

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年9月3日

【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 鈴木 郁也

【本店の所在の場所】 東京都港区芝3丁目33番1号

【事務連絡者氏名】 ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志

【電話番号】 03-6737-0521

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンド SLI GARSファンド（SMA専用）の名称】

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 当初自己設定
100万円
継続募集額
上限10兆円

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したこと等に伴い、平成24年11月16日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

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

原届出書の「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」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部 は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1)ファンドの目的及び基本的性格

（中略）

基本的性格

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。

（中略）

なお、これ以外の用語の定義については、社団法人投資信託協会のホームページをご覧ください。

（中略）

「ファンド・オブ・ファンズ」...社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

（中略）

(3)ファンドの仕組み

（中略）

委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成24年9月28日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成24年9月28日現在）

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%

<訂正後>

(1)ファンドの目的及び基本的性格

（中略）

基本的性格

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。

（中略）

なお、これ以外の用語の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ<http://www.toushin.or.jp/>をご覧ください。

（中略）

「ファンド・オブ・ファンズ」...一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

（中略）

(3)ファンドの仕組み

(中略)

委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年6月28日現在）

ロ．委託会社の沿革

(中略)

ハ．大株主の状況（平成25年6月28日現在）

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%

[次へ](#)

2 投資方針

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

(2)投資対象

該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

- 投資対象ファンドの概要 -

（中略）

以下の内容は、平成24年11月16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。

（後略）

<訂正後>

（前略）

- 投資対象ファンドの概要 -

（中略）

以下の内容は、平成25年6月28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。

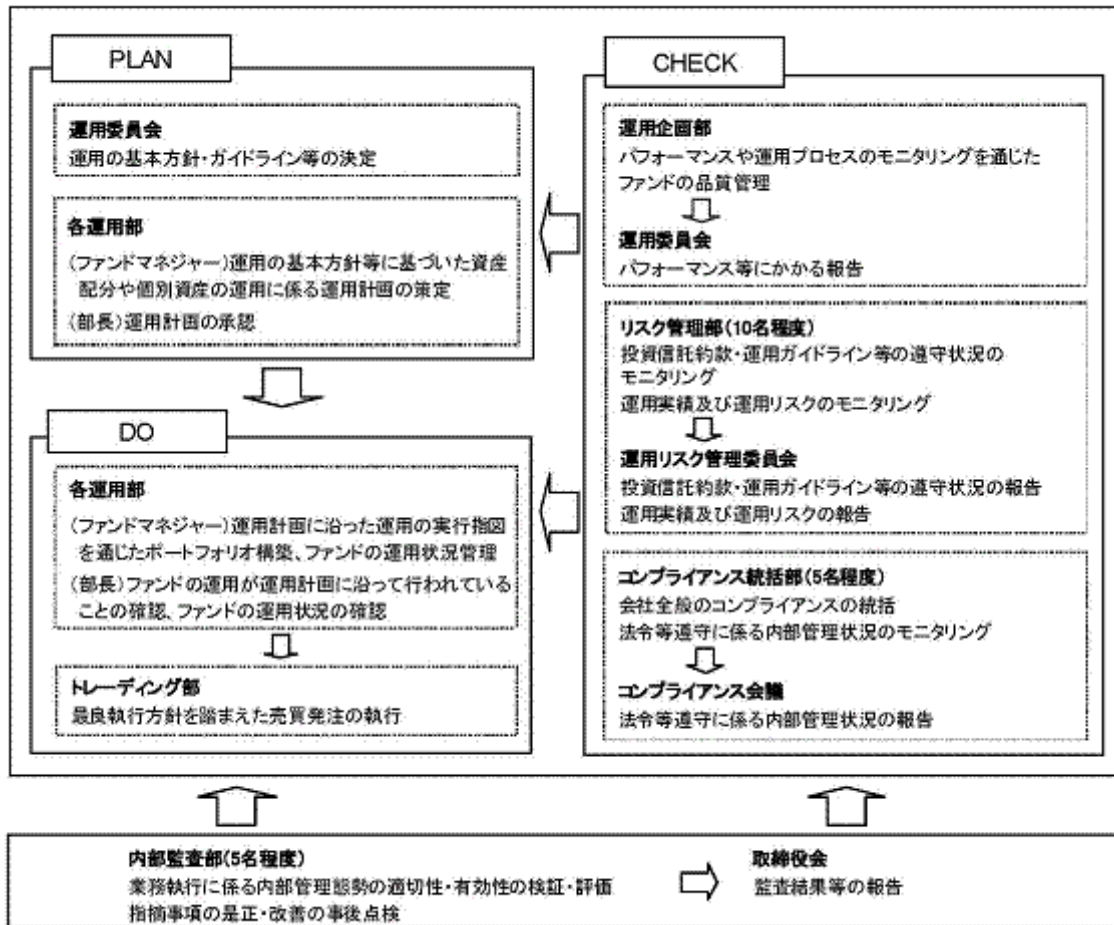
（後略）

(3)運用体制

該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

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、平成25年9月3日現在のものであり、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。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「4 手数料等及び税金」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

（前略）

上記は、平成24年9月28日現在のものですので、税法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。

< 訂正後 >

（前略）

上記は、平成25年6月28日現在のものですので、税法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。

[次へ](#)

5 運用状況

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

以下の記載は、平成25年6月28日現在の状況について記載してあります。

(1)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	ルクセンブルク	13,634,786,182	99.61
