,859,942.40
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	156.03	2,098,603.50
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	26.01	257,238.90
RANGE RESOURCES CORP	16,160	21.33	344,692.80
SCHLUMBERGER	110,536	65.08	7,193,682.88
TARGA RESOURCES CORP	16,467	43.61	718,125.87
TECHNIPFMC PLC	36,005	26.74	962,773.70
TESORO CORP	11,677	96.26	1,124,028.02
VALERO ENERGY CORP	35,848	68.18	2,444,116.64
WILLIAMS COS	64,287	30.41	1,954,967.67
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,047	144.01	2,454,938.47
ALBEMARLE CORP	8,647	109.99	951,083.53

AVERY DENNISON CORP	7,457	90.78	676,946.46
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	32.56	573,251.36
BALL CORP	27,142	42.30	1,148,106.60
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	96.14	1,062,635.42
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,559	27.89	573,390.51
CROWN HOLDINGS INC	12,217	59.81	730,698.77
DOW CHEMICAL CO	95,784	63.89	6,119,639.76
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	68,215	82.03	5,595,676.45
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	83.90	994,886.20
ECOLAB INC	20,812	132.62	2,760,087.44
FMC CORP	10,402	74.59	775,885.18
FREEMONT-MCMORAN INC	103,175	11.90	1,227,782.50
INT'L PAPER CO	30,605	56.37	1,725,203.85
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	131.88	800,511.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,758	83.93	2,245,798.94
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	227.90	1,136,993.10
MONSANTO CO	34,984	118.00	4,128,112.00
MOSAIC CO/THE	27,677	22.60	625,500.20
NEWMONT MINING CORP	42,952	32.03	1,375,752.56
NUCOR CORP	24,915	58.20	1,450,053.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,070	110.92	895,124.40
PPG INDUSTRIES INC	21,022	111.00	2,333,442.00
PRAXAIR INC	22,656	133.06	3,014,607.36
SEALED AIR CORP	14,689	45.32	665,705.48
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,361	352.03	2,239,262.83
STEEL DYNAMICS INC	18,273	35.92	656,366.16
VULCAN MATERIALS CO	10,740	128.17	1,376,545.80
WESTROCK CO	20,913	57.31	1,198,524.03
WR GRACE & CO	5,635	71.04	400,310.40
3 M COMPANY	47,167	209.59	9,885,731.53
ACUITY BRANDS INC	3,505	198.53	695,847.65
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	46.83	530,583.90
AGCO CORP	5,969	68.38	408,160.22
ALLEGION PLC	7,168	81.22	582,184.96
AMETEK INC	18,866	61.56	1,161,390.96
ARCONIC INC	30,141	23.13	697,161.33
BOEING CO	46,016	202.37	9,312,257.92
CATERPILLAR	46,823	106.92	5,006,315.16
CUMMINS INC	12,985	164.70	2,138,629.50
DEERE&CO	21,085	126.64	2,670,204.40
DOVER CORP	13,056	83.17	1,085,867.52
EATON CORP	35,279	79.36	2,799,741.44

EMERSON ELECTRIC CO	50,927	59.47	3,028,628.69
FASTENAL CO	23,228	43.89	1,019,476.92
FLOWSERVE CORP	10,826	46.31	501,352.06
FLUOR CORP	11,267	45.34	510,845.78
FORTIVE CORP	24,294	63.85	1,551,171.90
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	65.93	844,563.30
GENERAL DYNAMICS CORP	20,743	201.26	4,174,736.18
GENERAL ELECTRIC CO	691,424	26.15	18,080,737.60
GRAINGER (WW) INC	4,749	179.26	851,305.74
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	30.42	463,174.92
HONEYWELL INTL INC	57,161	134.12	7,666,433.32
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,963	192.90	764,462.70
IDEX CORP	5,756	114.13	656,932.28
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	146.06	3,582,559.68
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	93.25	1,888,219.25
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	54.82	531,370.26
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	64.95	1,078,170.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	42.67	704,055.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	43.16	3,214,902.08
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	171.51	1,049,126.67
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	186.22	537,244.70
LOCKHEED MARTIN CORP	20,627	285.20	5,882,820.40
MASCO CORP	24,547	38.43	943,341.21
MIDDLEBY CORP	4,364	120.35	525,207.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,276	261.99	3,478,179.24
PACCAR INC	27,548	67.62	1,862,795.76
PARKER HANNIFIN CORP	10,942	160.90	1,760,567.80
PENTAIR PLC	13,583	66.63	905,035.29
RAYTHEON COMPANY	23,550	165.87	3,906,238.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,405	164.43	1,710,894.15
ROCKWELL COLLIN	13,112	106.36	1,394,592.32
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	234.45	1,899,045.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	44.00	608,432.00
SMITH (A.O.) CORP	12,146	57.25	695,358.50
SNAP-ON INC	4,900	155.99	764,351.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	144.91	1,741,093.65
TEXTRON	21,877	48.06	1,051,408.62
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	266.66	1,085,839.52
UNITED RENTALS INC	6,446	112.55	725,497.30
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,507	122.61	7,418,763.27
WABCO HOLDINGS INC	3,841	129.21	496,295.61
WABTEC CORP	7,158	91.00	651,378.00

XYLEM INC	13,941	54.95	766,057.95
CINTAS CORP	7,034	126.13	887,198.42
EQUIFAX INC	9,276	138.37	1,283,520.12
IHS MARKIT LTD	28,842	44.27	1,276,835.34
MANPOWER GROUP	5,123	114.95	588,888.85
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,941	37.50	1,122,787.50
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	64.09	1,183,165.49
ROBERT HALF INTL INC	11,558	49.17	568,306.86
ROLLINS INC	7,031	40.92	287,708.52
STERICYCLE INC	6,767	76.48	517,540.16
VERISK ANALYTICS INC	12,301	83.65	1,028,978.65
WASTE CONNECTIONS INC	21,610	65.05	1,405,730.50
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	73.99	2,584,544.69
AMERCO	602	361.57	217,665.14
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	53.03	526,057.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	67.97	778,120.56
CSX CORP	72,941	54.85	4,000,813.85
DELTA AIR LINES INC	15,095	55.46	837,168.70
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,281	56.93	869,947.33
FEDEX CORP	20,171	218.51	4,407,565.21
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	93.65	668,099.10
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	104.34	912,244.62
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	5,809	77.59	450,720.31
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	122.34	2,789,229.66
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,214	64.24	848,867.36
UNION PACIFIC CORP	64,308	108.35	6,967,771.80
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	78.94	473,876.82
UNITED PARCEL SERVICE B	54,406	110.36	6,004,246.16
AUTOLIV INC	7,451	114.20	850,904.20
BORGWARNER INC	18,147	44.09	800,101.23
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,954	89.12	1,867,420.48
FORD MOTOR COMPANY	295,438	11.26	3,326,631.88
GENERAL MOTORS CO	105,846	34.94	3,698,259.24
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	35.47	767,109.69
HARLEY-DAVIDSON	14,677	52.50	770,542.50
LEAR CORP	5,287	144.97	766,456.39
TESLA INC	10,135	313.22	3,174,484.70
COACH INC	22,032	47.68	1,050,485.76
DR HORTON INC	28,586	35.79	1,023,092.94
GARMIN LTD	9,564	51.17	489,389.88
HANESBRANDS INC	31,136	22.93	713,948.48
HASBRO INC	9,007	111.93	1,008,153.51

LEGGETT & PLATT INC	10,594	52.86	559,998.84
LENNAR CORP-CL A	14,466	53.48	773,641.68
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	58.36	494,425.92
MATTEL INC	27,399	20.81	570,173.19
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	36.04	501,676.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	245.75	1,243,986.50
NEWELL BRANDS INC	37,563	53.27	2,000,981.01
NIKE B	106,351	57.98	6,166,230.98
NVR INC	264	2,497.79	659,416.56
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	87.83	412,010.53
PULTE GROUP INC	24,602	24.94	613,573.88
PVH CORP	6,800	112.17	762,756.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	72.30	330,989.40
TOLL BROTHERS INC	11,211	40.41	453,036.51
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	20.64	329,208.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	19.22	312,959.26
VF CORP	26,718	56.70	1,514,910.60
WHIRLPOOL CORP	6,165	192.11	1,184,358.15
ARAMARK	19,980	40.24	803,995.20
BLOCK H & R INC	16,984	31.37	532,788.08
CARNIVAL CORPORATION	27,162	65.83	1,788,074.46
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	413.89	817,432.75
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	90.17	904,495.27
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	212.32	867,964.16
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,573	61.76	1,023,548.48
LAS VEGAS SANDS CORP	30,845	61.77	1,905,295.65
MARRIOTT INTL A	26,066	100.35	2,615,723.10
MCDONALD'S CORP	66,243	156.27	10,351,793.61
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	21.68	382,912.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	30.84	1,114,680.96
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	12,935	54.68	707,285.80
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,264	109.20	1,448,428.80
STARBUCKS CORP	115,910	58.04	6,727,416.40
VAIL RESORTS INC	2,987	202.18	603,911.66
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,943	100.83	800,892.69
WYNN RESORTS LTD	6,619	132.46	876,752.74
YUM BRANDS INC	27,230	73.49	2,001,132.70
CBS CORP-CL B	28,894	62.81	1,814,832.14
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16,962	332.43	5,638,677.66
COMCAST CORP-CL A	374,753	38.57	14,454,223.21
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	25.82	330,599.28
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,945	25.15	426,166.75

DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	63.89	1,163,948.02
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	24.75	837,391.50
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	85.92	744,324.96
LIBERTY GLOBAL PLC-A	19,082	31.46	600,319.72
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	30.53	1,412,653.63
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	41.05	625,314.65
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	41.31	263,723.04
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.32	445,940.28
OMNICOM GROUP	19,057	81.50	1,553,145.50
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	67.16	426,868.96
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	5.37	695,441.85
THE WALT DISNEY CO	125,167	103.32	12,932,254.44
TIME WARNER INC	61,362	101.24	6,212,288.88
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	83,186	27.90	2,320,889.40
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,931	27.56	1,017,818.36
VIACOM INC-CLASS B	26,755	33.20	888,266.00
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	101.93	630,538.98
AMAZON.COM	32,159	978.76	31,475,942.84
AUTONATION INC	5,015	41.80	209,627.00
AUTOZONE INC	2,370	501.39	1,188,294.30
BED BATH & BEYOND INC	12,615	29.69	374,539.35
BEST BUY COMPANY INC	21,836	57.87	1,263,649.32
CARMAX INC	14,253	63.95	911,479.35
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,851	39.88	313,097.88
DOLLAR GENERAL CORP	22,756	70.23	1,598,153.88
DOLLAR TREE INC	18,300	67.98	1,244,034.00
EXPEDIA INC	9,800	149.78	1,467,844.00
FOOT LOCKER INC	11,410	49.98	570,271.80
GAP	20,859	22.64	472,247.76
GENUINE PARTS CO	12,484	86.86	1,084,360.24
HOME DEPOT	96,452	152.23	14,682,887.96
KOHL'S CORP	15,495	38.24	592,528.80
L BRANDS INC	19,499	45.11	879,599.89
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	24.08	844,509.68
LKQ CORP	24,693	31.49	777,582.57
LOWES COMPANIES	69,142	77.15	5,334,305.30
MACY'S INC	25,926	22.68	588,001.68
NETFLIX INC	34,325	150.18	5,154,928.50
NORDSTROM INC	10,094	47.54	479,868.76
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,397	172.85	1,278,571.45
PRICELINE GROUP INC/THE	3,883	1,918.50	7,449,535.50
ROSS STORES INC	32,319	56.14	1,814,388.66

SIGNET JEWELERS LTD	5,407	62.04	335,450.28
STAPLES INC	55,506	10.08	559,500.48
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,075	51.07	2,148,770.25
TIFFANY & CO	10,306	93.84	967,115.04
TJX COMPANIES INC	52,399	70.35	3,686,269.65
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,274	51.06	575,650.44
TRIPADVISOR INC	10,393	36.64	380,799.52
ULTA BEAUTY INC	4,911	276.97	1,360,199.67
COSTCO WHOLESALE CORP	34,686	154.11	5,345,459.46
CVS HEALTH CORP	80,999	78.64	6,369,761.36
KROGER CO	73,364	23.16	1,699,110.24
SYSCO CORP	40,957	49.45	2,025,323.65
WAL-MART STORES	121,565	75.33	9,157,491.45
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,434	77.47	5,611,461.98
WHOLE FOODS MKT INC	25,128	42.00	1,055,376.00
ALTRIA GROUP INC	153,522	74.25	11,399,008.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	41.24	1,837,943.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,638	48.17	753,282.46
BUNGE LIMITED	11,767	76.84	904,176.28
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	51.58	725,833.76
COCA-COLA CO	323,074	44.39	14,341,254.86
CONAGRA BRANDS INC	33,243	33.42	1,110,981.06
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,015	193.52	2,712,182.80
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	89.26	1,325,957.30
GENERAL MILLS INC	46,814	53.63	2,510,634.82
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	105.91	1,186,192.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	33.20	779,038.00
INGREDION INC	5,835	117.13	683,453.55
JM SMUCKER CO	9,562	115.39	1,103,359.18
KELLOGG CO	21,051	66.52	1,400,312.52
KRAFT HEINZ CO/THE	48,860	83.04	4,057,334.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	95.75	888,177.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	86.13	1,300,563.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,487	43.22	5,207,448.14
MONSTER BEVERAGE CORP	31,093	50.70	1,576,415.10
PEPSICO INC	113,022	115.51	13,055,171.22
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	122,884	117.90	14,488,023.60
REYNOLDS AMERICAN INC	68,681	64.58	4,435,418.98
TYSON FOODS INC	22,220	60.22	1,338,088.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,126	52.00	1,098,552.00
CLOROX COMPANY	10,045	134.38	1,349,847.10
COLGATE-PALMOLIVE CO	66,149	73.34	4,851,367.66

COTY INC-CL A	39,000	18.79	732,810.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	94.28	1,680,258.16
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	126.80	3,549,132.00
PROCTER & GAMBLE CO	202,571	87.65	17,755,348.15
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,894	123.66	234,212.04
ABBOTT LABORATORIES	138,584	48.44	6,713,008.96
AETNA INC	28,030	153.88	4,313,256.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,441	151.95	826,759.95
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	93.91	1,206,461.77
ANTHEM INC	21,018	191.61	4,027,258.98
BARD C R INC	5,875	318.41	1,870,658.75
BAXTER INTERNATIONAL	39,728	60.72	2,412,284.16
BECTON DICKINSON & CO	17,797	197.79	3,520,068.63
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,874	27.59	2,976,243.66
CARDINAL HEALTH	25,252	77.19	1,949,201.88
CENTENE CORP	13,787	81.26	1,120,331.62
CERNER CORP	23,088	65.74	1,517,805.12
CIGNA CORP	20,371	169.61	3,455,125.31
DANAHER CORP	49,843	83.07	4,140,458.01
DAVITA INC	13,384	63.42	848,813.28
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	64.60	1,152,076.40
DEXCOM INC	6,289	72.35	455,009.15
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	118.17	1,982,419.92
ENVISION HEALTHCARE	9,978	61.65	615,143.70
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	49,016	62.50	3,063,500.00
HCA HEALTHCARE INC	23,646	86.14	2,036,866.44
HENRY SCHEIN INC	6,246	182.84	1,142,018.64
HOLOGIC INC	21,094	45.08	950,917.52
HUMANA INC	11,797	238.23	2,810,399.31
IDEXX LABORATORIES INC	7,291	161.43	1,176,986.13
INTUITIVE SURGICAL INC	3,062	944.27	2,891,354.74
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	151.45	1,204,481.85
MCKESSON CORP	16,655	164.68	2,742,745.40
MEDNAX INC	8,151	58.43	476,262.93
MEDTRONIC PLC	108,768	87.96	9,567,233.28
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	44.40	314,440.80
QUEST DIAGNOSTICS	11,439	109.73	1,255,201.47
RESMED INC	11,925	76.82	916,078.50
STRYKER CORP	26,917	141.12	3,798,527.04
TELEFLEX INC	3,320	211.40	701,848.00
THE COOPER COS INC	4,109	242.73	997,377.57
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,259	187.96	14,333,641.64

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	122.04	884,545.92
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,822	103.64	810,672.08
VCA INC	6,103	92.63	565,320.89
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,988	62.35	498,051.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	127.11	2,041,767.93
ABBVIE INC	126,216	72.03	9,091,338.48
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	59.63	1,510,010.49
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	123.06	2,181,730.74
ALKERMES PLC	12,547	59.53	746,922.91
ALLERGAN PLC	26,503	240.69	6,379,007.07
AMGEN	58,335	171.43	10,000,369.05
BIOGEN INC	17,038	273.93	4,667,219.34
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	90.51	1,298,003.91
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,369	55.91	7,400,750.79
CELGENE CORP	61,566	132.56	8,161,188.96
GILEAD SCIENCES INC	103,400	69.25	7,160,450.00
ILLUMINA INC	11,836	172.11	2,037,093.96
INCYTE CORP	13,332	130.84	1,744,358.88
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	154.49	767,969.79
JOHNSON & JOHNSON	215,442	132.54	28,554,682.68
LILLY (ELI) & CO	78,523	82.29	6,461,657.67
MALLINCKRODT PLC	9,552	42.64	407,297.28
MERCK & CO	218,678	63.16	13,811,702.48
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	588.18	1,179,889.08
MYLAN NV	36,548	37.61	1,374,570.28
PERRIGO CO PLC	9,792	72.46	709,528.32
PFIZER	472,132	33.35	15,745,602.20
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,874	88.85	966,154.90
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,135	496.50	3,046,027.50
SEATTLE GENETICS INC	7,471	51.37	383,785.27
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,458	114.92	167,553.36
TESARO INC	2,771	134.79	373,503.09
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	71,876	31.54	2,266,969.04
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,681	177.49	5,623,060.69
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	131.05	425,519.35
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	130.35	2,591,879.40
WATERS CORP	6,513	184.08	1,198,913.04
ZOETIS INC	37,987	62.59	2,377,606.33
BANK OF AMERICA CORP	794,303	24.83	19,722,543.49
BB&T CORP	64,293	45.47	2,923,402.71
CIT GROUP INC	10,713	49.08	525,794.04
CITIGROUP	219,376	67.91	14,897,824.16

CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	37.07	1,483,170.70
COMERICA INC	14,625	74.67	1,092,048.75
EAST WEST BANCORP INC	10,794	59.38	640,947.72
FIFTH THIRD BANCORP	62,255	26.48	1,648,512.40
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	103.27	1,298,930.06
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	13.69	1,196,752.42
JPMORGAN CHASE & CO	283,641	93.85	26,619,707.85
KEY CORP	87,033	19.22	1,672,774.26
M & T BANK CORP	10,792	165.11	1,781,867.12
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	13.24	517,617.80
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	17.86	489,078.24
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,208	126.54	4,834,840.32
REGIONS FINL CORP	96,209	14.69	1,413,310.21
SIGNATURE BANK	4,354	141.90	617,832.60
SUNTRUST BANKS	38,353	57.77	2,215,652.81
SVB FINANCIAL GROUP	3,954	181.72	718,520.88
US BANCORP	135,655	52.46	7,116,461.30
WELLS FARGO & CO	377,602	55.74	21,047,535.48
ZIONS BANCORPORATION	15,186	44.44	674,865.84
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	169.87	753,033.71
ALLY FINANCIAL INC	36,028	20.82	750,102.96
AMERICAN EXPRESS	60,354	84.33	5,089,652.82
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,382	131.31	1,625,880.42
BANK NEW YORK CO	81,605	51.75	4,223,058.75
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	98,017	171.14	16,774,629.38
BLACKROCK INC	9,743	432.38	4,212,678.34
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,275	82.50	3,157,687.50
CBOE HOLDINGS INC	7,588	92.98	705,532.24
CME GROUP INC	27,024	124.83	3,373,405.92
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	31,098	61.37	1,908,484.26
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,110	38.69	894,125.90
EATON VANCE CORP	10,061	47.52	478,098.72
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	45.42	1,184,099.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,555	225.28	6,432,870.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,132	65.92	3,106,941.44
INVESCO LTD	30,943	35.92	1,111,472.56
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	26.76	687,892.56
MOODY'S CORP	13,995	123.42	1,727,262.90
MORGAN STANLEY	111,836	46.05	5,150,047.80
MSCI INC	7,670	102.54	786,481.80
NASDAQ INC	9,070	71.63	649,684.10
NAVIENT CORP	23,616	16.18	382,106.88