親投資信託受益証券	日本	10,004	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		52,960,385	0.39
合計(純資産総額)		13,687,756,571	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

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^A , H, JPY	8,006,333.636	1,709.01	13,682,980,000	1,703.00	13,634,786,182	99.61
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	9,874	1.0127	10,000	1.0132	10,004	0.00

(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。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.61
親投資信託受益証券	0.00
合計	99.61

(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。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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)
平成24年12月末日	4,265,635,369		10,044	
平成25年1月末日	5,020,328,394		10,112	

2月末日	5,407,611,311		10,217	
3月末日	5,761,307,059		10,380	
4月末日	11,160,531,446		10,483	
5月末日	12,554,320,592		10,562	
6月末日	13,687,756,571		10,272	

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1期中間計算期間(平成24年12月 4日～平成25年 6月 3日)	5.4

(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期中間計算期間 (平成24年12月 4日～平成25年 6月 3日)	13,124,256,032	1,145,996,867	11,978,259,165

(注)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。

(参考情報)

短期金融資産 マザーファンド

(1)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	日本	3,273,364,700	90.98
特殊債券	日本	302,454,000	8.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,907,646	0.61
合計(純資産総額)		3,597,726,346	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。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第254回利付国債(10年)	1,405,000,000	100.64	1,414,117,600	100.28	1,408,990,200	1.4	2013/09/20	39.16
日本	国債証券	第258回利付国債(10年)	1,050,000,000	101.03	1,060,872,050	100.85	1,058,998,500	1.3	2014/03/20	29.44
日本	国債証券	第257回利付国債(10年)	700,000,000	101.10	707,715,700	100.56	703,927,000	1.3	2013/12/20	19.57
日本	国債証券	第260回利付国債(10年)	100,000,000	101.48	101,481,000	101.44	101,449,000	1.6	2014/06/20	2.82
日本	特殊債券	第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	101.13	101,137,000	101.11	101,116,000	1.5	2014/04/25	2.81
日本	特殊債券	第836回政府保証公営企業債券	100,000,000	101.24	101,244,000	100.78	100,785,000	1.3	2014/02/26	2.80
日本	特殊債券	第833回政府保証公営企業債券	100,000,000	101.18	101,185,000	100.55	100,553,000	1.5	2013/11/21	2.79

(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。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	90.98
特殊債券	8.41
合計	99.39

(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。

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。


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

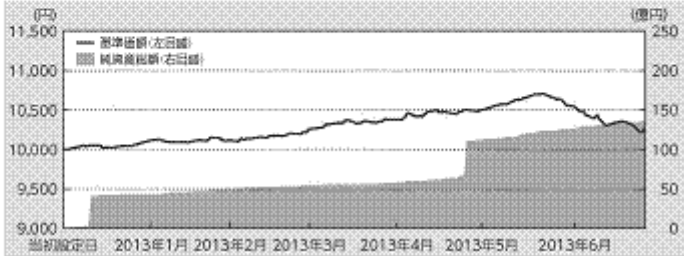
該当事項はありません。

(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12月4日

作成基準日：2013年6月28日

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,272円
純資産総額	137億円

※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)