NORTHERN TRUST CORP	17,320	98.13	1,699,611.60
PRICE T ROWE GROUP INC	18,992	76.16	1,446,430.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	81.39	808,365.48
S&P GLOBAL INC	20,491	148.79	3,048,855.89
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,249	43.32	4,126,186.68
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	54.08	584,172.16
STATE STREET CORP	30,456	90.87	2,767,536.72
SYNCHRONY FINANCIAL	65,163	29.70	1,935,341.10
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,142	44.37	982,440.54
VOYA FINANCIAL INC	16,094	37.48	603,203.12
AFLAC	32,201	77.98	2,511,033.98
ALLEGHANY CORP	1,276	595.55	759,921.80
ALLSTATE CORP	28,573	89.19	2,548,425.87
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	101.56	563,556.44
AMERICAN INT'L GROUP	77,200	63.35	4,890,620.00
AON PLC	20,775	135.01	2,804,832.75
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	95.23	962,013.46
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	57.71	864,034.12
ASSURANT INC	4,769	105.32	502,271.08
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5,323	49.27	262,264.21
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	64.13	468,277.26
CHUBB LTD	37,318	146.52	5,467,833.36
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	72.66	901,928.58
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	263.21	882,543.13
FNF GROUP	20,786	44.59	926,847.74
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	52.73	1,511,347.26
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	70.20	1,248,858.00
LOEWS CORP	24,048	47.21	1,135,306.08
MARKEL CORP	1,132	982.53	1,112,223.96
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	78.33	3,198,840.54
METLIFE INC	74,757	56.17	4,199,100.69
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	64.61	1,496,044.55
PROGRESSIVE CORP	46,702	44.99	2,101,122.98
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,796	111.36	3,763,522.56
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	130.99	711,406.69
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	141.78	460,643.22
TORCHMARK CORP	9,592	77.64	744,722.88
TRAVELERS COS INC/THE	22,473	127.17	2,857,891.41
UNUM GROUP	18,574	47.54	883,007.96
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,506	146.32	1,537,237.92
WR BERKLEY CORP	8,610	69.43	597,792.30
XL GROUP LTD	20,644	44.95	927,947.80

CBRE GROUP INC-A	24,306	36.61	889,842.66
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.47	737,289.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	126.19	463,495.87
WEYERHAEUSER CO	58,857	32.01	1,884,012.57
ACCENTURE PLC-CL A	49,320	124.21	6,126,037.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	55,770	58.09	3,239,679.30
ADOBE SYSTEMS INC	39,126	142.22	5,564,499.72
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	49.24	698,124.72
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	256.17	1,028,778.72
ALPHABET INC-CL A	23,593	940.81	22,196,530.33
ALPHABET INC-CL C	24,794	918.59	22,775,520.46
ANSYS INC	6,865	122.39	840,207.35
AUTODESK INC	15,592	103.32	1,610,965.44
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,479	105.14	3,730,262.06
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	75.23	725,969.50
CA INC	26,520	34.34	910,696.80
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	33.67	726,766.95
CDK GLOBAL INC	10,687	61.16	653,616.92
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	111.44	1,203,663.44
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	79.27	991,746.97
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,060	66.96	3,218,097.60
COSTAR GROUP INC	2,453	270.80	664,272.40
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	16,887	61.51	1,038,719.37
DXC TECHNOLOGY CO	23,243	77.46	1,800,402.78
EBAY	81,500	34.23	2,789,745.00
ELECTRONIC ARTS INC	24,276	107.45	2,608,456.20
FACEBOOK INC-A	187,039	151.44	28,325,186.16
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	25,895	86.78	2,247,168.10
FIRST DATA CORP- CLASS A	22,617	18.24	412,534.08
FISERV INC	16,892	122.77	2,073,830.84
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	145.10	1,039,351.30
FORTINET INC	10,871	38.49	418,424.79
GARTNER INC	7,002	125.37	877,840.74
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	88.99	1,113,531.87
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,658	152.94	10,959,374.52
INTUIT INC	19,275	131.90	2,542,372.50
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	103.60	619,424.40
LEIDOS HOLDINGS	10,999	52.07	572,717.93
MASTERCARD INC-CLASS A	75,553	122.20	9,232,576.60
MERCADOLIBRE INC	3,264	255.60	834,278.40
MICROSOFT CORP	583,130	69.46	40,504,209.80
MOBILEYE NV	14,784	63.00	931,392.00

NUANCE COMMUNICATIONS INC	23,427	17.24	403,881.48
ORACLE CORP	244,077	49.35	12,045,199.95
PAYCHEX INC	25,506	57.42	1,464,554.52
PAYPAL HOLDINGS INC	90,782	53.97	4,899,504.54
RED HAT INC	13,963	96.55	1,348,127.65
SABRE CORP	17,243	21.43	369,517.49
SALESFORCE.COM INC	52,380	87.92	4,605,249.60
SERVICENOW INC	13,102	106.29	1,392,611.58
SPLUNK INC	10,741	57.25	614,922.25
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	13,239	39.09	517,512.51
SYMANTEC CORP	48,508	28.41	1,378,112.28
SYNOPSIS INC	12,264	73.15	897,111.60
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	58.66	739,702.60
TWITTER INC	47,756	18.02	860,563.12
VANTIV INC - CL A	12,864	61.12	786,247.68
VERISIGN INC	7,289	94.42	688,227.38
VISA INC-CLASS A SHARES	147,450	93.92	13,848,504.00
VMWARE INC-CLASS A	4,949	88.19	436,452.31
WESTERN UNION CO	38,757	18.65	722,818.05
WORKDAY INC-CLASS A	9,123	97.10	885,843.30
ZILLOW GROUP INC-C	7,786	46.50	362,049.00
AMPHENOL CORPORATION	24,215	73.39	1,777,138.85
APPLE INC	416,822	144.18	60,097,395.96
ARISTA NETWORKS INC	3,532	148.77	525,455.64
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	78.78	525,147.48
AVNET INC	10,936	38.99	426,394.64
CDW CORP/DE	12,482	62.36	778,377.52
CISCO SYSTEMS	397,352	30.90	12,278,176.80
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	38.15	569,693.95
CORNING	74,974	30.28	2,270,212.72
F5 NETWORKS INC	5,350	127.63	682,820.50
FLEX LTD	45,803	16.29	746,130.87
FLIR SYSTEMS INC	11,686	34.70	405,504.20
HARRIS CORP	9,931	112.81	1,120,316.11
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	132,071	16.61	2,193,699.31
HP INC	135,166	17.35	2,345,130.10
JUNIPER NETWORKS INC	27,826	28.45	791,649.70
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	87.31	1,101,852.20
NETAPP INC	23,085	38.64	892,004.40
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	136.15	981,777.65
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	38.20	872,335.20
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	79.08	2,214,951.72

TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	36.69	756,621.18
WESTERN DIGITAL CORP	22,401	86.94	1,947,542.94
XEROX CORP	16,718	28.78	481,144.04
AT&T INC	486,690	36.98	17,997,796.20
CENTURYLINK INC	45,847	23.60	1,081,989.20
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,501	58.93	1,443,843.93
SPRINT CORP	64,825	8.13	527,027.25
T-MOBILE US INC	22,516	60.01	1,351,185.16
VERIZON COMMUNICATIONS	322,910	43.48	14,040,126.80
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,715	30.32	355,198.80
AES CORP	52,646	10.76	566,470.96
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	39.71	764,655.76
AMEREN CORPORATION	20,393	54.14	1,104,077.02
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	69.15	2,687,998.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	77.76	1,110,646.08
ATMOS ENERGY CORP	8,018	83.68	670,946.24
CENTERPOINT ENERGY INC	34,527	27.32	943,277.64
CMS ENERGY CORP	23,551	45.75	1,077,458.25
CONSOLIDATED EDISON INC	23,942	80.53	1,928,049.26
DOMINION ENERGY INC	50,217	75.79	3,805,946.43
DTE ENERGY COMPANY	14,355	105.26	1,511,007.30
DUKE ENERGY CORP	55,195	83.42	4,604,366.90
EDISON INTL	26,184	76.83	2,011,716.72
ENERGY CORP	15,032	75.79	1,139,275.28
EVERSOURCE ENERGY	25,381	60.07	1,524,636.67
EXELON CORP	73,029	35.58	2,598,371.82
FIRSTENERGY CORP	35,696	29.25	1,044,108.00
NEXTERA ENERGY INC	37,038	140.48	5,203,098.24
NISOURCE INC	26,021	25.32	658,851.72
OGE ENERGY CORP	15,686	34.22	536,774.92
PG&E CORP	39,984	65.32	2,611,754.88
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	84.67	797,252.72
PPL CORPORATION	53,473	38.07	2,035,717.11
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	42.10	1,709,512.60
SCANA CORP	11,459	65.02	745,064.18
SEMPRA ENERGY	18,704	110.53	2,067,353.12
SOUTHERN CO	78,272	47.36	3,706,961.92
UGI CORP	13,950	48.26	673,227.00
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	60.92	1,540,484.04
WESTAR ENERGY INC	11,492	53.13	610,569.96
XCEL ENERGY INC	40,763	45.69	1,862,461.47
ADVANCED MICRO DEVICES	60,463	13.36	807,785.68

	ANALOG DEVICES	28,935	78.47	2,270,529.45
	APPLIED MATERIALS	85,715	43.54	3,732,031.10
	BROADCOM LTD	31,850	239.62	7,631,897.00
	INTEL CORP	375,194	33.88	12,711,572.72
	KLA-TENCOR CORP	12,266	94.57	1,159,995.62
	LAM RESEARCH CORP	12,814	148.13	1,898,137.82
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	35,834	16.13	578,002.42
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,468	45.74	1,073,426.32
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,416	78.36	1,364,717.76
	MICRON TECHNOLOGY	81,956	30.20	2,475,071.20
	NVIDIA CORP	42,937	146.76	6,301,434.12
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	109.11	2,976,848.13
	QORVO INC	10,609	65.86	698,708.74
	QUALCOMM	117,038	55.35	6,478,053.30
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	99.70	1,446,647.00
	TEXAS INSTRUMENTS	79,198	78.48	6,215,459.04
	XILINX INC	20,299	65.35	1,326,539.65
	アメリカドル 小計	24,514,279		1,693,251,697.31 (193,318,546,281)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	29.30	348,259.80
	ARC RESOURCES LTD	27,117	16.80	455,565.60
	CAMECO CORP	28,709	11.96	343,359.64
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	89,413	36.33	3,248,374.29
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	9.02	701,783.06
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	9.19	397,412.36
	ENBRIDGE	128,864	51.30	6,610,723.20
	ENCANA CORP	76,271	10.80	823,726.80
	HUSKY ENERGY INC	31,439	13.65	429,142.35
	IMPERIAL OIL	24,763	36.17	895,677.71
	INTER PIPELINE LTD	30,317	24.98	757,318.66
	KEYERA CORP	14,929	39.95	596,413.55
	PEMBINA PIPELINE CORP	31,251	42.75	1,335,980.25
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	22.20	280,452.60
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,418	27.90	402,262.20
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	20.67	413,606.70
	SUNCOR ENERGY	131,818	36.67	4,833,766.06
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	26.14	521,885.10
	TRANSCANADA CORP	69,465	62.27	4,325,585.55
	VERESEN INC	23,263	18.28	425,247.64
	VERMILION ENERGY INC	10,067	38.79	390,498.93
	AGNICO EAGLE MINES	17,661	56.20	992,548.20
	AGRIUM INC	10,925	117.02	1,278,443.50

BARRICK GOLD CORP	94,395	19.81	1,869,964.95
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10,500	62.48	656,040.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	11.21	637,849.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	90.22	1,286,266.54
GOLDCORP INC	68,688	16.15	1,109,311.20
KINROSS GOLD CORP	107,615	4.95	532,694.25
METHANEX CORP	7,099	55.23	392,077.77
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	67,665	21.04	1,423,671.60
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	22.79	1,040,978.83
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.44	244,240.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	59.13	255,855.51
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	24.56	904,741.28
YAMANA GOLD INC	85,214	2.88	245,416.32
BOMBARDIER B	157,835	2.33	367,755.55
CAE INC	18,372	22.57	414,656.04
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	25.31	297,746.84
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	56.74	688,369.68
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,851	105.95	6,447,163.45
CP RAILWAY LIMITED	11,321	209.46	2,371,296.66
LINAMAR CORP	3,889	64.09	249,246.01
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	59.37	1,661,053.86
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	39.72	701,415.48
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	79.11	1,453,408.92
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	27.95	1,004,718.65
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	143.35	775,380.15
DOLLARAMA INC	9,011	121.46	1,094,476.06
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	59.28	2,019,254.64
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	22.16	254,817.84
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	19.53	107,688.42
LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	70.90	1,301,227.70
METRO INC	19,179	42.54	815,874.66
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	115.34	550,748.50
SAPUTO INC	15,941	40.27	641,944.07
BANK MONTREAL	52,268	95.85	5,009,887.80
BANK NOVA SCOTIA	95,276	78.34	7,463,921.84
CANADIAN IMPERIAL BANK	31,960	106.06	3,389,677.60
NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	55.17	1,553,752.71
ROYAL BANK OF CANADA	116,630	95.09	11,090,346.70
TORONTO-DOMINION BANK	148,114	65.12	9,645,183.68
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	69,825	50.16	3,502,422.00
CI FINANCIAL CORP	18,671	27.68	516,813.28
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	9.21	266,961.06

	IGM FINANCIAL INC	7,685	40.61	312,087.85
	ONEX CORP	6,603	103.29	682,023.87
	THOMSON REUTERS CORP	22,284	59.04	1,315,647.36
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,946	562.00	1,093,652.00
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	35.60	846,852.80
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	57.42	472,566.60
	INTACT FINANCIAL CORP	10,466	96.63	1,011,329.58
	MANULIFE FINANCIAL CORP	159,761	25.01	3,995,622.61
	POWER CORP OF CANADA	29,774	30.25	900,663.50
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	33.78	700,597.20
	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	46.65	2,310,854.40
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	19.80	246,807.00
	CGI GROUP INC - CL A	17,309	65.66	1,136,508.94
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,524	665.64	1,014,435.36
	OPEN TEXT CORP	19,994	40.41	807,957.54
	SHOPIFY INC - CLASS A	6,105	114.75	700,548.75
	BCE INC	12,539	58.12	728,766.68
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	61.14	1,765,784.34
	TELUS CORP	16,454	44.68	735,164.72
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	50.25	263,360.25
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	41.10	424,316.40
	EMERA INC	4,086	47.34	193,431.24
	FORTIS INC	31,686	44.62	1,413,829.32
	HYDRO ONE LTD	21,742	22.71	493,760.82
	カナダドル 小計	3,235,326		130,630,919.98 (11,573,899,510)
ユーロ	ENAGAS	18,299	23.44	429,020.05
	ENI	202,686	12.96	2,626,810.56
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	13.07	521,261.02
	NESTE OIL OYJ	11,490	34.96	401,690.40
	OMV AG	10,551	44.43	468,833.68
	REPSOL SA	95,819	13.44	1,287,807.36
	SAIPEM SPA	59,023	3.29	194,185.67
	SNAM SPA	173,485	3.79	658,896.03
	TENARIS SA	40,648	13.43	545,902.64
	TOTAL SA	184,422	42.46	7,830,558.12
	VOPAK	6,360	41.08	261,300.60
	AIR LIQUIDE	31,020	107.40	3,331,548.00
	AKZO NOBEL	19,791	77.49	1,533,604.59
	ARCELORMITTAL	50,945	20.08	1,022,975.60
	ARKEMA	5,896	95.51	563,126.96
	BASF SE	72,566	81.12	5,886,553.92

COVESTRO AG	6,408	63.42	406,395.36
CRH PLC	65,334	31.34	2,047,894.23
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	28.51	383,573.54
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	48.12	277,267.44
HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	87.70	1,000,393.90
IMERYS SA	3,000	77.78	233,340.00
K+S AG	14,355	23.00	330,165.00
KONINKLIJKE DSM NV	13,812	63.02	870,432.24
LANXESS	7,293	66.17	482,577.81
LINDE AG	14,602	165.70	2,419,551.40
SOLVAY SA	6,365	120.10	764,436.50
STORA ENSO OYJ R	48,306	11.38	549,722.28
SYMRISE AG	10,667	60.48	645,140.16
THYSSEN KRUPP	29,964	25.92	776,666.88
UMICORE	8,516	59.91	510,193.56
UPM KYMMENE OYJ	44,370	25.31	1,123,004.70
VOESTALPINE AG	10,429	41.45	432,282.05
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,110	33.78	577,975.80
AIRBUS SE	46,178	74.10	3,421,789.80
ALSTOM	11,216	30.20	338,779.28
ANDRITZ AG	5,242	51.99	272,531.58
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,337	28.09	234,186.33
BOUYGUES ORD	16,815	36.69	616,942.35
BRENTAG AG	13,290	49.49	657,788.55
CNH INDUSTRIAL NV	85,910	10.11	868,550.10
DASSAULT AVIATION SA	213	1,228.45	261,659.85
EIFFAGE	4,952	79.00	391,208.00
FERROVIAL SA	36,974	18.88	698,069.12
GEA GROUP AG	15,822	37.60	594,907.20
HOCHTIEF AG	1,354	155.65	210,750.10
KONE OYJ-B	26,924	45.91	1,236,080.84
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	31.08	2,314,216.80
LEGRAND SA	21,312	61.27	1,305,786.24
LEONARDO SPA	35,425	14.90	527,832.50
MAN SE	3,262	94.78	309,172.36
METSO OYJ	9,561	30.47	291,323.67
OSRAM LICHT AG	6,216	69.98	434,995.68
PRYSMIAN SPA	14,715	26.47	389,506.05
REXEL SA	24,339	13.85	337,216.84
SAFRAN SA	24,396	81.97	1,999,740.12
SAINT-GOBAIN	39,044	47.11	1,839,558.06
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	67.40	3,020,463.60

SIEMENS	60,498	120.85	7,311,183.30
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	17.93	313,701.08
THALES SA	8,109	94.25	764,273.25
VINCI S.A.	40,049	73.89	2,959,220.61
WARTSILA OYJ	11,462	53.10	608,632.20
ZODIAC AEROSPACE	17,832	23.75	423,510.00
BUREAU VERITAS SA	19,558	19.34	378,349.51
EDENRED	18,941	22.40	424,373.10
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	50.16	480,934.08
RELX NV	79,547	17.59	1,399,629.46
SOCIETE BIC SA	2,424	102.45	248,338.80
WOLTERS KLUWER	23,031	36.48	840,286.03
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	53,260	16.42	874,529.20
ADP	2,382	140.00	333,480.00
AENA SA	5,610	166.65	934,906.50
ATLANTIA SPA	33,587	24.51	823,217.37
BOLLORE	61,805	3.95	244,253.36
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,178	20.50	434,149.00
DEUTSCHE POST AG-REG	76,417	32.83	2,508,770.11
FRAPORT AG	3,561	77.11	274,588.71
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	9.48	345,957.35
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.10	329,213.56
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,907	81.38	2,108,311.66
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	71.40	356,357.40
CONTINENTAL AG	8,828	188.70	1,665,843.60
DAIMLER AG	77,275	63.48	4,905,417.00
FERRARI NV	9,293	75.40	700,692.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	77,742	9.69	753,319.98
MICHELIN	13,278	119.00	1,580,082.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	37.30	383,891.60
PEUGEOT SA	40,815	18.38	750,179.70
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,859	51.28	659,409.52
RENAULT SA	13,675	81.25	1,111,093.75
SCHAEFFLER AG	15,247	12.35	188,300.45
VALEO SA	19,350	60.75	1,175,512.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	138.75	2,050,725.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	141.20	366,272.80
ADIDAS AG	14,964	176.20	2,636,656.80
CHRISTIAN DIOR SE	4,454	240.00	1,068,960.00
HERMES INTERNATIONAL	1,598	443.90	709,352.20
HUGO BOSS AG	4,852	61.83	299,999.16
KERING	6,060	300.25	1,819,515.00

LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	51.45	685,262.55
LVMH	22,335	216.40	4,833,294.00
SEB SA	2,075	157.55	326,916.25
ACCOR	14,931	40.24	600,823.44
PADDY POWER PLC	6,543	91.54	598,946.22
SODEXO	7,035	104.05	731,991.75
ALTICE NV -A	28,394	20.01	568,305.91
ALTICE NV -B	5,879	19.99	117,521.21
AXEL SPRINGER SE	3,827	51.85	198,429.95
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	22.13	265,028.88
JC DECAUX SA	4,674	28.24	131,993.76
LAGADERE S.C.A	9,057	27.10	245,489.98
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	34.24	656,613.63
PUBLICIS GROUPE	15,618	63.46	991,118.28
RTL GROUP	3,513	64.81	227,677.53
SES	31,369	19.59	614,675.55
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	54.42	271,991.16
VIVENDI	79,188	19.55	1,548,125.40
INDITEX	86,470	33.63	2,908,418.45
ZALANDO SE	6,805	39.67	269,954.35
CARREFOUR	43,442	21.28	924,445.76
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	51.11	188,442.57
COLRUYT SA	4,160	45.25	188,260.80
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.17	239,342.30
JERONIMO MARTINS	20,234	17.18	347,721.29
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	16.62	1,670,891.70
METRO STAMM	13,712	29.09	398,882.08
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,212	97.36	5,862,240.32
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	35.64	608,588.64
DANONE (GROUPE)	46,629	65.58	3,057,929.82
HEINEKEN HOLDING NV	7,650	79.70	609,705.00
HEINEKEN NV	18,465	84.73	1,564,539.45
KERRY GROUP PLC-A	12,346	74.00	913,604.00
PERNOD-RICARD	17,080	115.85	1,978,718.00
REMY COINTREAU	1,575	100.10	157,657.50
BEIERSDORF AG	7,693	90.54	696,524.22
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	104.35	899,288.30
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	119.15	1,705,513.10
LOREAL	20,170	179.35	3,617,489.50
UNILEVER NV-CVA	128,740	48.07	6,188,531.80
ESSILOR INTERNATIONAL	16,203	112.40	1,821,217.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,540	83.43	1,463,362.20

FRESENIUS SE&CO KGAA	32,306	74.72	2,413,904.32
BAYER	65,397	109.95	7,190,400.15
EUROFINS SCIENTIFIC	971	497.55	483,121.05
GRIFOLS SA	22,128	24.17	534,944.40
IPSEN	2,722	114.95	312,893.90
MERCK KGAA	10,480	102.00	1,068,960.00
ORION OYJ-CLASS B	7,975	55.15	439,821.25
QIAGEN N.V.	17,548	29.15	511,611.94
RECORDATI SPA	7,493	34.89	261,430.77
SANOFI	91,978	83.66	7,694,879.48
UCB (GROUPE)	10,465	60.61	634,283.65
ABN AMRO GROUP NV-CVA	24,776	24.15	598,340.40
BANCO BILBAO VIZCAYA	540,507	7.53	4,070,558.21
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.84	816,820.08
BANCO SANTANDER SA	1,160,077	5.80	6,738,887.29
BANCO SANTANDER SA-RIGHTS	1,160,077	0.09	110,207.31
BANKINTER SA	58,881	8.22	484,237.34
BNP PARIBAS	89,221	65.52	5,845,759.92
CAIXABANK	277,342	4.25	1,180,090.21
COMMERZBANK AG	89,792	11.11	997,589.12
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	14.69	1,364,195.63
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	34.60	799,536.80
ING GROEP NV-CVA	313,872	15.60	4,896,403.20
INTESA SANPAOLO	1,004,854	2.84	2,853,785.36
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.64	171,860.00
KBC GROEP NV	20,232	68.06	1,376,989.92
MEDIOBANCA	41,923	8.82	369,760.86
NATIXIS	69,996	6.10	427,045.59
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	22.77	209,461.67
SOCIETE GENERALE	61,696	49.42	3,049,324.80
UNICREDIT SPA	154,785	17.50	2,708,737.50
DEUTSCHE BANK NAMEN	167,110	16.68	2,787,394.80
DEUTSCHE BOERSE	15,552	95.40	1,483,660.80
EURAZEO SA	3,046	67.50	205,605.00
EXOR NV	9,778	48.64	475,601.92
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	84.86	530,120.42
WENDEL	2,023	128.10	259,146.30
AEGON	133,499	4.81	642,130.19
AGEAS	16,065	37.49	602,357.17
ALLIANZ SE-REG	36,340	178.75	6,495,775.00
ASSICURAZIONI GENERALI	94,259	15.00	1,413,885.00
AXA	156,617	25.00	3,915,425.00

CNP ASSURANCES	11,830	20.31	240,267.30
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	108.30	509,659.80
MAPFRE SA	90,939	3.17	288,640.38
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,779	180.10	2,301,497.90
NN GROUP NV	23,096	32.79	757,317.84
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.06	279,202.27
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	45.93	1,663,263.09
SCOR SE	13,354	36.99	494,031.23
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.97	188,068.24
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	27,553	32.51	895,748.03
VONOVIA SE	37,270	33.95	1,265,316.50
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,210	53.30	1,876,693.00
ATOS SE	7,634	123.20	940,508.80
CAPGEMINI SA	13,366	90.67	1,211,895.22
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	77.94	815,953.86
GEMALTO	6,158	54.79	337,396.82
SAP SE	77,832	90.36	7,032,899.52
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	47.75	454,245.75
INGENICO GROUP	4,681	82.91	388,101.71
NOKIA OYJ	458,694	5.47	2,511,349.65
DEUTSCHE TELEKOM	262,460	15.57	4,086,502.20
ELISA A	12,839	33.74	433,187.86
ILIAD SA	2,053	205.10	421,070.30
KPN (KON.)	261,596	2.85	747,379.77
ORANGE	156,887	14.00	2,197,202.43
PROXIMUS	13,141	30.61	402,246.01
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.80	686,730.63
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.64	304,420.18
TELEFONICA	359,839	9.05	3,256,902.78
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.29	287,824.16
E.ON SE	170,862	8.24	1,408,415.46
ELECTRICITE DE FRANCE	40,498	8.73	353,831.02
ENDESA	24,774	19.92	493,498.08
ENEL	639,593	4.72	3,018,878.96
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	2.83	546,874.86
ENGIE	133,123	13.09	1,743,245.68
FORTUM OYJ	38,513	13.83	532,634.79
GAS NATURAL SDG SA	26,034	20.29	528,229.86
IBERDROLA SA	467,107	6.67	3,117,939.22
INNOGY SE	11,000	35.26	387,915.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	18.04	593,355.69
RWE STAMM	42,828	17.62	754,843.50

	SUEZ	28,043	16.17	453,455.31
	TERNA SPA	105,905	4.74	502,413.32
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	18.90	696,063.19
	ASML HOLDING NV	29,420	116.50	3,427,430.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	18.66	1,693,718.09
	STMICROELECTRONICS	53,368	13.15	702,056.04
	ユーロ 小計	16,213,049		302,066,270.79 (39,310,904,480)
イギリスポンド	BP PLC	1,544,472	4.44	6,857,455.68
	PETROFAC LTD	16,711	4.41	73,745.64
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	349,161	20.44	7,136,850.84
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	295,514	20.60	6,089,065.97
	ANGLO AMERICAN PLC	108,396	10.51	1,139,241.96
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.15	292,405.68
	BHP BILLITON PLC	168,203	12.42	2,089,922.27
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	38.50	394,355.50
	FRESNILLO PLC	17,743	14.20	251,950.60
	GLENCORE PLC	979,109	2.97	2,910,401.50
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,720	27.84	465,484.80
	MONDI PLC	27,192	20.00	543,840.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	66.65	486,145.10
	RIO TINTO PLC REG	99,109	33.62	3,332,044.58
	ASHTED GROUP PLC	42,818	15.44	661,109.92
	BAE SYSTEMS PLC	246,425	6.17	1,521,674.37
	BUNZL PLC	27,712	22.56	625,182.72
	COBHAM PLC	151,109	1.32	199,463.88
	DCC PLC	7,320	68.95	504,714.00
	IMI PLC	23,923	12.10	289,468.30
	MEGGITT PLC	66,268	4.90	324,713.20
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	126,859	9.36	1,188,034.53
	SMITHS GROUP PLC	34,243	16.25	556,448.75
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	14.78	274,242.90
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	17.88	332,317.68
	WOLSELEY LTD	20,276	46.80	948,916.80
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	8.74	172,116.82
CAPITA GROUP PLC	53,334	6.63	353,604.42	
EXPERIAN PLC	76,879	15.66	1,203,925.14	
G4S PLC	132,555	3.27	434,117.62	
INTERTEK GROUP PLC	12,430	41.95	521,438.50	
RELX PLC	87,723	16.32	1,431,639.36	
EASYJET PLC	11,633	14.19	165,072.27	
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.10	308,270.69	

NEW GKN	148,431	3.27	486,111.52
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	87,767	5.89	517,386.46
BURBERRY GROUP PLC	31,782	16.10	511,690.20
PERSIMMON PLC	22,676	23.66	536,514.16
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.78	482,743.26
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	32.96	349,343.04
CARNIVAL PLC	15,765	51.55	812,685.75
COMPASS GROUP PLC	122,809	15.77	1,936,697.93
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	42.63	595,285.32
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.73	308,043.73
TUI AG-DI	31,155	11.29	351,739.95
WHITBREAD PLC	14,664	38.43	563,537.52
ITV PLC	295,435	1.76	521,738.21
PEARSON	66,305	6.85	454,520.77
SKY PLC	76,785	9.90	760,171.50
WPP PLC	103,971	15.69	1,631,304.99
DIXONS CARPHONE PLC	83,240	2.84	237,150.76
KINGFISHER PLC	187,310	3.04	571,108.19
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.44	465,981.03
NEXT PLC	11,202	37.66	421,867.32
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.41	405,349.37
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.46	365,497.44
TESCO	656,079	1.70	1,118,614.69
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	26,944	29.70	800,236.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	148,557	52.19	7,753,189.83
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	22.21	310,917.79
DIAGEO	198,168	22.61	4,480,578.48
IMPERIAL BRANDS PLC	76,724	34.54	2,650,430.58
TATE & LYLE	40,576	6.61	268,207.36
RECKITT BENCKISER PLC	52,296	76.68	4,010,057.28
UNILEVER PLC	102,945	41.78	4,301,042.10
CONVATEC GROUP PLC	80,814	3.01	243,654.21
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	7.31	219,497.37
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.05	926,902.35
ASTRAZENECA	99,689	51.30	5,114,045.70
GLAXOSMITHKLINE	392,835	16.14	6,342,321.07
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,207	14.27	174,193.89
SHIRE PLC	72,022	43.24	3,114,591.39
BARCLAYS	1,365,547	2.08	2,842,386.08
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,594,311	7.28	11,609,772.70
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,653,221	0.66	3,761,087.93
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.58	764,520.58

	STANDARD CHARTERED PLC	258,738	8.02	2,077,148.66	
	3I GROUP PLC	72,934	8.98	655,311.99	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	74,245	3.05	226,521.49	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	12.77	261,389.13	
	INVESTEC PLC	54,280	5.73	311,024.40	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,018	37.33	971,251.94	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	23.72	263,624.08	
	SCHRODERS PLC	8,614	31.57	271,943.98	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.31	330,139.05	
	AVIVA PIC	318,261	5.35	1,702,696.35	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.63	413,240.31	
	LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.67	1,296,554.14	
	OLD MUTUAL PLC	397,509	1.91	762,024.75	
	PRUDENTIAL	208,409	17.80	3,709,680.20	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.35	549,516.30	
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.94	534,315.00	
	STANDARD LIFE PLC	164,930	4.05	668,956.08	
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.71	297,397.17	
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.71	599,790.51	
	WORLDPAY GROUP PLC	157,060	3.68	578,609.04	
	BT GROUP PLC	663,615	2.87	1,905,902.28	
	INMARSAT PLC	33,632	7.45	250,726.56	
	VODAFONE GROUP PLC	2,095,996	2.18	4,584,991.25	
	CENTRICA PLC	440,558	2.07	915,038.96	
	NATIONAL GRID PLC	275,549	9.34	2,575,556.50	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	22.08	399,912.96	
	SSE PLC	80,824	14.74	1,191,345.76	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.70	512,343.00	
	イギリスポンド 小計	24,379,751		146,989,050.43 (21,647,077,456)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	688.50	462,672.00	
	GIVAUDAN-REG	740	1,885.00	1,394,900.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	55.55	2,033,352.20	
	SIKA AG-BR	164	6,205.00	1,017,620.00	
	ABB LTD	156,927	23.70	3,719,169.90	
	GEBERIT AG-REG	3,021	447.30	1,351,293.30	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,881	197.80	372,061.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,528	201.40	710,539.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	72.45	958,078.80	
	SGS SA	437	2,287.00	999,419.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,674	160.00	747,840.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	78.15	3,242,834.25	

	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	355.10	881,713.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	69.60	274,084.80
	DUFREY AG-REG	2,548	159.20	405,641.60
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	208	1,308.00	272,064.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	65,150.00	521,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,460.00	409,500.00
	NESTLE SA - REGISTERED	246,674	81.85	20,190,266.90
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	155.90	645,426.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	697	541.00	377,077.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	211.00	1,214,727.00
	NOVARTIS	176,865	79.05	13,981,178.25
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,654	240.50	13,384,787.00
	VIFOR PHARMA AG	3,601	106.20	382,426.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG	184,997	14.62	2,704,656.14
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,803	51.60	970,234.80
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	73.85	250,868.45
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,482	597.50	885,495.00
	UBS GROUP AG	296,299	16.84	4,989,675.16
	BALOISE HOLDING AG	3,877	151.00	585,427.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,456	338.00	830,128.00
	SWISS RE LTD	25,692	90.55	2,326,410.60
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,137	286.90	3,482,105.30
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	86.85	545,157.45
	SWISSCOM	2,064	463.10	955,838.40
	スイスフラン 小計	1,323,496		88,475,868.80 (10,477,312,383)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	158.80	2,253,530.80
	BOLIDEN AB	23,656	229.30	5,424,320.80
	ALFA LAVAL AB	25,732	173.80	4,472,221.60
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	182.90	14,685,955.50
	ATLAS COPCO A	53,833	323.00	17,388,059.00
	ATLAS COPCO B	29,972	288.70	8,652,916.40
	SANDVIK AB	87,313	133.10	11,621,360.30
	SKANSKA B	28,530	204.10	5,822,973.00
	SKF AB-B	28,335	172.20	4,879,287.00
	VOLVO B	123,214	147.80	18,211,029.20
	SECURITAS B	22,844	140.00	3,198,160.00
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	283.80	5,156,646.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	84.20	3,259,550.40
	HENNES & MAURITZ B	73,962	212.90	15,746,509.80
	ICA GRUPPEN AB	5,730	310.40	1,778,592.00
	SWEDISH MATCH AB	15,149	293.40	4,444,716.60

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	230.00	11,171,330.00	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	164.10	2,600,164.50	
	NORDEA BANK AB	244,135	108.70	26,537,474.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	103.70	12,701,590.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	123.70	14,865,894.90	
	SWEDBANK AB-A	71,353	212.50	15,162,512.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	200.30	2,562,237.60	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	406.10	14,924,987.20	
	KINNEVIK AB - B	18,104	253.30	4,585,743.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,640	656.00	2,387,840.00	
	ERICSSON (LM) B	248,169	61.05	15,150,717.45	
	HEXAGON AB-B SHS	21,517	402.20	8,654,137.40	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	503.00	3,115,582.00	
	TELE2 AB-B SHS	33,524	89.90	3,013,807.60	
	TELIA CO AB	199,107	38.32	7,629,780.24	
	スウェーデンクローナ 小計	1,872,002		272,059,628.29 (3,683,687,367)	
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	87,872	136.00	11,950,592.00	
	NORSK HYDRO	106,150	48.71	5,170,566.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	306.40	4,127,208.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	193.00	1,345,403.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	209.00	1,252,955.00	
	MARINE HARVEST	32,238	140.10	4,516,543.80	
	ORKLA	70,520	84.10	5,930,732.00	
	DNB ASA	80,217	142.50	11,430,922.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	143.90	2,672,798.60	
	TELENOR ASA	60,821	137.20	8,344,641.20	
	ノルウェークローネ 小計	482,828		56,742,362.60 (775,668,096)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	484.10	3,582,824.10	
	NOVOZYMES A/S	17,687	278.80	4,931,135.60	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,720	617.50	10,942,100.00	
	ISS A/S	14,253	252.00	3,591,756.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	12,460.00	3,725,540.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	13,180.00	6,695,440.00	
	DSV A/S	14,599	393.90	5,750,546.10	
	PANDORA A/S	8,431	676.50	5,703,571.50	
	CARLSBERG AS-B	8,236	670.00	5,518,120.00	
	COLOPLAST-B	10,121	538.50	5,450,158.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	168.70	1,251,754.00	
	GENMAB A/S	4,512	1,382.00	6,235,584.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	387.10	1,885,564.10	

	NOVO NORDISK A/S-B	143,006	273.30	39,083,539.80
	DANSKE BANK A/S	58,024	255.30	14,813,527.20
	TRYG A/S	9,828	139.40	1,370,023.20
	TDC A/S	72,376	37.34	2,702,519.84
	DONG ENERGY A/S	10,460	293.00	3,064,780.00
	デンマーククローネ 小計	409,752		126,298,483.94 (2,210,223,468)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	31.37	647,131.73
	OIL SEARCH LTD	118,781	6.48	769,700.88
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	6.86	920,625.72
	SANTOS	128,132	2.95	377,989.40
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,670	29.37	1,781,877.90
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.03	346,029.74
	AMCOR	88,486	16.13	1,427,279.18
	BHP BILLITON LTD	257,888	24.59	6,341,465.92
	BLUESCOPE STEEL LTD	39,204	13.92	545,719.68
	BORAL LIMITED	104,098	6.91	719,317.18
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	5.19	698,968.44
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.29	495,470.71
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	19.58	731,567.54
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	19.89	1,216,452.51
	ORICA LTD	29,211	20.44	597,072.84
	RIO TINTO LTD	34,814	65.04	2,264,302.56
	SOUTH32 LTD	408,172	2.81	1,146,963.32
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	38.20	352,204.00
	BRAMBLES LTD	129,297	9.53	1,232,200.41
	SEEK LTD	26,358	16.62	438,069.96
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.35	853,255.45
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	5.77	197,074.35
	TRANSURBAN GROUP	162,844	11.37	1,851,536.28
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	21.77	951,893.25
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.13	367,878.64
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	51.20	282,777.60
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	43.52	142,005.76
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.23	265,352.13
	TATTS GROUP LTD	124,218	4.01	498,114.18
	REA GROUP LTD	3,593	63.03	226,466.79
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.86	174,329.18	
WESFARMERS LTD	89,270	40.91	3,652,035.70	
WOOLWORTHS LTD	102,821	25.50	2,621,935.50	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.67	399,947.10	
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	12.54	732,022.50	

	COCHLEAR LIMITED	5,007	151.90	760,563.30
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.13	298,794.27
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	72.30	885,530.40
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	22.90	727,693.30
	CSL LIMITED	36,350	134.17	4,877,079.50
	AUST AND NZ BANKING GROUP	235,060	28.62	6,727,417.20
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	11.63	414,028.00
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.13	472,290.42
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	135,855	82.13	11,157,771.15
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	211,199	29.80	6,293,730.20
	WESTPAC BANKING	264,733	30.59	8,098,182.47
	AMP LTD	244,230	5.15	1,257,784.50
	ASX LTD	15,814	52.47	829,760.58
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	12.90	568,477.20
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,553	88.05	2,161,891.65
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	6.87	1,254,159.72
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.83	607,068.96
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.95	1,351,461.35
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	14.72	1,514,997.12
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	14.71	479,016.44
	TELSTRA CORP	342,339	4.32	1,478,904.48
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.45	171,538.75
	AGL ENERGY LTD	51,344	24.95	1,281,032.80
	AUSNET SERVICES	120,230	1.67	201,385.25
	オーストラリアドル 小計	5,785,284		90,137,593.04 (7,827,548,579)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,607	8.00	500,856.00
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	7.08	601,446.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	8.57	311,236.69
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.85	560,705.89
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	5.29	311,914.27
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.38	208,684.58
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.92	323,341.20
	ニュージーランドドル 小計	560,571		2,818,184.63 (233,937,506)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	97.20	20,703,211.20
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	15.34	1,518,660.00
	MTR CORP	114,000	43.65	4,976,100.00
	LI & FUNG	554,800	2.85	1,581,180.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	36.50	4,343,500.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	32.25	2,209,125.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	180,000	45.85	8,253,000.00

	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	16.34	1,098,048.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	34.20	6,935,760.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	12.54	1,228,920.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.88	1,040,160.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	17.36	1,784,608.00	
	WH GROUP LTD	699,000	7.91	5,529,090.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	32.85	3,585,906.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	302,000	36.75	11,098,500.00	
	HANG SENG BANK	61,100	161.50	9,867,650.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.80	742,400.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	91,500	199.40	18,245,100.00	
	AIA GROUP LTD	952,200	55.35	52,704,270.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	216,496	60.10	13,011,409.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	31.90	2,583,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	19.92	3,446,160.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	104,495	43.45	4,540,307.75	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	37.00	2,183,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	26.50	1,020,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	9.91	4,870,765.00	
	SINO LAND CO	235,400	12.74	2,998,996.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	115.50	13,513,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	76.35	3,092,175.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	26.80	2,578,160.00	
	WHARF HOLDINGS	104,000	64.65	6,723,600.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	57.30	3,724,500.00	
	PCCW LTD	357,000	4.30	1,535,100.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	65.20	3,260,000.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	81.45	10,873,575.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	670,830	14.54	9,753,868.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	68.00	7,548,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	104.20	2,469,540.00	
	香港ドル 小計	7,462,177		257,171,994.75 (3,759,854,563)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.38	716,474.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.15	179,550.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.64	396,760.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.25	166,250.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.26	376,290.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	10.03	434,629.99	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.10	261,120.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.06	452,625.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	3.13	397,823.00	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	43.86	434,214.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.38	159,220.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	114,800	3.34	383,432.00	
	DBS GROUP	139,600	20.83	2,907,868.00	
	OCBC BANK	245,300	10.69	2,622,257.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	23.22	2,410,236.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.36	458,528.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.49	652,979.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	10.76	335,712.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	189,100	2.85	538,935.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	7.51	244,075.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.86	2,474,039.98	
	STARHUB LTD	38,000	2.70	102,600.00	
	シンガポールドル 小計	3,437,976		17,105,617.97 (1,413,437,212)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,247	249.00	559,503.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	16.29	533,595.24	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	441.30	644,298.00	
	BANK HAPOLIM BM	93,717	24.24	2,271,700.08	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	17.17	1,988,182.98	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	65.80	539,560.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	197.40	853,360.20	
	NICE LTD	4,894	274.80	1,344,871.20	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	5.96	922,843.21	
	イスラエルシェケル 小計	417,997		9,657,913.91 (311,177,986)	
	合 計	90,094,488		296,543,274,887 (296,543,274,887)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	472,900	212,805.00	
		アメリカドル 小計	472,900	212,805.00 (24,295,946)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	800,764.74	
		LENLEASE GROUP	44,009	744,632.28	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	620,932.60	
		オーストラリアドル 小計	223,440	2,166,329.62 (188,124,064)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,580,985.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,690,720.00	

		香港ドル 小計	488,500	4,271,705.00 (62,452,327)
		投資信託受益証券合計	1,184,840	274,872,337 (274,872,337)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	579,297.96
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,777	803,277.81
		AMERICAN TOWER CORPORATION	33,878	4,510,516.92
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	989,703.79
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	2,045,575.80
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,477,839.26
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	439,593.08
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	611,330.40
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44,000	633,160.00
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,103	2,795,405.41
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,392	1,364,978.80
		DUKE REALTY CORP	29,929	829,033.30
		EQUINIX INC	6,032	2,553,345.60
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,866,160.62
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,298,391.98
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	772,340.76
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	761,342.12
		GGP INC	48,203	1,097,100.28
		HCP INC	39,255	1,225,148.55
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,084,424.88
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	705,436.27
		KIMCO REALTY CORP	35,407	652,551.01
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	479,145.66
		MACERICH CO/THE	10,128	580,638.24
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,565	979,169.05
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	423,388.40
		PROLOGIS INC	41,651	2,405,345.25
		PUBLIC STORAGE	12,230	2,531,976.90
		REALTY INCOME CORP	21,691	1,186,280.79
		REGENCY CENTERS CORP	11,717	730,906.46
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,280,144.88
		SIMON PROPERTY GROUP	25,139	3,937,772.96
		SL GREEN REALTY CORP	8,067	826,302.81
		UDR INC	20,960	800,043.20
		VENTAS INC	27,813	1,876,543.11
		VEREIT INC	77,798	633,275.72
		VORNADO REALTY TRUST	13,295	1,248,666.40
		WELLTOWER INC	28,332	2,065,402.80

アメリカドル 小計		918,241	51,080,957.23 (5,831,912,886)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	208,671.85
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	376,252.10
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5,631	177,883.29
カナダドル 小計		30,576	762,807.24 (67,584,721)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	188,265.00
	GECINA SA	3,549	475,033.65
	ICADE	2,845	205,978.00
	KLEPIERRE	18,936	666,736.56
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,760	1,657,148.00
ユーロ 小計		35,400	3,193,161.21 (415,557,999)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	84,399	513,145.92
	HAMMERSON PLC	61,184	349,360.64
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	196,583.07
	LAND SECURITIES GROUP PLC	62,454	633,283.56
	SEGRO PLC	64,553	310,758.14
イギリスポンド 小計		346,079	2,003,131.33 (295,001,150)
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	696,446.00
	GOODMAN GROUP	140,271	1,115,154.45
	GPT GROUP	136,015	648,791.55
	MIRVAC GROUP	306,089	645,847.79
	SCENTRE GROUP	426,663	1,723,718.52
	STOCKLAND	207,412	889,797.48
	VICINITY CENTERS	291,115	739,432.10
	WESTFIELD CORP	161,441	1,281,841.54
オーストラリアドル 小計		1,743,096	7,741,029.43 (672,230,995)
香港ドル	LINK REIT	179,500	10,572,550.00
香港ドル 小計		179,500	10,572,550.00 (154,570,681)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	513,500.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	242,385.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	391,586.50
	SUNTEC REIT	173,000	321,780.00
シンガポールドル 小計		713,800	1,469,251.50 (121,404,251)
投資証券合計		3,966,692	7,558,262,683 (7,558,262,683)

合計		7,833,135,020	(7,833,135,020)
----	--	---------------	-----------------

## 有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 606銘柄	97.1%			63.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 38銘柄			2.9%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.4%			3.8%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	99.0%			12.9%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 104銘柄	98.7%			7.1%
	投資証券 5銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.1%			2.6%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 8銘柄			7.7%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	94.5%			1.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.9%	0.1%
シンガポールドル	株式 22銘柄	92.1%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成29年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	200,338,681
コール・ローン	1,623,470,602
国債証券	224,535,740,043
派生商品評価勘定	17,817,913
未収入金	86,447,696
未収利息	1,768,615,302
前払金	9,027,828
前払費用	99,189,755
差入委託証拠金	130,391,077
流動資産合計	228,471,038,897
資産合計	228,471,038,897
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,039,541
未払解約金	766,674,425
未払利息	3,108
その他未払費用	3,870
流動負債合計	775,720,944
負債合計	775,720,944
純資産の部	
元本等	
元本	83,312,326,813
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	144,382,991,140
元本等合計	227,695,317,953
純資産合計	227,695,317,953
負債純資産合計	228,471,038,897

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

平成29年 7月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成29年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	83,312,326,813口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.7330円
の額	(1万口当たり純資産額) (27,330円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

平成29年 7月10日現在	
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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、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、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(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・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成29年 7月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	80,597,449,660円
期中追加設定元本額	20,331,748,405円
期中一部解約元本額	17,616,871,252円
期末元本額	83,312,326,813円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,314,546,903円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	902,112,032円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	641,831,455円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,812,315,701円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,721,540円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,574,396,105円
世界経済インデックスファンド	4,525,430,946円
D C マイセレクション 2 5	1,392,136,527円
D C マイセレクション 5 0	1,183,987,211円
D C マイセレクション 7 5	728,094,544円

区分	平成29年 7月10日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	1,600,406,815円
D C マイセレクション S 2 5	564,775,828円
D C マイセレクション S 5 0	467,200,667円
D C マイセレクション S 7 5	196,784,315円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	57,149,606円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	52,115,185円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	21,891,182円
D C 世界経済インデックスファンド	3,682,845,936円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	514,801,137円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	79,539,705円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,636,582円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,481,290円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	75,102,502円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	221,371,651円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	363,309,244円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	267,432,125円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	700,715,106円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,096,219,581円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	801,820,634円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,822,166,087円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,094,389,964円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	339,683,076円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	824,007,416円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	2,068,117,227円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	309,522,134円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	434,144,739円
F O F s 用 外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,383,590,500円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	907,028,896円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	678,955,757円
外国債券ファンド・シリーズ 1	587,457,341円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,151,786,617円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,184,038,564円
分散投資コア戦略ファンド A	920,765,672円
分散投資コア戦略ファンド S	2,129,083,592円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	108,065,964円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,322,870,215円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,026,826,825円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	197,673,897円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	113,396,063円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	667,758,042円
S M T インデックスバランス・オープン	262,780,281円
外国債券 S M T B セレクション（SMA専用）	22,030,962,100円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	1,182,305,922円

区分	平成29年 7月10日現在
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	1,322,261,376円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	382,516,491円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,867,511,683
合計	2,867,511,683

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（平成29年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	741,623,123	-	732,595,295	9,027,828
	合計	741,623,123	-	732,595,295	9,027,828

## (注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成29年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	812,814,600	-	830,620,800	17,806,200
	アメリカドル	361,971,970	-	368,672,200	6,700,230
	カナダドル	21,306,940	-	22,145,000	838,060
	ユーロ	386,391,090	-	395,625,600	9,234,510
	イギリスポンド	43,144,600	-	44,178,000	1,033,400
	合計	812,814,600	-	830,620,800	17,806,200

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.75% 10/31/18	3,300,000.00	3,275,060.77	
		T 0.875% 07/15/18	10,000,000.00	9,959,553.70	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,441,149.45	
		T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	3,977,350.24	
		T 1.125% 01/15/19	5,800,000.00	5,779,370.32	
		T 1.125% 01/31/19	2,850,000.00	2,839,228.93	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,953,135.60	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,543,221.28	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,862,688.90	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,988,485.71	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	898,398.00	
		T 1.25% 01/31/20	1,320,000.00	1,311,269.66	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,376,154.16	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,435,082.52	
		T 1.25% 06/30/19	11,500,000.00	11,466,266.13	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,326,330.59	
		T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,492,917.53	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,475,143.74	
		T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,541,491.15	
		T 1.25% 12/15/18	2,520,000.00	2,516,493.74	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,984,870.40	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,983,646.05	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,740,607.82	
		T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,100,033.15	

T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,979,702.95	
T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,858,593.34	
T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	994,841.83	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,359,804.98	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,541,324.51	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,202,192.60	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,795,069.20	
T 1.375% 07/31/18	4,000,000.00	4,003,571.76	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,391,963.40	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,902,442.64	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,964,269.40	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,645,792.80	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,941,960.20	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,629,870.93	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,000,424.62	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,003,898.76	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,420,299.06	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,004,030.82	
T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,328,272.13	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,410,288.43	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,876,619.08	
T 1.5% 05/31/19	3,250,000.00	3,256,458.14	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,263,161.15	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,812,617.08	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,553,398.06	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,002,410.70	
T 1.5% 12/31/18	2,550,000.00	2,555,036.25	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,645,796.14	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,012,688.41	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,020,813.95	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,786,985.02	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,871,231.15	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	3,002,411.76	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	5,001,006.60	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,426,292.25	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,529,806.20	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,728,386.39	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,008,470.25	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,042,756.28	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,430,068.17	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,482,187.80	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,473,925.65	

T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,104,269.00
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,767,834.17
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,172,500.45
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	5,033,149.35
T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	1,975,441.10
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,010,506.16
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,209,378.50
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,496,090.85
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,242,854.50
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,979,895.48
T 1.875% 10/31/22	3,150,000.00	3,129,394.49
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,400,851.20
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,931,417.21
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,432,872.52
T 1% 09/15/18	5,200,000.00	5,180,922.39
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,961,556.68
T 1% 11/30/18	5,200,000.00	5,175,346.43
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,230,641.66
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,040,580.70
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,368,285.08
T 2.125% 05/15/25	8,700,000.00	8,594,262.72
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,592,298.00
T 2.125% 06/30/22	800,000.00	806,317.75
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,173,076.29
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,596,372.05
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,022,227.44
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,997,555.24
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,545,299.47
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,845,699.20
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,104,127.70
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,561,506.83
T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,352,996.60
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,049,637.43
T 2.25% 08/15/46	10,400,000.00	8,989,998.04
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,151,322.64
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,882,065.58
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	2,010,682.04
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,584,445.46
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,352,224.32
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,778,429.99
T 2.5% 02/15/46	17,550,000.00	16,050,139.79
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,562,522.19
T 2.5% 05/15/46	1,050,000.00	959,691.18

T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,650,380.37	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,665,430.48	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,333,957.69	
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,701,835.21	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,106,587.90	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,920,259.88	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,150,236.91	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,084,936.17	
T 2.875% 05/15/43	14,150,000.00	14,057,551.68	
T 2.875% 08/15/45	9,900,000.00	9,784,565.20	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,512,126.42	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,591,859.27	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,238,456.40	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,036,663.76	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,830,679.98	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,259,219.00	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,004,765.20	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,015,661.39	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,843,529.38	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,053,601.50	
T 2% 10/31/21	400,000.00	402,179.18	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,414,685.88	
T 2% 11/15/26	4,400,000.00	4,260,426.32	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,555,370.75	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,997,701.76	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,209,917.66	
T 3.125% 02/15/42	1,600,000.00	1,668,099.90	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,040,267.53	
T 3.125% 05/15/19	30,000,000.00	30,950,303.10	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,565,697.69	
T 3.125% 08/15/44	6,500,000.00	6,755,580.45	
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,502,595.89	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	6,098,898.42	
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	9,134,833.66	
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,342,997.50	
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,375,028.43	
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	5,864,728.26	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,670,451.90	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,822,714.08	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,265,442.38	
T 3.75% 08/15/41	3,900,000.00	4,499,369.78	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,160,446.65	

	T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,662,046.84
	T 3.875% 08/15/40	1,650,000.00	1,936,013.44
	T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,988,394.27
	T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,546,248.40
	T 3% 11/15/44	2,300,000.00	2,333,867.31
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,112,317.38
	T 4.25% 11/15/40	1,450,000.00	1,796,601.33
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,257,448.72
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,391,336.04
	T 4.375% 05/15/41	1,500,000.00	1,895,642.85
	T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,394,211.39
	T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,346,494.72
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,277,455.10
	T 4.5% 08/15/39	250,000.00	319,525.89
	T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	5,072,491.71
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,490,606.55
	T 5.25% 02/15/29	400,000.00	512,510.31
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,660,848.96
	T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,130,893.13
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,557,318.19
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,190,887.17
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,944,708.85
	T 6.25% 05/15/30	400,000.00	565,314.52
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,044,895.44
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,135,889.87
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,391,151.01
	<b>アメリカドル 小計</b>	<b>855,740,000.00</b>	<b>862,190,936.60</b> <b>(98,436,339,231)</b>
<b>カナダドル</b>	CAN 0.5% 02/01/19	3,200,000.00	3,168,704.00
	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,966,436.50
	CAN 0.5% 11/01/18	1,500,000.00	1,487,872.50
	CAN 0.75% 03/01/21	1,250,000.00	1,222,718.75
	CAN 0.75% 08/01/19	2,770,000.00	2,745,083.85
	CAN 0.75% 09/01/20	1,350,000.00	1,326,530.25
	CAN 0.75% 09/01/21	1,730,000.00	1,683,705.20
	CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	500,885.00
	CAN 1.5% 03/01/20	2,600,000.00	2,617,147.00
	CAN 1.5% 06/01/23	1,750,000.00	1,741,188.75
	CAN 1.5% 06/01/26	1,480,000.00	1,441,823.40
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,413,958.00
	CAN 1.75% 09/01/19	2,250,000.00	2,275,908.75
	CAN 1% 06/01/27	1,890,000.00	1,740,557.70
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,608,210.25

	CAN 2.5% 06/01/24	1,850,000.00	1,950,260.75
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,700,679.50
	CAN 2.75% 12/01/48	1,450,000.00	1,611,240.00
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	486,015.60
	CAN 3.25% 06/01/21	1,690,000.00	1,808,967.55
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,913,553.00
	CAN 3.5% 12/01/45	1,970,000.00	2,470,705.05
	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,352,928.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,890,000.00	2,489,177.25
	CAN 5.75% 06/01/29	1,200,000.00	1,673,886.00
	CAN 5.75% 06/01/33	1,700,000.00	2,532,260.50
	CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,314,192.00
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	558,477.00
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>50,000,000.00</b>	<b>53,803,072.10</b> <b>(4,766,952,188)</b>
<b>メキシコペソ</b>	MBONO 10% 11/20/36	10,650,000.00	13,744,197.75
	MBONO 10% 12/05/24	35,250,000.00	41,898,326.25
	MBONO 5.75% 03/05/26	17,350,000.00	16,170,547.00
	MBONO 5% 12/11/19	31,100,000.00	29,961,740.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	11,719,288.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	37,300,000.00	37,123,944.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	15,411,994.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	18,165,244.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	15,850,000.00	16,710,892.75
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,150,000.00	4,413,442.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	17,585,412.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	18,735,172.50
	MBONO 8.5% 12/13/18	25,300,000.00	25,848,504.00
	MBONO 8% 06/11/20	21,150,000.00	21,929,800.50
	MBONO 8% 11/07/47	4,750,000.00	5,156,742.50
	MBONO 8% 12/07/23	20,450,000.00	21,816,366.75
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>299,000,000.00</b>	<b>316,391,615.00</b> <b>(1,996,431,090)</b>
<b>ユーロ</b>	BGB 0.2% 10/22/23	750,000.00	748,113.75
	BGB 0.8% 06/22/25	2,650,000.00	2,694,029.75
	BGB 0.8% 06/22/27	500,000.00	494,032.50
	BGB 1.45% 06/22/37	550,000.00	538,199.75
	BGB 1.6% 06/22/47	700,000.00	652,193.50
	BGB 1.9% 06/22/38	760,000.00	801,264.20
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,145,150.00
	BGB 1% 06/22/31	1,200,000.00	1,157,328.00
	BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	346,146.50

BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,686,270.00
BGB 2.25% 06/22/57	400,000.00	414,670.00
BGB 2.6% 06/22/24	2,250,000.00	2,594,092.50
BGB 3.75% 06/22/45	1,150,000.00	1,638,928.25
BGB 3.75% 09/28/20	2,350,000.00	2,662,021.25
BGB 3% 06/22/34	1,650,000.00	2,055,355.50
BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,155,420.00
BGB 4.0% 03/28/19	790,000.00	851,908.35
BGB 4.25% 03/28/41	2,130,000.00	3,210,218.85
BGB 4.25% 09/28/21	2,100,000.00	2,494,852.50
BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,749,657.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,462,802.00
BGB 4% 03/28/22	1,500,000.00	1,790,955.00
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,411,609.85
BGB 5.5% 03/28/28	2,390,000.00	3,522,788.30
BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,532,530.00
BTPS 0.1% 04/15/19	1,000,000.00	1,003,975.00
BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,007,445.00
BTPS 0.35% 06/15/20	1,900,000.00	1,901,919.00
BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,737,642.00
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,393,644.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,238,042.00
BTPS 0.65% 11/01/20	3,900,000.00	3,933,228.00
BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,475,355.00
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,446,135.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,350,000.00	1,243,856.25
BTPS 1.35% 04/15/22	650,000.00	661,849.50
BTPS 1.5% 06/01/25	1,600,000.00	1,548,320.00
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,473,908.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,530,672.00
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,836,586.50
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,646,025.00
BTPS 2.2% 06/01/27	1,800,000.00	1,780,497.00
BTPS 2.25% 09/01/36	1,550,000.00	1,379,825.50
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,616,625.00
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,561,303.50
BTPS 2.7% 03/01/47	2,220,000.00	1,920,277.80
BTPS 2.8% 03/01/67	800,000.00	649,336.00
BTPS 2% 12/01/25	3,300,000.00	3,288,516.00
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,501,423.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,050,000.00	1,037,478.75
BTPS 3.5% 03/01/30	2,760,000.00	3,008,676.00
BTPS 3.5% 12/01/18	800,000.00	841,764.00

BTPS 3.75% 03/01/21	3,250,000.00	3,633,386.25	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,734,775.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,495,520.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	1,800,000.00	2,036,367.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,060,851.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,975,560.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,888,500.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,830,864.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,852,327.50	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,950,000.00	3,482,121.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	5,062,153.75	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,590,475.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	4,000,000.00	4,205,880.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,150,000.00	6,160,301.25	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,797,512.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,341,593.75	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,900,000.00	2,328,697.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,300,000.00	3,746,539.50	
BTPS 4% 09/01/20	3,550,000.00	3,955,836.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,450,000.00	3,125,024.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,665,521.25	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,145,246.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,350,000.00	2,874,238.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,668,179.50	
BTPS 5% 03/01/22	2,600,000.00	3,081,650.00	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,238,604.75	
BTPS 5% 08/01/34	2,950,000.00	3,749,125.50	
BTPS 5% 09/01/40	2,850,000.00	3,595,374.75	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,336,274.25	
BTPS 6% 05/01/31	4,200,000.00	5,774,349.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,000,915.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,161,676.00	
DBR 0.25% 02/15/27	3,500,000.00	3,395,280.00	
DBR 0.5% 02/15/25	3,100,000.00	3,159,830.00	
DBR 0.5% 02/15/26	4,450,000.00	4,484,220.50	
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,007,243.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,000,000.00	2,174,320.00	
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,212,712.25	
DBR 1.5% 05/15/24	1,690,000.00	1,848,057.25	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,572,662.75	
DBR 1.75% 02/15/24	1,300,000.00	1,443,104.00	
DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,382,280.00	

DBR 1% 08/15/24	1,680,000.00	1,779,414.00
DBR 1% 08/15/25	2,450,000.00	2,582,924.75
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,716,125.00
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,214,110.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,685,497.50
DBR 2.5% 07/04/44	2,650,000.00	3,343,346.00
DBR 2.5% 08/15/46	2,750,000.00	3,493,778.75
DBR 2% 01/04/22	3,150,000.00	3,469,914.00
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,354,142.00
DBR 3.25% 01/04/20	3,000,000.00	3,286,920.00
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,890,501.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,850,000.00	2,626,944.50
DBR 3.5% 07/04/19	5,800,000.00	6,276,412.00
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,425,207.25
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,868,777.50
DBR 4.0% 01/04/37	2,850,000.00	4,288,936.50
DBR 4.25% 07/04/18	6,050,000.00	6,344,937.50
DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,628,128.25
DBR 4.75% 07/04/28	1,740,000.00	2,490,357.60
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	3,956,262.50
DBR 4.75% 07/04/40	2,000,000.00	3,424,960.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,504,138.00
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,336,725.75
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,239,184.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,050,000.00	1,734,106.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,200,000.00	1,893,060.00
FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,561,232.50
FRTR 0.25% 11/25/26	1,750,000.00	1,653,155.00
FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,170,894.00
FRTR 0.5% 05/25/26	4,130,000.00	4,031,148.45
FRTR 0.5% 11/25/19	5,950,000.00	6,081,911.50
FRTR 0% 05/25/21	3,000,000.00	3,020,340.00
FRTR 0% 05/25/22	1,200,000.00	1,198,584.00
FRTR 1.25% 05/25/36	2,450,000.00	2,317,479.50
FRTR 1.5% 05/25/31	4,350,000.00	4,467,993.75
FRTR 1.75% 05/25/23	5,650,000.00	6,166,918.50
FRTR 1.75% 05/25/66	950,000.00	849,076.75
FRTR 1.75% 06/25/39	750,000.00	759,206.25
FRTR 1.75% 11/25/24	4,550,000.00	4,966,689.00
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,340,805.00
FRTR 1% 05/25/27	2,150,000.00	2,161,975.50
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,553,100.00
FRTR 1% 11/25/25	4,250,000.00	4,360,691.25

FRTR 2.25% 05/25/24	3,450,000.00	3,889,961.25	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,571,397.50	
FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	4,041,187.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,956,087.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,950,000.00	5,809,171.50	
FRTR 2% 05/25/48	850,000.00	857,900.75	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	3,964,222.25	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	5,953,974.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	7,200,000.00	7,980,948.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,230,000.00	5,228,597.25	
FRTR 3.75% 04/25/21	3,950,000.00	4,545,324.25	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,474,678.80	
FRTR 3% 04/25/22	4,800,000.00	5,497,344.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	5,250,000.00	5,701,368.75	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,142,755.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,443,989.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,010,000.00	6,197,114.15	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,250,000.00	4,931,550.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	2,671,060.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,450,000.00	2,254,960.25	
FRTR 4% 10/25/38	3,250,000.00	4,656,421.25	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,050,000.00	4,540,962.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,614,222.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,455,592.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,482,505.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,350,854.40	
IRISH 0.8% 03/15/22	450,000.00	465,941.25	
IRISH 1.7% 05/15/37	470,000.00	462,475.30	
IRISH 1% 05/15/26	1,230,000.00	1,234,360.35	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,090,000.00	1,225,416.15	
IRISH 2% 02/18/45	880,000.00	879,612.80	
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,072,858.50	
IRISH 3.9% 03/20/23	900,000.00	1,086,061.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,202,998.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,355,995.20	
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	945,847.50	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,888,495.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	800,000.00	913,824.00	
IRISH 5% 10/18/20	450,000.00	527,733.00	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,900,000.00	1,937,553.50	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,663,644.45	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,950,000.00	1,931,270.25	

NETHER 0.75% 07/15/27	1,290,000.00	1,287,639.30
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,812,249.00
NETHER 1.25% 01/15/19	900,000.00	925,798.50
NETHER 1.75% 07/15/23	1,500,000.00	1,648,807.50
NETHER 2.25% 07/15/22	2,970,000.00	3,318,559.20
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,872,934.75
NETHER 2.75% 01/15/47	1,450,000.00	1,910,570.75
NETHER 2% 07/15/24	2,000,000.00	2,239,630.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,342,401.75
NETHER 3.5% 07/15/20	1,750,000.00	1,959,641.25
NETHER 3.75% 01/15/23	750,000.00	904,980.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,920,000.00	2,898,873.60
NETHER 4.0% 07/15/18	3,150,000.00	3,299,262.75
NETHER 4% 01/15/37	1,880,000.00	2,809,819.80
NETHER 4% 07/15/19	1,220,000.00	1,333,441.70
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,358,208.50
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	282,668.00
OBL 0.25% 10/11/19	1,150,000.00	1,171,608.50
OBL 0.25% 10/16/20	1,350,000.00	1,380,948.75
OBL 0.5% 04/12/19	1,440,000.00	1,469,008.80
OBL 0% 04/17/20	1,600,000.00	1,623,536.00
OBL 0% 10/08/21	2,350,000.00	2,377,342.25
OBL 1% 02/22/19	1,450,000.00	1,489,490.75
OBL 1% 10/12/18	900,000.00	919,080.00
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,066,910.25
RAGB 0.75% 10/20/26	2,300,000.00	2,304,807.00
RAGB 1.15% 10/19/18	400,000.00	408,686.00
RAGB 1.2% 10/20/25	1,600,000.00	1,685,216.00
RAGB 1.5% 02/20/47	410,000.00	391,521.30
RAGB 1.65% 10/21/24	1,200,000.00	1,309,260.00
RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	1,922,243.75
RAGB 1.95% 06/18/19	950,000.00	995,353.00
RAGB 2.4% 05/23/34	750,000.00	882,971.25
RAGB 3.15% 06/20/44	850,000.00	1,136,909.00
RAGB 3.4% 11/22/22	1,300,000.00	1,535,462.50
RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,044,217.25
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,295,860.50
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	671,111.70
RAGB 3.9% 07/15/20	1,720,000.00	1,941,751.00
RAGB 4.15% 03/15/37	1,500,000.00	2,227,342.50
RAGB 4.35% 03/15/19	1,550,000.00	1,677,619.25
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,297,277.25
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,309,021.25

RFGB 0.375% 09/15/20	860,000.00	880,111.10
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	564,784.50
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	517,244.40
RFGB 0.875% 09/15/25	550,000.00	565,501.75
RFGB 0% 04/15/22	220,000.00	220,830.50
RFGB 0% 09/15/23	490,000.00	484,252.30
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	561,574.75
RFGB 1.5% 04/15/23	900,000.00	972,787.50
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	639,866.80
RFGB 2.625% 07/04/42	550,000.00	693,170.50
RFGB 2.75% 07/04/28	560,000.00	672,616.00
RFGB 2% 04/15/24	520,000.00	579,709.00
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	774,039.00
RFGB 3.5% 04/15/21	740,000.00	845,191.00
RFGB 4.375% 07/04/19	670,000.00	735,924.65
RFGB 4% 07/04/25	800,000.00	1,023,132.00
SPGB 0.25% 01/31/19	140,000.00	141,039.50
SPGB 0.4% 04/30/22	1,250,000.00	1,248,618.75
SPGB 0.75% 07/30/21	2,850,000.00	2,916,348.00
SPGB 1.15% 07/30/20	3,700,000.00	3,830,480.50
SPGB 1.3% 10/31/26	2,100,000.00	2,045,347.50
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,449,998.60
SPGB 1.5% 04/30/27	1,950,000.00	1,910,814.75
SPGB 1.6% 04/30/25	1,350,000.00	1,381,124.25
SPGB 1.95% 04/30/26	2,500,000.00	2,592,112.50
SPGB 1.95% 07/30/30	2,750,000.00	2,693,872.50
SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,747,202.50
SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,369,835.00
SPGB 2.75% 10/31/24	2,950,000.00	3,275,488.25
SPGB 2.9% 10/31/46	1,250,000.00	1,223,131.25
SPGB 3.45% 07/30/66	700,000.00	714,598.50
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,475,691.00
SPGB 3.8% 04/30/24	2,100,000.00	2,481,213.00
SPGB 4.1% 07/30/18	3,280,000.00	3,433,750.00
SPGB 4.2% 01/31/37	2,800,000.00	3,485,006.00
SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,296,454.50
SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,132,296.25
SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,325,818.90
SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,253,640.00
SPGB 4.7% 07/30/41	1,950,000.00	2,597,341.50
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,801,947.00
SPGB 4.85% 10/31/20	2,500,000.00	2,895,337.50

	SPGB 4.9% 07/30/40	1,850,000.00	2,520,652.75
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,338,565.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,650,000.00	4,848,021.25
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,500,000.00	2,116,342.50
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,000,000.00	3,782,205.00
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,609,270.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,670,000.00	3,865,479.15
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,563,654.25
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,252,460.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,491,593.25
	ユーロ 小計	602,850,000.00	693,851,789.45 (90,297,871,879)
イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	2,050,000.00	2,030,894.00
	UKT 1.25% 07/22/18	3,780,000.00	3,816,250.20
	UKT 1.25% 07/22/27	700,000.00	691,978.00
	UKT 1.5% 01/22/21	3,430,000.00	3,554,526.15
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,660,567.00
	UKT 1.5% 07/22/47	1,550,000.00	1,394,728.75
	UKT 1.75% 07/22/19	5,050,000.00	5,196,020.75
	UKT 1.75% 07/22/57	900,000.00	881,743.50
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	3,006,408.00
	UKT 1.75% 09/07/37	800,000.00	775,632.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,900,000.00	3,148,022.50
	UKT 2.5% 07/22/65	1,700,000.00	2,100,690.00
	UKT 2.75% 09/07/24	2,250,000.00	2,530,451.25
	UKT 2% 07/22/20	5,100,000.00	5,344,723.50
	UKT 2% 09/07/25	2,690,000.00	2,882,348.45
	UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	3,653,608.50
	UKT 3.5% 01/22/45	3,000,000.00	3,966,630.00
	UKT 3.5% 07/22/68	2,250,000.00	3,558,453.75
	UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,036,357.50
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	590,928.25
	UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	829,286.25
	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,269,530.00
	UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,653,727.25
	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,609,304.75
	UKT 4.25% 09/07/39	1,700,000.00	2,407,327.50
	UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,851,876.00
	UKT 4.25% 12/07/40	2,100,000.00	3,007,819.50
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,171,220.50
	UKT 4.25% 12/07/49	1,670,000.00	2,612,197.30
	UKT 4.25% 12/07/55	1,920,000.00	3,199,056.00
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,459,735.00

	UKT 4.5% 09/07/34	2,650,000.00	3,708,741.25
	UKT 4.5% 12/07/42	2,200,000.00	3,320,042.00
	UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,960,845.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,800,000.00	2,490,633.00
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,853,239.50
	UKT 4% 01/22/60	2,000,000.00	3,308,160.00
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,679,585.75
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,460,994.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,858,262.50
	UKT 8% 06/07/21	1,050,000.00	1,358,479.50
イギリスポンド 小計		88,530,000.00	108,891,024.60 (16,036,381,192)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	435,778.00
	SWISS 2% 04/28/21	1,000,000.00	1,099,760.00
	SWISS 3% 05/12/19	350,000.00	374,857.00
	SWISS 4% 02/11/23	710,000.00	886,321.40
	SWISS 4% 04/08/28	530,000.00	754,346.35
スイスフラン 小計		2,990,000.00	3,551,062.75 (420,516,850)
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	4,500,000.00	4,425,547.50
	SGB 1.5% 11/13/23	10,200,000.00	11,009,472.00
	SGB 1% 11/12/26	7,550,000.00	7,767,628.75
	SGB 2.5% 05/12/25	7,650,000.00	8,841,564.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,500,000.00	7,351,135.00
	SGB 3.5% 06/01/22	10,800,000.00	12,671,532.00
	SGB 4.25% 03/12/19	12,400,000.00	13,431,308.00
	SGB 5% 12/01/20	11,800,000.00	13,954,031.00
スウェーデンクローナ 小計		70,400,000.00	79,452,218.25 (1,075,783,035)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,620,000.00	4,585,188.30
	NGB 1.75% 02/17/27	3,200,000.00	3,219,152.00
	NGB 1.75% 03/13/25	4,900,000.00	4,988,616.50
	NGB 2% 05/24/23	6,900,000.00	7,194,009.00
	NGB 3.75% 05/25/21	10,150,000.00	11,229,554.00
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,126,645.00
	NGB 4.5% 05/22/19	9,750,000.00	10,452,097.50
ノルウェークローネ 小計		45,070,000.00	47,795,262.30 (653,361,235)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/18	6,100,000.00	6,168,411.50
	DGB 0.5% 11/15/27	3,700,000.00	3,604,484.50
	DGB 1.5% 11/15/23	6,600,000.00	7,158,492.00
	DGB 1.75% 11/15/25	10,300,000.00	11,399,010.00

	DGB 3% 11/15/21	11,850,000.00	13,484,411.25
	DGB 4.5% 11/15/39	15,650,000.00	25,593,071.00
	DGB 4% 11/15/19	11,000,000.00	12,161,380.00
デンマーククローネ 小計		65,200,000.00	79,569,260.25 (1,392,462,054)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	4,200,000.00	4,134,795.00
	POLGB 1.75% 07/25/21	4,650,000.00	4,517,754.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,150,000.00	2,106,000.25
	POLGB 2.5% 07/25/18	7,200,000.00	7,269,336.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,500,000.00	4,241,992.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,550,000.00	2,365,418.25
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,446,222.50
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,000,000.00	2,055,870.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,705,760.00
	POLGB 4% 10/25/23	4,550,000.00	4,835,103.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,530,000.00	2,770,387.95
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,807,974.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	950,000.00	1,176,893.25
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,308,977.75
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,299,994.50
ポーランドズロチ 小計		49,100,000.00	50,042,478.95 (1,536,304,103)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,250,000.00	2,228,490.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,030,000.00	1,929,677.40
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	2,990,141.70
	ACGB 2.75% 06/21/35	800,000.00	750,780.00
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,498,559.00
	ACGB 2.75% 11/21/27	2,450,000.00	2,452,597.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,600,000.00	1,591,624.00
	ACGB 2% 12/21/21	1,900,000.00	1,885,465.00
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,350,000.00	3,508,890.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,150,000.00	2,240,310.75
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	636,675.00
	ACGB 3.25% 10/21/18	2,150,000.00	2,193,462.25
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,602,180.00
	ACGB 3% 03/21/47	1,000,000.00	895,360.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,960,000.00	4,455,693.00
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,470,000.00	3,708,163.45
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,400,000.00	1,656,060.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,350,000.00	3,942,313.50
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,200,000.00	3,385,552.00
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,300,000.00	3,860,373.00
ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,480,761.50	

	ACGB 5.75% 07/15/22	2,570,000.00	2,993,664.50
オーストラリアドル 小計		52,420,000.00	55,886,793.55 (4,853,209,151)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	247,136.25
	SIGB 1.625% 10/01/19	160,000.00	161,028.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	100,000.00	100,687.50
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	249,937.50
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	892,076.25
	SIGB 2.375% 06/01/25	270,000.00	275,539.05
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,150,000.00	1,176,082.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	440,000.00	460,891.20
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	650,237.40
	SIGB 2.75% 07/01/23	560,000.00	587,613.60
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	211,439.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	494,357.75
	SIGB 2% 07/01/20	400,000.00	406,732.00
	SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	769,557.60
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	622,771.55
	SIGB 3.375% 09/01/33	680,000.00	761,351.80
	SIGB 3.5% 03/01/27	850,000.00	944,460.50
	SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	820,257.90
	SIGB 4% 09/01/18	980,000.00	1,011,286.50
シンガポールドル 小計		10,330,000.00	10,843,443.35 (895,993,724)
マレーシアリングgit	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,452,537.50
	MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	2,001,948.00
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	1,998,190.00
	MGS 3.502% 05/31/27	2,100,000.00	1,976,824.50
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,157,095.00
	MGS 3.654% 10/31/19	1,050,000.00	1,053,554.25
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,231,529.00
	MGS 3.795% 09/30/22	500,000.00	500,215.00
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,072,058.75
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,511,310.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,102,230.25
	MGS 3.955% 09/15/25	1,390,000.00	1,402,516.95
	MGS 4.048% 09/30/21	3,100,000.00	3,135,727.50
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,388,723.00
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,673,298.00
	MGS 4.181% 07/15/24	2,350,000.00	2,378,799.25
	MGS 4.232% 06/30/31	650,000.00	635,453.00
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,243,329.00
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,840,806.00