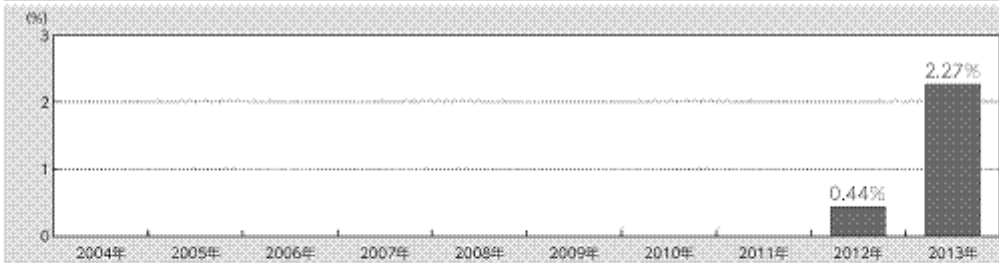
設定来分配金合計額-円

決算期	—	—	—	—	—
分配金	—	—	—	—	—

※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
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D	—	99.6%
短期金銭資産 マザーファンド	—	0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)

※ファンドはベンチマーク(日本円短期金利(円LIBOR 6ヶ月物))を上回る絶対収益の獲得を目指して運用を行いますが、常にプラスの収益率となるベンチマークの収益率を表示することは投資者の誤解を招くおそれがありますので、ベンチマークの年間収益率の推移は表示しておりません。

※2012年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2013年は年初から作成基準日までの収益率です。

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】

3 資産管理等の概要

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第2 管理及び運営」「3 資産管理等の概要」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部____は訂正部分を示します。

(1)資産の評価

< 訂正前 >

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。

（後略）

< 訂正後 >

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。

（後略）

< 参考情報 >

「Global Absolute Return Strategies Fund Class D^{A, H, JPY}」の状況

なお、下記に記載した情報は監査の対象外であります。

同投資信託証券（以下、「同ファンド」という。）は、ルクセンブルグの法律に基づき設立された円建外国投資信託証券であります。同ファンドは計算期間（2012年1月1日から2012年12月31日まで）が終了し、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して財務書類が作成されており、監査人による監査を受けております。

同ファンドの「純資産計算書」及び「損益計算書及び純資産変動計算書」などは、Standard Life Investments Limitedから入手した情報に基づき、2012年12月31日現在の財務書類の一部を委託会社が翻訳したものであります。

[次へ](#)

Standard Life Investments Global SICAV

Soci t  d'Investissement   Capital Variable

純資産計算書

2012年12月31日現在

	Global Absolute Return Strategies Fund ^ (EUR)
資産	
投資有価証券（時価）（注記2b）	2,663,509,855
取得原価:	2,550,474,755
現金及び現金同等物（注記13）	607,116,540
未収利息及び未収配当金、純額	15,374,752
有価証券売却に係る未収金	456,386
募集に係る未収金	8,013,237
その他の未収金	-
その他の資産（注記12）	15,051,491
スワップ契約に係る未実現評価益（注記2g, 7）	43,270,609
先物為替予約に係る未実現評価益（注記2f, 6）	34,399,128
先物契約に係る未実現評価益（注記2h, 8）	5,818,272
オプション契約（時価）（注記2i, 9）	84,215,188
資産合計	<u>3,477,225,458</u>
負債	
銀行当座借越（注記13）	40,798,461
有価証券購入に係る未払金	1,142,427
償還に係る未払金	945,023
未払報酬	1,373,950
スワップ契約に係る未実現評価損（注記2g, 7）	44,813,119
先物為替予約に係る未実現評価損（注記2f, 6）	47,607,773
先物契約に係る未実現評価損（注記2h, 8）	17,140,692
オプション契約（時価）（注記2i, 9）	36,289,327
その他の負債（注記12）	-
負債合計	<u>190,110,772</u>
純資産合計	<u>3,287,114,686</u>

^ 本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Soci t  d'Investissement   Capital Variable

損益計算書及び純資産変動計算書

2012年12月31日に終了した年度

	Global Absolute Return Strategies Fund ^ (EUR)
期初の純資産	1,439,431,596
収益	
受取配当金、純額（注記2d）	11,334,451
受取利息、純額（注記2d）	36,717,216
銀行利息、純額	3,996,765
収益合計	<u>52,048,432</u>
費用	
年間管理手数料（注記3a）	6,379,609
管理事務報酬（注記3d）	161,006
保管料（注記3b）	506,272
専門家報酬	21,970
名義書換代理人報酬	171,534
引受税（注記5a）	307,755
銀行利息、純額	-
諸雑費	176,041
費用合計	<u>7,724,187</u>

純投資収益(損失)	44,324,245
実現純利益(損失):	
投資有価証券の売却	33,069,434
先物為替予約(注記2f)	(33,455,719)
外国為替契約(注記2c)	(282,547)
スワップ契約(注記2g)	44,807,191
先物契約(注記2h)	(13,252,854)
オプション契約(注記2i)	(32,825,719)
当年度実現純利益(損失)	(1,940,214)
未実現評価純(損)益の変動額:	
投資有価証券	108,322,415
先物為替予約(注記2f)	(2,486,647)
スワップ契約(注記2g)	(16,235,092)
先物契約(注記2h)	(10,115,807)
オプション契約(注記2i)	10,523,924
当年度未実現評価純(損)益の変動額	90,008,793
運用による純資産の増加(減少)額	132,392,824
資本の変動	
募集	1,933,719,305
償還	(218,378,351)
資本の変動による純資産の増加(減少)額	1,715,340,954
配当(注記4)	(50,688)
期末の純資産	3,287,114,686

^ 本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Soci t  d'Investissement   Capital Variable

投資証券数変動計算書

2012年12月31日に終了した年度

	期初の			期末の
	発行済投資証券数	応募投資証券数	償還投資証券数	発行済投資証券数
Global Absolute Return Strategies Fund ^				
クラスA 累積型投資証券	874,435	6,917,543	(1,209,743)	6,582,235
クラスA 累積型投資証券(スイスフラン、ヘッジあり)	-	2,200	-	2,200
クラスA 累積型投資証券(英ポンド、ヘッジあり)	49,417	105,191	(4,181)	150,427
クラスA 累積型投資証券(日本円、ヘッジあり)	100	-	-	100
クラスA 累積型投資証券(スウェーデンクローナ、ヘッジあり)	100	10,444,226	(399,513)	10,044,813
クラスA 累積型投資証券(米ドル、ヘッジあり)	30,152	4,531,806	(455,366)	4,106,592
クラスA 分配型投資証券	310,923	3,095,151	(598,996)	2,807,078
クラスD 累積型投資証券	11,252,024	30,951,479	(9,109,102)	33,094,401
クラスD 累積型投資証券(豪ドル、ヘッジあり)	-	1,610,395	-	1,610,395
クラスD 累積型投資証券(スイスフラン、ヘッジあり)	-	500	-	500
クラスD 累積型投資証券(英ポンド、ヘッジあり)	750,729	14,516,403	(2,238,712)	13,028,420
クラスD 累積型投資証券(日本円、ヘッジあり)	100	12,569,462	(6,681)	12,562,881
クラスD 累積型投資証券(スウェーデンクローナ、ヘッジあり)	100	1,991	-	2,091
クラスD 累積型投資証券(シンガポールドル、ヘッジあり)	-	71,809	-	71,809
クラスD 累積型投資証券(米ドル、ヘッジあり)	2,905,669	13,940,085	(3,982,690)	12,863,064
クラスD 分配型投資証券	83,954	13,889,660	(155,172)	13,818,442
クラスZ 累積型投資証券	110,319,972	42,697,528	(947,049)	152,070,451
クラスZ 累積型投資証券(豪ドル、ヘッジあり)	8,265,987	6,155,661	(211,479)	14,210,169
クラスZ 累積型投資証券(カナダドル、ヘッジあり)	6,183,201	10,834,577	(40,528)	16,977,250
クラスZ 累積型投資証券(日本円、ヘッジあり)	-	100	-	100
期末の発行済投資証券総数				294,003,418

^ 本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Soci t  d'Investissement   Capital Variable

統計値

通貨	2012年12月31日	2011年12月31日	2010年12月31日
----	-------------	-------------	-------------