	MGS 4.498% 04/15/30	500,000.00	502,885.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	700,000.00	716,149.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,600,000.00	1,630,936.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,052,066.50	
	マレーシアリンギット 小計	36,720,000.00	36,658,181.45	(973,641,299)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	22,400,000.00	24,613,568.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,715,866.30	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,850,000.00	6,106,986.75	
	SAGB 6.75% 03/31/21	5,900,000.00	5,684,325.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,550,000.00	7,462,986.25	
	SAGB 7.75% 02/28/23	8,300,000.00	8,088,308.50	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,423,587.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	7,400,000.00	6,591,365.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	11,550,000.00	10,161,805.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	12,450,000.00	10,987,125.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,212,445.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	8,900,000.00	8,191,426.50	
	SAGB 8% 01/31/30	11,100,000.00	9,922,456.50	
	SAGB 8% 12/21/18	4,850,000.00	4,877,160.00	
	SAGB 9% 01/31/40	9,900,000.00	9,029,097.00	
	南アフリカランド 小計	155,520,000.00	141,068,509.05	(1,200,493,012)
	合計		224,535,740,043	(224,535,740,043)

## 有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 177銘柄	100.0%	43.8%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 274銘柄	100.0%	40.2%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%

デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	23銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成29年 7月10日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	930,482,866
投資証券	64,747,011,800
未収入金	9,813,592
未収配当金	520,086,648
前払金	74,316,200
差入委託証拠金	21,364,000
流動資産合計	66,303,075,106
資産合計	66,303,075,106
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	74,316,200
未払金	191,934,637
未払解約金	23,374,821
未払利息	1,781
その他未払費用	1,758
流動負債合計	289,629,197
負債合計	289,629,197
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	44,608,650,090
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	21,404,795,819
元本等合計	66,013,445,909
純資産合計	66,013,445,909
負債純資産合計	66,303,075,106

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	44,608,650,090口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4798円 (1万口当たり純資産額) (14,798円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成29年 7月10日現在	
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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(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・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成29年 7月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	45,267,258,989円
期中追加設定元本額	6,195,070,649円
期中一部解約元本額	6,853,679,548円
期末元本額	44,608,650,090円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,668,983,742円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,721,573円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	10,131,182,590円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	19,411,217,742円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,184,074,061円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,464,002,574円
分散投資コア戦略ファンドA	914,925,555円
分散投資コア戦略ファンドS	1,863,424,939円
コア投資戦略ファンド（切替型）	902,539,329円
J - R E I T インデックス・オープン	302,914,416円

区分	平成29年 7月10日現在
SMT インデックスバランス・オープン	39,958,597円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	683,002,632円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	1,395,583円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,030,306,757円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		3,880,073,770
合計		3,880,073,770

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「J-REITインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（平成29年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	1,324,873,200	-	1,250,557,000	74,316,200
合計		1,324,873,200	-	1,250,557,000	74,316,200

## (注)1.時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,906	1,284,452,000	
	MCUBS MidCity投資法人	1,770	574,365,000	
	森ヒルズリート投資法人	9,396	1,275,037,200	
	産業ファンド投資法人	2,376	1,207,008,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	8,098	2,190,509,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	1,984	535,878,400	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	3,780	1,723,680,000	
	GLP投資法人	15,313	1,796,214,900	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,190	726,044,000	
	日本プロロジスリート投資法人	10,232	2,438,285,600	
	星野リゾート・リート投資法人	1,088	622,336,000	
	Oneリート投資法人	956	201,142,400	
	イオンリート投資法人	7,674	938,530,200	
	ヒューリックリート投資法人	5,609	954,090,900	
	日本リート投資法人	2,350	699,830,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,892	501,919,200	
	日本ヘルスケア投資法人	424	71,316,800	
	積水ハウス・リート投資法人	5,486	715,923,000	
	トーセイ・リート投資法人	1,099	116,054,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	3,180	733,626,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,078	109,309,200	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,519	129,874,500	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	482	70,082,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人	25,093	3,743,875,600	
	いちごホテルリート投資法人	1,382	153,816,600	
	ラサールロジポート投資法人	6,598	726,439,800	
	スターアジア不動産投資法人	1,816	195,946,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	488	45,237,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,414	446,824,000	
	大江戸温泉リート投資法人	1,113	96,051,900	
	さくら総合リート投資法人	2,103	173,707,800	
	投資法人みらい	1,113	191,992,500	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	1,894	283,721,200	
	日本ビルファンド投資法人	8,470	4,827,900,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,267	4,571,651,000	
	日本リテールファンド投資法人	16,826	3,447,647,400	
	オリックス不動産投資法人	16,875	2,708,437,500	
	日本プライムリアルティ投資法人	5,522	2,134,253,000	
	プレミア投資法人	7,900	849,250,000	
	東急リアル・エステート投資法人	5,864	784,603,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,404	524,394,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	19,290	3,007,311,000	

森トラスト総合リート投資法人	6,251	1,104,551,700
インヴィンシブル投資法人	19,502	913,668,700
フロンティア不動産投資法人	2,975	1,338,750,000
平和不動産リート投資法人	5,447	464,629,100
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,557	1,253,103,500
福岡リート投資法人	4,245	704,245,500
ケネディクス・オフィス投資法人	2,557	1,498,402,000
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	6,631	756,597,100
いちごオフィスリート投資法人	6,773	456,500,200
大和証券オフィス投資法人	1,886	1,027,870,000
阪急リート投資法人	3,584	475,238,400
スタートアップリート投資法人	1,378	201,877,000
大和ハウスリート投資法人	8,996	2,323,666,800
ジャパン・ホテル・リート投資法人	25,244	1,936,214,800
日本賃貸住宅投資法人	9,838	791,959,000
ジャパンエクセレント投資法人	7,832	971,168,000
合計	347,010	64,747,011,800

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成29年 7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	204,161,736
コール・ローン	150,153,764
投資証券	61,447,547,406
派生商品評価勘定	2,400
未収入金	330,403,012
未収配当金	249,490,909
流動資産合計	62,381,759,227
資産合計	62,381,759,227
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,105,710
未払金	86,078,941

	平成29年 7月10日現在
項目	金額（円）
未払解約金	280,651,816
未払利息	287
その他未払費用	71
流動負債合計	367,836,825
負債合計	367,836,825
純資産の部	
元本等	
元本	36,171,010,023
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,842,912,379
元本等合計	62,013,922,402
純資産合計	62,013,922,402
負債純資産合計	62,381,759,227

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	平成29年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		36,171,010,023口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7145円 (17,145円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年 7月10日現在
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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、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、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

<p>3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
----------------------------------	--

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	35,442,487,874円
期中追加設定元本額	7,756,697,763円
期中一部解約元本額	7,028,175,614円
期末元本額	36,171,010,023円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	201,936,060円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,613,235,944円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,070,702円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	7,523,123,266円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	17,856,130,346円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,288,884,039円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,315,377,612円

分散投資コア戦略ファンドA	581,968,095円
分散投資コア戦略ファンドS	1,154,359,099円
コア投資戦略ファンド（切替型）	542,097,133円
グローバルREITインデックス・オープン	33,642,851円
SMT インデックスバランス・オープン	211,878,920円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	790,665,389円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	388,468,001円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	659,172,566円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		2,230,359,015
合計		2,230,359,015

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成29年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	180,081,590	-	181,184,900	1,103,310
	アメリカドル	106,581,000	-	107,309,000	728,000
	カナダドル	17,717,000	-	17,718,000	1,000
	ユーロ	10,341,040	-	10,411,200	70,160
	イギリスポンド	5,872,200	-	5,890,400	18,200
	オーストラリアドル	14,587,530	-	14,761,100	173,570

	ニュージーランド ドル	5,775,140	-	5,810,000	34,860
	香港ドル	19,207,680	-	19,285,200	77,520
	合計	180,081,590	-	181,184,900	1,103,310

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	39,900	1,109,619.00	
		AGREE REALTY CORP	12,000	555,240.00	
		ALEXANDER'S INC	1,790	754,968.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,160	5,234,284.80	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	21,510	844,482.60	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	64,020	2,940,438.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	114,646	2,577,242.08	
		APARTMENT INVEST & MGMT	75,533	3,221,482.45	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	73,003	1,357,125.77	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	25,870	330,877.30	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	14,500	146,595.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	278,021.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,090	12,700,137.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	114,570.00	
		BOSTON PROPERTIES	74,800	8,985,724.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	88,858	1,507,031.68	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	126,930	2,270,777.70	

CAMDEN PROPERTY TRUST	42,610	3,672,982.00	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	42,795	1,099,403.55	
CARETRUST REIT INC	38,680	705,523.20	
CBL & ASSOCIATES PRTYS	86,840	719,903.60	
CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	158,152.50	
CHATHAM LODGING TRUST	18,110	362,562.20	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	29,960	742,708.40	
CITY OFFICE REIT INC	8,000	99,600.00	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	268,195	3,859,326.05	
COLONY STARWOOD HOMES	60,920	2,064,578.80	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	57,860	1,284,492.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	7,200	188,280.00	
CORECIVIC INC	58,220	1,601,050.00	
CORESITE REALTY CORP	16,930	1,744,975.10	
CORPORATE OFFICE PPTYS	49,030	1,714,088.80	
COUSINS PROPERTIES INC	208,783	1,824,763.42	
CUBESMART	87,050	2,039,581.50	
CYRUSONE INC	37,450	2,064,993.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	45,917	2,433,601.00	
DDR CORPORATION	148,209	1,345,737.72	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	93,570	1,070,440.80	
DIGITAL REALTY TRUST INC	77,660	8,554,249.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	71,841	2,734,268.46	
DUKE REALTY CORP	173,710	4,811,767.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	38,364	2,286,878.04	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	10,600	216,240.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	16,810	1,370,015.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	34,626	1,316,134.26	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	63,310	1,290,257.80	
EPR PROPERTIES	30,830	2,201,570.30	
EQUITY COMMONWEALTH	61,730	1,942,643.10	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	39,370	3,345,662.60	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	177,650	11,543,697.00	
ESSEX PROPERTY TRUST	31,870	8,150,433.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	61,300	4,691,289.00	
FARMLAND PARTNERS INC	13,000	113,750.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,690	4,380,653.20	
FELCOR LODGING TRUST INC	64,920	461,581.20	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	55,950	1,595,134.50	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	26,460	295,558.20	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	104,580	2,473,317.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,106	684,155.44	

FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	588,034.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	93,670	3,477,030.40
GEO GROUP INC/THE	61,050	1,800,975.00
GETTY REALTY CORP	13,132	331,714.32
GGP INC	280,890	6,393,056.40
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,150	216,601.00
GLOBAL NET LEASE INC	25,910	563,801.60
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	45,930	822,147.00
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	73,966	2,203,447.14
HCP INC	227,470	7,099,338.70
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	58,510	1,950,723.40
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	94,000	2,833,160.00
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	326,119.50
HIGHWOODS PROPERTIES INC	50,750	2,542,575.00
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	81,813	2,377,485.78
HOST HOTELS AND RESORTS INC	362,590	6,620,893.40
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	77,900	2,545,772.00
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	31,000	306,280.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	391,645.70
INVITATION HOMES INC	39,100	838,695.00
IRON MOUNTAIN INC	119,222	4,104,813.46
ISTAR INC	35,000	417,550.00
KILROY REALTY CORPORATION	47,600	3,477,180.00
KIMCO REALTY CORP	205,000	3,778,150.00
KITE REALTY GROUP TRUST	41,390	776,062.50
LASALLE HOTEL PROPERTIES	54,070	1,627,507.00
LEXINGTON CORP PROPERTIES	107,306	1,060,183.28
LIBERTY PROPERTY TRUST	70,224	2,846,178.72
LIFE STORAGE INC	23,530	1,677,218.40
LTC PROPERTIES INC	19,700	992,289.00
MACERICH CO/THE	58,940	3,379,030.20
MACK-CALI REALTY CORP	46,180	1,236,700.40
MANULIFE US REAL ESTATE INV	270,000	245,700.00
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	11,500	142,255.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	176,160	2,189,668.80
MID-AMERICA APARTMENT COMM	55,408	5,672,116.96
MONMOUTH REIT -CL A	33,500	507,860.00
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	84,250	1,002,575.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	73,230	2,813,496.60
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	20,000	446,000.00
NATL HEALTH INVESTORS INC	20,480	1,587,814.40
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	401,200.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	248,100.00

NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	375,822.30	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	96,746	3,153,919.60	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	187,840.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	70,830	1,901,785.50	
PARKWAY INC	20,326	463,636.06	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	32,350	1,056,551.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	360,301.90	
PHYSICIANS REALTY TRUST	86,040	1,636,480.80	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,350	1,429,303.50	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	14,000	216,300.00	
PROLOGIS INC	258,380	14,921,445.00	
PS BUSINESS PARKS INC	9,620	1,248,291.20	
PUBLIC STORAGE	72,419	14,992,905.57	
QTS REALTY TRUST INC	24,450	1,249,639.50	
QUALITY CARE PROPERTIES	43,944	761,549.52	
RAMCO-GERSHENSON PRYS	39,850	508,087.50	
REALTY INCOME CORP	132,610	7,252,440.90	
REGENCY CENTERS CORP	71,380	4,452,684.40	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	53,940	1,042,660.20	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	116,650	1,412,631.50	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	32,790	900,413.40	
RLJ LODGING TRUST	60,700	1,190,934.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25,000	1,597,750.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,420	750,847.20	
SAUL CENTERS INC	6,700	396,506.00	
SELECT INCOME REIT	30,920	732,804.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	114,730	2,256,739.10	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	12,000	502,800.00	
SIMON PROPERTY GROUP	151,427	23,719,525.28	
SL GREEN REALTY CORP	49,940	5,115,354.20	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	232,800	1,732,032.00	
STAG INDUSTRIAL INC	41,130	1,117,502.10	
STORE CAPITAL CORP	83,470	1,858,042.20	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	46,380	856,638.60	
SUN COMMUNITIES INC	33,960	2,958,934.80	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	106,990	1,719,329.30	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,060	1,273,107.00	
TAUBMAN CENTERS INC	28,590	1,671,085.50	
TERRENO REALTY CORP	22,660	765,908.00	
TIER REIT INC	21,060	386,029.80	
UDR INC	128,580	4,907,898.60	
UMH PROPERTIES INC	14,000	234,080.00	

	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	476,053.80
	URBAN EDGE PROPERTIES	48,605	1,181,101.50
	URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	330,000.00
	VENTAS INC	171,720	11,585,948.40
	VEREIT INC	473,450	3,853,883.00
	VORNADO REALTY TRUST	83,640	7,855,468.80
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	91,000	764,400.00
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	36,940	1,158,807.80
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	56,410	1,683,838.50
	WELLTOWER INC	177,270	12,922,983.00
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	4,000	41,360.00
	WHITESTONE REIT	13,600	167,144.00
	WP CAREY INC	52,570	3,480,134.00
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,380	1,082,679.00
	アメリカドル 小計	10,835,340	386,896,099.91 (44,171,927,726)
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	67,456.00
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	20,900	799,216.00
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	34,460	445,567.80
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,110	518,503.70
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	32,850	1,074,852.00
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	16,260	734,301.60
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,100	336,089.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	45,000	583,200.00
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	299,577.90
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	206,006.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	33,000	360,690.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	13,650	116,844.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	25,290	478,233.90
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,010	614,071.30
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	67,620	1,492,373.40
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18,000	142,920.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	224,100.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	119,691.30
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	195,280.40
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	11,403	234,217.62
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	21,390	225,878.40
	ONEREIT	25,000	92,250.00
	PLAZA RETAIL REIT	25,650	112,090.50

	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	70,000	469,700.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	77,820	1,890,247.80
	SLATE OFFICE REI	9,400	73,038.00
	SLATE RETAIL REIT	7,000	92,890.00
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	30,610	966,969.90
	カナダドル 小計	715,860	12,966,256.52 (1,148,810,327)
ユーロ	AEDIFICA	9,125	690,762.50
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	52,957	612,712.49
	ALTAREA	1,750	336,962.50
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	31,350	466,174.50
	BEFIMMO S.C.A.	11,560	594,762.00
	BENI STABILI SPA	547,000	350,080.00
	COFINIMMO	9,860	1,050,583.00
	EUROCOMMERCIAL	24,100	825,425.00
	FONCIERE DES REGIONS	25,620	2,088,030.00
	GECINA SA	19,590	2,622,121.50
	GREEN REIT PLC	337,170	472,038.00
	HAMBORNER REIT AG	40,000	357,000.00
	HIBERNIA REIT PLC	338,290	466,840.20
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	50,080	719,900.00
	ICADE	22,420	1,623,208.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	157,540	125,244.30
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,900	151,179.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	160,000	214,400.00
	KLEPIERRE	101,190	3,562,899.90
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	364,641.12
	MERCIALYS	25,020	427,216.50
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	227,890	2,525,021.20
	MONTEA	2,900	138,895.50
	NSI NV	7,236	232,022.34
	RETAIL ESTATES	2,600	204,256.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	48,220	10,297,381.00
	VASTNED RETAIL	9,300	337,915.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,897	729,524.86
	WERELDHAVE BELGIUM	1,000	98,630.00
	WERELDHAVE NV	20,180	851,999.60
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,800	65,718.00
	ユーロ 小計	2,346,937	33,603,544.51 (4,373,165,282)
イギリスポンド	ASSURA PLC	864,900	555,265.80
	BIG YELLOW GROUP PLC	70,290	548,262.00

	BRITISH LAND CO PLC	498,920	3,033,433.60
	CAPITAL & REGIONAL PLC	220,000	123,200.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,000	104,125.00
	DERWENT LONDON PLC	54,240	1,433,020.80
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	240,000	267,600.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	162,393	967,862.28
	HAMMERSON PLC	389,430	2,223,645.30
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	383,580	471,803.40
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	74,000	76,960.00
	INTU PROPERTIES PLC	428,960	1,147,468.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	386,440	3,918,501.60
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	343,070	567,437.78
	LXI REIT PLC	68,000	71,570.00
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	39,967	91,424.51
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	28,000	144,060.00
	NEWRIVER REIT PL	110,000	385,000.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	281,000	316,125.00
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	722,000	282,735.20
	REGIONAL REIT LTD	92,000	97,290.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	97,990	414,399.71
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	159,375.00
	SEGREO PLC	491,990	2,368,439.86
	SHAFTESBURY PLC	133,100	1,294,397.50
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	677,830	979,464.35
	UNITE GROUP PLC	110,000	704,000.00
	WORKSPACE GROUP PLC	54,920	475,058.00
	イギリスポンド 小計	7,371,020	23,221,924.69 (3,419,892,849)
オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	110,000	107,800.00
	ABACUS PROPERTY GROUP	122,010	370,910.40
	ALE PROPERTY GROUP	92,000	428,720.00
	ARENA REIT	114,000	250,800.00
	ASPEN GROUP	70,000	81,200.00
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	21,820	139,648.00
	BWP TRUST	247,960	726,522.80
	CHARTER HALL GROUP	240,600	1,296,834.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	91,000	374,010.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	159,170	643,046.80
	CROMWELL PROPERTY GROUP	575,940	538,503.90
	DEXUS PROPERTY GROUP	487,800	4,585,320.00
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	283,374.00
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	220,817.76
	GOODMAN GROUP	769,050	6,113,947.50

	GPT GROUP	870,285	4,151,259.45
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	105,200	331,380.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	233,220.00
	INDUSTRIA REIT	75,000	170,250.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,000	235,800.00
	INVESTA OFFICE FUND	293,190	1,301,763.60
	MIRVAC GROUP	1,834,280	3,870,330.80
	NATIONAL STORAGE REIT	233,217	349,825.50
	PROPERTYLINK GROUP	250,000	210,000.00
	SCENTRE GROUP	2,606,030	10,528,361.20
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	342,000	735,300.00
	STOCKLAND	1,173,810	5,035,644.90
	VICINITY CENTERS	1,562,771	3,969,438.34
	VIVA ENERGY REIT	230,000	519,800.00
	WESTFIELD CORP	922,040	7,320,997.60
	オーストラリアドル 小計	14,087,461	55,124,826.55 (4,787,039,937)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	429,525.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	530,000	662,500.00
	INVESTORE PROPERTY LTD	102,000	138,720.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	612,000	865,980.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	460,000	568,100.00
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	220,000	361,900.00
	STRIDE STAPLED GROUP	174,000	301,020.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	177,460	398,397.70
	ニュージーランドドル 小計	2,690,460	3,726,142.70 (309,307,105)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,063,000	5,623,270.00
	FORTUNE REIT	659,000	6,234,140.00
	LINK REIT	1,071,000	63,081,900.00
	PROSPERITY REIT	592,000	1,953,600.00
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	447,000	1,037,040.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	393,000	1,328,340.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000	2,610,210.00
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	499,000	2,450,090.00
	香港ドル 小計	5,245,000	84,318,590.00 (1,232,737,785)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	280,000	411,600.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	430,000	352,600.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,215,166	3,159,431.60
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	561,000	656,370.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	415,200	390,288.00

	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,008,000	1,708,560.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,314,100	2,569,065.50	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	356,560	582,975.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	339,000	545,790.00	
	ESR REIT	521,000	312,600.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	256,740.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	258,000	345,720.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	293,800	616,980.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	240,000	340,800.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	558,200	586,110.00	
	KEPPEL DC REIT	369,460	467,366.90	
	KEPPEL REIT	845,300	963,642.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	429,300.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	866,130	1,364,154.75	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	911,700	984,636.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	585,760	1,074,869.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	711,320	850,027.40	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	240,000	172,800.00	
	OUE HOSPITALITY TRUST	590,000	442,500.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	518,760.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	220,128.40	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	234,476.00	
	SPH REIT	375,000	375,000.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	746,300	589,577.00	
	SUNTEC REIT	1,270,200	2,362,572.00	
	シンガポールドル 小計	17,641,936	23,885,440.75 (1,973,653,969)	
	イスラエルシェケル REIT 1 LTD	72,370	962,521.00	
	イスラエルシェケル 小計	72,370	962,521.00 (31,012,426)	
	合計	61,006,384	61,447,547,406 (61,447,547,406)	

## 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	----------------	----------------

アメリカドル	投資証券	158銘柄	100.0%	71.9%
カナダドル	投資証券	28銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券	31銘柄	100.0%	7.1%
イギリスポンド	投資証券	28銘柄	100.0%	5.6%
オーストラリアドル	投資証券	30銘柄	100.0%	7.8%
ニュージーランドドル	投資証券	8銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券	8銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	3.2%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

### 貸借対照表

	平成29年 7月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	249,408,869
コール・ローン	326,491,608
社債券	20,172,668,757
流動資産合計	20,748,569,234
資産合計	20,748,569,234
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	9,192,000
未払利息	625
その他未払費用	593
流動負債合計	9,193,218
負債合計	9,193,218
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	65,270,856,019
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	44,531,480,003
元本等合計	20,739,376,016
純資産合計	20,739,376,016
負債純資産合計	20,748,569,234

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	65,270,856,019口
2. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 44,531,480,003円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.3177円 (1万口当たり純資産額) (3,177円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

平成29年 7月10日現在	
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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、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、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 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合理的に算定された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。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	86,248,205,547円
期中追加設定元本額	5,428,224,914円
期中一部解約元本額	26,405,574,442円
期末元本額	65,270,856,019円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	41,352,914,317円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,442,221,784円
コア投資戦略ファンド（成長型）	10,570,659,975円
分散投資コア戦略ファンドA	1,423,887,201円
分散投資コア戦略ファンドS	3,675,764,867円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,737,486,018円
SMTAMコモディティ・オープン	1,156,218,172円
コモディティ・オープン	108,130,945円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	10,372,236円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,793,200,504円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	475,892,528
合計	475,892,528

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 034 12/29/17	9,000,000.00	8,230,950.00	
		CS USD COM 013 11/30/17	12,000,000.00	11,140,800.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	3,300,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	3,357,000.00	
		SG ISSUER 003 09/29/17	30,000,000.00	28,443,000.00	
		SG ISSUER 004 11/30/17	35,000,000.00	33,838,000.00	
		STAR HELIOS 003 11/22/17	90,000,000.00	88,380,000.00	
	アメリカドル 小計		231,000,000.00	176,689,750.00 (20,172,668,757)	
	合計			20,172,668,757 (20,172,668,757)	

## 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 7銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 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。

## FRMシグマ リンク マザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成29年 7月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	342,335,991
社債券	16,348,309,250
流動資産合計	16,690,645,241
資産合計	16,690,645,241
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,040,000
未払利息	655
その他未払費用	807
流動負債合計	2,041,462
負債合計	2,041,462
純資産の部	
元本等	
元本	18,976,618,859
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,288,015,080
元本等合計	16,688,603,779
純資産合計	16,688,603,779
負債純資産合計	16,690,645,241

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,976,618,859口

	平成29年 7月10日現在	
2. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	2,288,015,080円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8794円 (8,794円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年 7月10日現在
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、信託約款に規定する「運用の基本方針」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そのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、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、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成29年 7月10日現在
3. 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合理的に算定された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。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	10,104,966,895円
期中追加設定元本額	10,651,436,650円
期中一部解約元本額	1,779,784,686円
期末元本額	18,976,618,859円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,444,321,173円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,738,666,682円
分散投資コア戦略ファンドA	1,010,973,287円
分散投資コア戦略ファンドS	935,470,618円
コア投資戦略ファンド（切替型）	479,999,307円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,000,686,916円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	9,573,407,368円
FOFs用 FRMシグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	793,093,508円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		685,688,000
合計		685,688,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「FRMシグマ リンク マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	SIGNUM SIGMA2 0% 05/12/25	18,655,000,000	16,348,309,250	
	合計	18,655,000,000	16,348,309,250	

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 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。

【中間財務諸表】

## 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(平成29年 7月11日から平成30年 1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (平成29年 7月10日現在)	第6期中間計算期間 (平成30年 1月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,378,771,311	1,387,767,474
投資信託受益証券	72,173,129,497	58,835,047,868
投資証券	13,474,681,998	9,744,344,924
親投資信託受益証券	24,293,992,005	28,863,981,327
未収入金	780,324,203	475,143,244
流動資産合計	112,100,899,014	99,306,284,837
<b>資産合計</b>		
112,100,899,014		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	406,285,143	293,949,886
未払受託者報酬	31,723,958	28,295,213
未払委託者報酬	843,857,215	752,652,589
未払利息	2,639	1,878
その他未払費用	1,037,931	1,017,843
流動負債合計	1,282,906,886	1,075,917,409
<b>負債合計</b>		
1,282,906,886		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	101,436,441,647	86,493,360,879
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	9,381,550,481	11,737,006,549
(分配準備積立金)	1,609,866,333	1,335,844,605
元本等合計	110,817,992,128	98,230,367,428
<b>純資産合計</b>		
110,817,992,128		
<b>負債純資産合計</b>		
112,100,899,014		

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日	第6期中間計算期間 自 平成29年 7月11日 至 平成30年 1月10日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	-	101,398,498
受取利息	1,460	701
有価証券売買等損益	5,680,839,028	4,649,353,675
その他収益	3,237	-
営業収益合計	5,680,843,725	4,750,752,874
<b>営業費用</b>		
支払利息	728,962	401,091
受託者報酬	35,974,544	28,295,213
委託者報酬	956,922,847	752,652,589
その他費用	1,109,318	1,017,896
営業費用合計	994,735,671	782,366,789
営業利益又は営業損失（ ）	4,686,108,054	3,968,386,085
経常利益又は経常損失（ ）	4,686,108,054	3,968,386,085
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,686,108,054	3,968,386,085
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	300,463,134	265,759,294
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,699,595,404	9,381,550,481
剰余金増加額又は欠損金減少額	394,950,588	272,910,606
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	394,950,588	272,910,606
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,005,575,506	1,620,081,329
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,005,575,506	1,620,081,329
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,474,615,406	11,737,006,549

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第5期 (平成29年 7月10日現在)	第6期中間計算期間 (平成30年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,436,441,647口	86,493,360,879口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0925円 (1万口当たり純資産額) (10,925円)	1口当たり純資産額 1.1357円 (1万口当たり純資産額) (11,357円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第6期中間計算期間 (平成30年 1月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.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合理的に算定された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。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日	第6期中間計算期間 自 平成29年 7月11日 至 平成30年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	130,647,894,668円	101,436,441,647円
期中追加設定元本額	9,405,671,580円	2,553,364,701円
期中一部解約元本額	38,617,124,601円	17,496,445,469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。

## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(平成29年 7月11日から平成30年 1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (平成29年 7月10日現在)	第6期中間計算期間 (平成30年 1月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,944,154,011	2,119,112,582
投資信託受益証券	91,515,541,944	73,755,822,874
投資証券	15,161,685,425	10,797,119,603
親投資信託受益証券	59,543,261,108	58,276,076,968
未収入金	1,441,101,125	893,623,685
流動資産合計	169,605,743,613	145,841,755,712
<b>資産合計</b>		
169,605,743,613		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	719,274,609	721,775,741
未払受託者報酬	47,596,853	42,138,483
未払委託者報酬	1,266,076,089	1,120,883,487
未払利息	3,722	2,868
その他未払費用	1,197,674	1,156,277
流動負債合計	2,034,148,947	1,885,956,856
<b>負債合計</b>		
2,034,148,947		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	137,799,070,761	112,121,286,649
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	29,772,523,905	31,834,512,207
(分配準備積立金)	2,925,964,690	2,322,288,937
元本等合計	167,571,594,666	143,955,798,856
<b>純資産合計</b>		
167,571,594,666		
<b>負債純資産合計</b>		
169,605,743,613		

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日	第6期中間計算期間 自 平成29年 7月11日 至 平成30年 1月10日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	-	67,692,535
受取利息	1,947	1,081
有価証券売買等損益	17,048,626,650	9,305,660,168
その他収益	1,921	-
営業収益合計	17,048,630,518	9,373,353,784
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,078,061	575,924
受託者報酬	53,867,485	42,138,483
委託者報酬	1,432,875,132	1,120,883,487
その他費用	1,295,354	1,156,353
営業費用合計	1,489,116,032	1,164,754,247
営業利益又は営業損失（ ）	15,559,514,486	8,208,599,537
経常利益又は経常損失（ ）	15,559,514,486	8,208,599,537
中間純利益又は中間純損失（ ）	15,559,514,486	8,208,599,537
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,076,196,491	657,862,162
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	20,827,194,600	29,772,523,905
剰余金増加額又は欠損金減少額	614,065,097	734,763,019
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	614,065,097	734,763,019
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,917,221,897	6,223,512,092
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,917,221,897	6,223,512,092
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	33,007,355,795	31,834,512,207

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第5期 (平成29年 7月10日現在)	第6期中間計算期間 (平成30年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,799,070,761口	112,121,286,649口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2161円 (1万口当たり純資産額) (12,161円)	1口当たり純資産額 1.2839円 (1万口当たり純資産額) (12,839円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第6期中間計算期間 (平成30年 1月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.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合理的に算定された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。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	第5期 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 7月10日	第6期中間計算期間 自 平成29年 7月11日 至 平成30年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	181,844,790,649円	137,799,070,761円
期中追加設定元本額	7,631,317,501円	3,110,822,361円
期中一部解約元本額	51,677,037,389円	28,788,606,473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。

## (参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資

信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成30年 1月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	8,838,950,149
コール・ローン	402,092,168
株式	324,280,194,108
投資信託受益証券	267,011,641
投資証券	7,713,884,295
派生商品評価勘定	217,205,483
未収入金	56,712,226
未収配当金	351,624,904
差入委託証拠金	2,395,746,163
流動資産合計	344,523,421,137
資産合計	344,523,421,137
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	129,807
前受金	214,929,746
未払解約金	640,788,450
未払利息	544
流動負債合計	855,848,547
負債合計	855,848,547
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	134,533,457,097
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	209,134,115,493
元本等合計	343,667,572,590
純資産合計	343,667,572,590
負債純資産合計	344,523,421,137

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	平成30年 1月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	平成30年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		134,533,457,097口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5545円 (25,545円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(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・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 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合理的に算定された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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 7月11日
期首元本額	137,857,037,299円
期中追加設定元本額	11,047,565,901円
期中一部解約元本額	14,371,146,103円
期末元本額	134,533,457,097円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,375,365,017円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,303,266円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,543,693,576円
世界経済インデックスファンド	6,692,520,518円
外国株式インデックス・オープン	804,219,731円
D C マイセレクション 2 5	986,544,437円
D C マイセレクション 5 0	4,564,055,410円
D C マイセレクション 7 5	4,999,725,093円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,231,139,157円
D C マイセレクション S 2 5	376,964,427円
D C マイセレクション S 5 0	1,765,108,614円
D C マイセレクション S 7 5	1,398,493,375円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	132,433,158円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	186,415,673円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	111,407,836円
D C 世界経済インデックスファンド	5,172,923,893円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,671,413,018円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	21,791,616円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,913,172円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	63,257,669円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	98,018,804円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	383,921,066円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	56,154,302円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	446,660,334円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	994,606,847円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	461,312,455円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,042,153,018円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,243,910,616円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	187,051,092円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	447,928,548円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	495,726,029円

区分	平成30年 1月10日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	155,835,756円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,161,705,290円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	2,708,023,728円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,472,775,055円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,379,918,235円
コア投資戦略ファンド(成長型)	7,776,115,464円
分散投資コア戦略ファンドA	1,871,153,349円
分散投資コア戦略ファンドS	3,687,793,925円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	503,226,248円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	672,467,765円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,550,141,119円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	834,860,290円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	45,881,547円
SMT インデックスバランス・オープン	339,761,859円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	2,077,027,407円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	28,394,130,292円
SMT 世界経済インデックス・オープン	1,313,143円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	152,568,896円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	19,308,488円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	224,376円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	7,393,586円
グローバル経済コア	655,465,623円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	743,041円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,807,363,986円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,277,126,862円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(平成30年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,701,154,834	-	8,916,084,580	214,929,746
	合計	8,701,154,834	-	8,916,084,580	214,929,746

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成30年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,699,720,130	-	2,697,574,200	2,145,930
	アメリカドル	1,766,373,000	-	1,765,166,000	1,207,000
	カナダドル	112,980,270	-	112,700,000	280,270
	ユーロ	326,069,550	-	326,081,700	12,150
	イギリスポンド	176,484,720	-	176,494,000	9,280
	スイスフラン	85,865,250	-	85,725,000	140,250
	スウェーデンクローナ	17,741,100	-	17,745,000	3,900
	ノルウェークローネ	13,857,000	-	13,850,000	7,000
	デンマーククローネ	18,018,000	-	18,020,000	2,000
	オーストラリアドル	74,681,000	-	74,689,500	8,500
	香港ドル	33,069,400	-	33,051,000	18,400
	シンガポールドル	74,580,840	-	74,052,000	528,840
	合計		2,699,720,130	-	2,697,574,200

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成30年 1月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	162,093,235
コール・ローン	4,837,674,937
国債証券	254,362,165,950
派生商品評価勘定	11,381,689
未収入金	10,283,761
未収利息	1,990,933,474
前払金	22,891,650
前払費用	120,671,902

	平成30年 1月10日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	124,919,871
流動資産合計	261,643,016,469
資産合計	261,643,016,469
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,211,145
未払金	2,072,418
未払解約金	83,126,349
未払利息	6,548
流動負債合計	132,416,460
負債合計	132,416,460
純資産の部	
元本等	
元本	93,829,625,722
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	167,680,974,287
元本等合計	261,510,600,009
純資産合計	261,510,600,009
負債純資産合計	261,643,016,469

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	平成30年 1月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	平成30年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,829,625,722口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.7871円 (1万口当たり純資産額) (27,871円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(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・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成30年 1月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 7月11日
期首元本額	83,312,326,813円
期中追加設定元本額	16,455,818,765円
期中一部解約元本額	5,938,519,856円
期末元本額	93,829,625,722円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,173,848,716円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	900,270,184円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	587,455,728円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,931,300,873円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,404,111円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,737,515,552円
世界経済インデックスファンド	5,494,473,821円
DCマイセレクション25	1,519,724,095円
DCマイセレクション50	1,330,831,332円
DCマイセレクション75	874,371,963円
DC外国債券インデックス・オープン	1,687,502,169円
DCマイセレクションS25	574,531,723円
DCマイセレクションS50	512,293,912円
DCマイセレクションS75	243,877,873円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	54,563,790円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	54,554,190円

区分	平成30年 1月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	24,088,121円
DC世界経済インデックスファンド	4,230,822,802円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	593,432,492円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	54,832,050円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	6,331,141円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,763,571円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	66,342,779円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	199,568,384円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	322,434,909円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	239,873,999円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	635,934,597円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,832,393,171円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	740,786,555円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,742,005,299円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	995,688,008円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	193,730,805円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	772,352,837円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,011,027,854円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	279,830,949円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	383,416,358円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,273,497,099円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	988,657,826円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	933,184,912円
外国債券ファンド・シリーズ1	638,609,716円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,822,241,407円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,036,523,413円
分散投資コア戦略ファンドA	1,007,992,410円
分散投資コア戦略ファンドS	2,347,848,799円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	132,937,141円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,615,528,910円
コア投資戦略ファンド(切替型)	989,574,330円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	210,907,823円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,562,664円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	798,930,331円
SMT インデックスバランス・オープン	267,465,008円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	21,779,554,781円
SMT 世界経済インデックス・オープン	1,139,458円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	42,613,199円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	49,689,985円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	192,721円
グローバル経済コア	580,778,574円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	664,253円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,055,323,140円

区分	平成30年 1月10日現在
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	3,556,149,405円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	7,573,881,704円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（平成30年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,499,061,784	-	3,476,170,134	22,891,650
	合計	3,499,061,784	-	3,476,170,134	22,891,650

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（平成30年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	4,956,558,406	-	4,943,620,600	12,937,806
	アメリカドル	2,228,391,293	-	2,215,601,100	12,790,193
	カナダドル	343,623,834	-	350,683,500	7,059,666
	ユーロ	2,082,317,212	-	2,074,577,400	7,739,812
	イギリスポンド	302,226,067	-	302,758,600	532,533
	合計	4,956,558,406	-	4,943,620,600	12,937,806

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成30年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,317,319,183
投資証券	85,871,386,850
派生商品評価勘定	39,441,600
未収入金	24,957,122
未収配当金	821,299,821
差入委託証拠金	34,452,000
流動資産合計	88,108,856,576
資産合計	88,108,856,576
負債の部	
流動負債	
前受金	39,441,600
未払金	78,040,100
未払解約金	122,876,288
未払利息	1,783
流動負債合計	240,359,771
負債合計	240,359,771
純資産の部	
元本等	
元本	56,887,832,527
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,980,664,278
元本等合計	87,868,496,805
純資産合計	87,868,496,805
負債純資産合計	88,108,856,576

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

	平成30年 1月10日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	平成30年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,887,832,527口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.5446円 (1万口当たり純資産額) (15,446円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	平成30年 1月10日現在

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 7月11日
期首元本額	44,608,650,090円
期中追加設定元本額	14,817,310,530円
期中一部解約元本額	2,538,128,093円
期末元本額	56,887,832,527円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,737,722,643円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,017,626円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	11,628,396,068円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	26,712,346,459円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,202,089,565円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,640,370,501円
分散投資コア戦略ファンドA	1,764,937,404円
分散投資コア戦略ファンドS	2,618,645,054円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,100,477,947円
S M T インデックスバランス・オープン	45,660,412円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	784,549,859円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	864,735円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	355,316円
グローバル経済コア	223,188,789円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	614,118円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,419,596,031円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（平成30年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	1,946,894,400	-	1,986,336,000	39,441,600
合計		1,946,894,400	-	1,986,336,000	39,441,600

## (注)1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

## 2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成30年 1月10日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	443,959,756
コール・ローン	85,846,194
投資証券	60,985,958,910
派生商品評価勘定	80
未収入金	35,347
未収配当金	290,882,275
流動資産合計	61,806,682,562
<b>資産合計</b>	
61,806,682,562	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	473,800
未払解約金	12,123,309
未払利息	116
流動負債合計	12,597,225
<b>負債合計</b>	
12,597,225	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	35,211,620,542
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	26,582,464,795
元本等合計	61,794,085,337
<b>純資産合計</b>	
61,794,085,337	
<b>負債純資産合計</b>	
61,806,682,562	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

平成30年 1月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成30年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		35,211,620,542口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7549円 (17,549円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券	

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
-----------------------------------	--

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 7月11日
期首元本額	36,171,010,023円
期中追加設定元本額	1,946,900,669円
期中一部解約元本額	2,906,290,150円
期末元本額	35,211,620,542円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	181,759,913円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,648,031,533円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,281,961円
S M T グローバルR E I T インデックス・オープン	7,502,889,857円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A 専用）	17,669,336,315円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,080,444,098円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,621,041,823円
分散投資コア戦略ファンド A	632,138,061円
分散投資コア戦略ファンド S	1,267,349,449円
コア投資戦略ファンド（切替型）	520,117,553円
S M T インデックスバランス・オープン	214,088,878円

サテライト投資戦略ファンド（株式型）	545,454,991円
SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	307,470円
グローバル経済コア	190,050,189円
SBI 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	523,542円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	536,529,793円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	594,275,116円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成30年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	106,553,920	-	106,080,200	473,720
	アメリカドル	83,574,800	-	83,203,400	371,400
	カナダドル	5,410,080	-	5,409,600	480
	ユーロ	10,837,120	-	10,735,200	101,920
	シンガポールドル	6,731,920	-	6,732,000	80
合計		106,553,920	-	106,080,200	473,720

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

貸借対照表

	平成30年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	254,646,679
コール・ローン	347,452,149
社債券	21,612,397,469
流動資産合計	22,214,496,297
資産合計	22,214,496,297
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,688,000
未払利息	470
流動負債合計	13,688,470
負債合計	13,688,470
純資産の部	
元本等	
元本	66,343,025,169
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	44,142,217,342
元本等合計	22,200,807,827
純資産合計	22,200,807,827
負債純資産合計	22,214,496,297

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	平成30年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		66,343,025,169口
2. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	44,142,217,342円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.3346円 (3,346円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 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合理的に算定された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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 7月11日
期首元本額	65,270,856,019円
期中追加設定元本額	7,408,970,218円
期中一部解約元本額	6,336,801,068円
期末元本額	66,343,025,169円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	40,388,657,169円
コア投資戦略ファンド（安定型）	5,718,982,331円
コア投資戦略ファンド（成長型）	8,403,360,025円
分散投資コア戦略ファンドA	3,070,527,220円
分散投資コア戦略ファンドS	3,797,144,876円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,618,796,041円
SMTAMコモディティ・オープン	1,063,078,463円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	10,356,423円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	2,272,122,621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。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

項目	平成30年 1月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,129,372
コール・ローン	89,310,008
投資信託受益証券	13,635,047,721
派生商品評価勘定	31,189,323
未収入金	72,085,228
流動資産合計	13,831,761,652
資産合計	13,831,761,652
負債の部	
流動負債	
未払金	57,330,671
未払解約金	2,000,019
未払利息	120
流動負債合計	59,330,810
負債合計	59,330,810
純資産の部	

	平成30年 1月10日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	13,619,036,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	153,394,227
元本等合計	13,772,430,842
純資産合計	13,772,430,842
負債純資産合計	13,831,761,652

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成30年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,619,036,615口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0113円 (1万口当たり純資産額) (10,113円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 10月11日
期首元本額	3,000,000,000円
期中追加設定元本額	10,769,480,836円
期中一部解約元本額	150,444,221円
期末元本額	13,619,036,615円

期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,114,818,432円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,568,677,030円
分散投資コア戦略ファンドA	1,657,021,228円
分散投資コア戦略ファンドS	2,086,221,428円
コア投資戦略ファンド（切替型）	895,317,597円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	604,536,514円
グローバル経済コア	691,944,003円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	500,383円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成30年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	13,836,939,344	-	13,805,750,021	31,189,323
	アメリカドル	13,836,939,344	-	13,805,750,021	31,189,323
合計		13,836,939,344	-	13,805,750,021	31,189,323

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

F R Mシグマ リンク マザーファンド

貸借対照表

項目	平成30年 1月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	479,997,128
社債券	14,090,935,000
流動資産合計	14,570,932,128
資産合計	14,570,932,128
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,919,999
未払利息	649
流動負債合計	8,920,648
負債合計	8,920,648
純資産の部	
元本等	
元本	15,166,071,845
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	604,060,365
元本等合計	14,562,011,480
純資産合計	14,562,011,480
負債純資産合計	14,570,932,128

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 1月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成30年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,166,071,845口
2. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 604,060,365円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9602円 (1万口当たり純資産額) (9,602円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.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合理的に算定された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。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 7月11日
期首元本額	18,976,618,859円
期中追加設定元本額	399,734,138円
期中一部解約元本額	4,210,281,152円
期末元本額	15,166,071,845円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,698,516,399円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,910,557,102円
分散投資コア戦略ファンドA	944,239,327円
分散投資コア戦略ファンドS	894,296,610円
コア投資戦略ファンド(切替型)	369,138,424円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	316,744,196円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	8,417,424,787円

区分	平成30年 1月10日現在
F O F s 用 F R Mシグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	615,155,000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。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

項目	平成30年 1月10日現在 金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	683,461,180
社債券	13,261,370,299
派生商品評価勘定	32,096,000
流動資産合計	13,976,927,479
資産合計	13,976,927,479
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	55,781,000
未払解約金	8,919,999
未払利息	925
流動負債合計	64,701,924
負債合計	64,701,924
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	14,156,144,369
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	243,918,814
元本等合計	13,912,225,555
純資産合計	13,912,225,555
負債純資産合計	13,976,927,479

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。  なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

		平成30年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		14,156,144,369口	
2. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	243,918,814円	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9828円 (9,828円)	

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

		平成30年 1月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>		

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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合理的に算定された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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
----------------------------	---

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成30年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 10月10日
期首元本額	499,000円
期中追加設定元本額	14,377,270,798円
期中一部解約元本額	221,625,429円
期末元本額	14,156,144,369円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,642,948,178円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,827,766,351円
分散投資コア戦略ファンドA	884,937,337円
分散投資コア戦略ファンドS	832,700,245円
コア投資戦略ファンド（切替型）	358,734,509円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	297,835,322円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	7,511,797,444円
米国株式LSファンド（SMA専用）	242,747,132円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	556,677,851円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成30年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	13,282,316,000	-	13,250,220,000	32,096,000
	アメリカドル	13,282,316,000	-	13,250,220,000	32,096,000
合計		13,282,316,000	-	13,250,220,000	32,096,000

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

## 【純資産額計算書】

（平成30年 1月31日現在）

資産総額	96,238,889,687円
負債総額	546,080,436円
純資産総額（ - ）	95,692,809,251円
発行済口数	84,399,974,239口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1338円
（1万口当たり純資産額）	（11,338円）

## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

## 【純資産額計算書】

（平成30年 1月31日現在）

資産総額	140,716,302,028円
負債総額	1,077,799,388円
純資産総額（ - ）	139,638,502,640円
発行済口数	109,343,225,347口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2771円
（1万口当たり純資産額）	（12,771円）

（参考）

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 1月31日現在）

資産総額	340,218,899,686円
負債総額	334,805,111円
純資産総額（ - ）	339,884,094,575円
発行済口数	134,104,873,847口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5345円
（1万口当たり純資産額）	（25,345円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成30年 1月31日現在)

資産総額	261,011,459,832円
負債総額	123,768,997円
純資産総額( - )	260,887,690,835円
発行済口数	95,146,723,903口
1口当たり純資産額( / )	2.7420円
(1万口当たり純資産額)	(27,420円)

## J-REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成30年 1月31日現在)

資産総額	90,405,088,029円
負債総額	690,484,461円
純資産総額( - )	89,714,603,568円
発行済口数	56,047,876,035口
1口当たり純資産額( / )	1.6007円
(1万口当たり純資産額)	(16,007円)

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成30年 1月31日現在)

資産総額	59,624,297,780円
負債総額	273,701,155円
純資産総額( - )	59,350,596,625円
発行済口数	35,647,417,272口
1口当たり純資産額( / )	1.6649円
(1万口当たり純資産額)	(16,649円)

## グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 1月31日現在）

資産総額	22,047,445,834円
負債総額	1,443,772円
純資産総額（ - ）	22,046,002,062円
発行済口数	66,474,012,833口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3316円
（1万口当たり純資産額）	（3,316円）

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

（平成30年 1月31日現在）

資産総額	13,872,173,349円
負債総額	237,981,176円
純資産総額（ - ）	13,634,192,173円
発行済口数	13,287,674,492口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0261円
（1万口当たり純資産額）	（10,261円）

## FRMシグマ リンク マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 1月31日現在）

資産総額	15,007,500,484円
負債総額	82,430,890円
純資産総額（ - ）	14,925,069,594円
発行済口数	15,046,967,884口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9919円
（1万口当たり純資産額）	（9,919円）

## 米国株式LSマザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 1月31日現在）

資産総額	14,177,182,027円
負債総額	2,962,403円
純資産総額（ - ）	14,174,219,624円

発行済口数	14,162,643,906口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0008円
（1万口当たり純資産額）	（10,008円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

委託会社は、当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又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がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

###### 受益権の譲渡

イ．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又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及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又は記録するものとします。ただし、上記イ．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又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．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又は記録されている振替口座簿に係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るとき又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。

###### 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

###### 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

###### 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又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係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

###### 質権口記載又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又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及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。



### 第三部【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】

###### (1)資本金の額（平成30年 1月31日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、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、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、取締役の解任決議は、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、監査役の解任決議は、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3分の2以上をもって行います。

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終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4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終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

###### [ DO（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は平成30年 4月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 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その運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成30年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	495	9,799,979
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	190,365
単位型公社債投資信託	0	0
合計	563	9,990,344

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）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条の規定に基づき、「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）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「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）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

す。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度（自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）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。

また、第32期事業年度の中間会計期間（自平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		16,534,066		20,260,630
前払費用		102,445		143,622
未収委託者報酬		5,528,610		5,252,944
繰延税金資産		121,367		61,677
その他		5,566		5,474
流動資産合計		22,292,056		25,724,348
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	55,487	1	47,993
器具備品	1	90,924	1	73,765
その他	1	3,748	1	2,830
有形固定資産合計		150,160		124,589
無形固定資産				
ソフトウェア		215,175		221,499
その他		5,886		6,656
無形固定資産合計		221,062		228,156
投資その他の資産				
投資有価証券		63,797		71,153
長期前払費用		8,021		9,828
長期貸付金		22,838		19,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		123,235		137,359
その他		235		145
貸倒引当金		22,838		19,838
投資その他の資産合計		220,289		243,485
固定資産合計		591,512		596,231
資産合計		22,883,569		26,320,580

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日現在）	当事業年度 （平成29年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	68,500	71,500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

## （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	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612
旅費交通費	67,392	61,961
租税公課	73,989	106,691
不動産賃借料	125,339	113,697
減価償却費	126,985	134,710
業務委託費	1 209,510	1 486,690
諸経費	217,580	223,685
一般管理費合計	3,246,214	3,304,885
営業利益	6,525,812	6,261,346

（単位：千円）

前事業年度

当事業年度

（自 平成27年4月 1日  
至 平成28年3月31日）

（自 平成28年4月 1日  
至 平成29年3月31日）

営業外収益				
受取利息		8,092		4,669
収益分配金		2,026		129
投資有価証券売却益		350		307
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

### （ 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	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	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	3,235	3,235	13,238,726
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

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	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

#### 時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（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しております。）

#### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 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。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

#### (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

#### (3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

### 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 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及び構築物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28千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。

## 注記事項

## （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	54,302	千円	62,231
器具備品	263,257	"	298,576	"
そ の 他	841	"	1,759	"
計	318,401	"	362,567	"

## （損益計算書関係）

## 1関係会社に対するものは次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)	
	業務委託費	39,733	千円	39,286
長期前払費用償却	27,866	"	4,644	"

## （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. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1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	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

決議	株式の 種類	配当金の総 額 (千円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年6月30日 定時株主総会	普通株 式	30,000	利益 剰余金	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30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. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
-------	---------	---------	---------	--------

普通株式（株）	3,000	-	-	3,000
---------	-------	---	---	-------

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

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

平成29年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	配当金の原資	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（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、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください。

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	16,534,066	16,534,066	-
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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	20,260,630	20,260,630	-
(2) 未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
(4) 未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
(5) 未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## （1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （3）投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

## （4）未払金、並びに（5）未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額（単位：千円）

区分	平成28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## （注3）金銭債権及び満期の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）

	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	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499

（有価証券関係）

## 1．その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

当事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 2．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
20,015	350	365

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
-----	---------	---------

12,699	307	604
--------	-----	-----

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（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、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2．退職給付債務に関する事項

（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）退職給付債務	389,941	437,197
（2）退職給付引当金	389,941	437,197

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（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）退職給付費用	73,742	76,106

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,434千円、当事業年度で14,321千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（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

	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）	
繰延税金資産				
未払事業税	86,931	千円	28,688	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,993	"	6,074	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,437	"	30,265	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	119,400	"	133,869	"
その他	7,674	"	6,972	"
繰延税金資産 合計	251,436	"	205,870	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	244,602	"	199,037	"

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

## （関連情報）

## 1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,979,867千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,568,158千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

## (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	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（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、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

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、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

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成28年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成29年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	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株当たり純資産額	5,848,968円06銭	7,282,436円46銭
1株当たり当期純利益金額	1,447,521円33銭	1,443,463円05銭

(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いません。

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)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円

普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株
--------------	--------	--------

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金及び預金		22,430,598
未収委託者報酬		5,219,968
繰延税金資産		79,306
その他流動資産		138,600
流動資産合計		27,868,472
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	39,695
器具備品	1	74,492
その他有形固定資産	1	2,371
有形固定資産合計		116,559
無形固定資産		
投資その他の資産		220,928
投資有価証券		72,823
長期貸付金		18,588
会員権		25,000
その他の投資		6,424
繰延税金資産		144,499
貸倒引当金		18,588
投資その他の資産合計		248,747
固定資産合計		586,236
資産合計		28,454,709
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金		2,893,700
未払費用		97,854
未払法人税等		958,933
賞与引当金		101,223
その他流動負債	2	126,412
流動負債合計		4,178,123
固定負債		
退職給付引当金		464,737
資産除去債務		13,260
その他固定負債		1,569
固定負債合計		479,568
負債合計		4,657,692

(単位：千円)

第32期中間会計期間末  
（平成29年9月30日）

純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	74,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	20,972,132
利益剰余金合計	23,146,632
株主資本合計	23,796,632
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	384
評価・換算差額等合計	384
純資産合計	23,797,016
負債・純資産合計	28,454,709

中間損益計算書

（単位：千円）

第32期中間会計期間  
（自 平成29年4月1日  
至 平成29年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		14,889,835
営業収益合計		14,889,835
営業費用		10,297,526
一般管理費	1	1,725,338
営業利益		2,866,970
営業外収益	2	6,124
営業外費用		8,308
経常利益		2,864,786
税引前中間純利益		2,864,786
法人税、住民税及び事業税		912,037
法人税等調整額		25,439
法人税等合計		886,598
中間純利益		1,978,187

中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000

当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,978,187	1,978,187	1,978,187
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,945,187	1,948,187	1,948,187
当中間期末残高	74,500	2,100,000	20,972,132	23,146,632	23,796,632

	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	1,134	1,134	21,847,309
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,978,187
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	1,519	1,519	1,519
当中間期変動額合計	1,519	1,519	1,949,707
当中間期末残高	384	384	23,797,016

## 重要な会計方針

<p>第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）</p>
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>  その他有価証券</p> <p>    時価のあるもの</p> <p>      中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。       （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しております。）</p> <p>    時価のないもの</p> <p>      移動平均法による原価法によっております。</p>

## 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。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、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) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 60,917千円
	器具備品 309,829千円
	その他有形固定資産 2,218千円
	計 372,965千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

第32期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 16,811千円
	無形固定資産 41,202千円

2 営業外収益の主要項目	
受取利息	1,314千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

平成29年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	22,430,598	22,430,598	-
(2)未収委託者報酬	5,219,968	5,219,968	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	72,820	72,820	-
(4)未払金	(2,893,700)	(2,893,700)	-
(5)未払法人税等	(958,933)	(958,933)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金、並びに(5)未払法人税等

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、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見

積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（３）投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	20,229	18,356	1,872
小計	20,229	18,356	1,872
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	52,590	53,909	1,318
小計	52,590	53,909	1,318
合計	72,820	72,266	554

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	1,564,703千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

（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）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	7,932,338円90銭
1株当たり中間純利益	659,395円97銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	1,978,187千円
普通株式に係る中間純利益	1,978,187千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（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。

##### (1)自己又はその役員との取引

自己又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (2)運用財産相互間の取引

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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣

府令で定めるものを除きます。 )。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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。 ) 又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又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。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又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】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成30年 4月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（平成29年3月末日現在）

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。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	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。
株式会社北都銀行	12,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社東邦銀行	23,519	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社岩手銀行	12,089	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社横浜銀行	215,628	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社常陽銀行	85,113	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社山陰合同銀行	20,705	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社八千代銀行	43,734	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社武蔵野銀行	45,743	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
ごうぎん証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社南都銀行	29,249	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社群馬銀行	48,652	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社東京都民銀行	55,620	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社十八銀行	24,404	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社京都銀行	42,103	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
とうほう証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社伊予銀行	20,948	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

資本金の額は平成30年4月2日現在です。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成29年3月末日現在）

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。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

### 第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年 6月 2日

三井住友トラスト・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 白川 芳樹 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 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トラスト・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31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、三井住友トラスト・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

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

# 独立監査人の監査報告書

平成29年9月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

山田信之

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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（安定型）の平成28年7月12日から平成29年7月10日までの計算期間の財務諸表、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、コア投資戦略ファンド（安定型）の平成29年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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

三井住友トラスト・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

- 上記は、当社が、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。
- XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

平成29年9月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

山田信之

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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（成長型）の平成28年7月12日から平成29年7月10日までの計算期間の財務諸表、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、コア投資戦略ファンド（成長型）の平成29年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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

三井住友トラスト・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

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成29年12月4日

三井住友トラスト・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	藤澤 孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知 明 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トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

平成30年3月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（安定型）の平成29年7月11日から平成30年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（安定型）の平成30年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年7月11日から平成30年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・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

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

# 独立監査人の中間監査報告書

平成30年3月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（成長型）の平成29年7月11日から平成30年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（成長型）の平成30年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年7月11日から平成30年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・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

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