Global Absolute Return Strategies Fund ^				
純資産総額	EUR	3,287,114,686	1,439,431,596	-
1口当たりの純資産価格：				
クラスA 累積型投資証券	EUR	11.02	10.34	-
クラスA 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）	CHF	10.20	-	-
クラスA 累積型投資証券（英ポンド、ヘッジあり）	GBP	11.05	10.31	-
クラスA 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）	JPY	1,642.00	1,542.00	-
クラスA 累積型投資証券（スウェーデンクローナ、ヘッジあり）	SEK	113.17	104.56	-
クラスA 累積型投資証券（米ドル、ヘッジあり）	USD	10.94	10.24	-
クラスA 分配型投資証券	EUR	10.92	10.35	-
クラスD 累積型投資証券	EUR	11.21	10.43	-
クラスD 累積型投資証券（豪ドル、ヘッジあり）	AUD	10.11	-	-
クラスD 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）	CHF	10.24	-	-
クラスD 累積型投資証券（英ポンド、ヘッジあり）	GBP	11.17	10.36	-
クラスD 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）	JPY	1,661.00	1,549.00	-
クラスD 累積型投資証券（スウェーデンクローナ、ヘッジあり）	SEK	114.59	104.97	-
クラスD 累積型投資証券（シンガポールドル、ヘッジあり）	SGD	10.34	-	-
クラスD 累積型投資証券（米ドル、ヘッジあり）	USD	11.07	10.29	-
クラスD 分配型投資証券	EUR	11.02	10.43	-
クラスZ 累積型投資証券	EUR	11.38	10.50	-
クラスZ 累積型投資証券（豪ドル、ヘッジあり）	AUD	11.92	10.59	-
クラスZ 累積型投資証券（カナダドル、ヘッジあり）	CAD	11.31	10.33	-
クラスZ 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）	JPY	1,540.00	-	-

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Soci t  d'Investissement   Capital Variable

財務諸表に対する注記

2012年12月31日

1. 組織

スタンダード・ライフ・インベストメント・グローバルSICAV（以下、「当会社」）は、多数の無期限サブファンドを持つオープンエンド型の変動資本を有する会社型投資信託（以下、「SICAV」）としてルクセンブルグ大公国の法律に準拠して2000年11月16日に設立されました。当会社は、欧州委員会指令2009/65/EC（以下、「UCITS指令」）に基づく譲渡可能証券の集合投資事業に関する2010年12月17日制定法（以下、「UCITS法」）のパート1に基づく登録についてルクセンブルグ当局から認可を受けています。当会社は自己運用型のSICAVであり、運用会社を指名していません。

当会社の投資証券の発行及び募集に関してルクセンブルグ法による要求される法定通知は、ルクセンブルグ地方裁判所の会社登記所（以下、「登記所」）に提出されています。当会社の定款も登記所に提出され、2000年12月19日に会社公示集（以下、「官報」）において公表されています。当会社はルクセンブルグ商業登記第B78.797号に基づき登記されています。

2012年12月31日に終了した年度に、投資家に適用される手数料の異なるクラスA、クラスA（ヘッジなし）、クラスA（ヘッジあり）、クラスD、クラスD（ヘッジなし）、クラスD（ヘッジあり）、クラスZ、及びクラスZ（ヘッジあり）の8クラスの投資証券の募集が行われました。クラスD投資証券は機関投資家専用です。

クラスZ投資証券は、スタンダード・ライフ・グループ会社のメンバー、並びにスタンダード・ライフ・インベストメント・リミテッド（以下、「投資顧問会社」）及び関連の副投資顧問会社（場合に応じて）への報酬や他の費用の支払いのために個別の取決めが行われたその他の機関投資家専用です。

2. 重要な会計方針

a) 概要

本財務諸表は、投資信託事業に対するルクセンブルグの法令に準拠して作成されています。

b) 投資評価

当会社の資産価値の決定においては、証券取引所で値付けや取引が行われる各々の有価証券は、その有価証券の通常の主たる市場である証券取引所で入手可能な直近の価格で評価され、店頭市場で取引される各々の有価証券の価格は可能な限り上場証券に近い方法で評価されます。

証券取引所または店頭市場で値付けや取引が行われない有価証券、及びそのように値決めや取引が行われるが建値が入手不可能又は建値が適正市場価格を表していない有価証券の評価は、合理的に予測可能な販売価格を基準に慎重かつ誠実に決定されます。

購入日から90日以内に満期となる短期投資有価証券は、時価にほぼ等しい償却原価で評価されます。割引やプレミアムは満期までの定額法により償却されます。市場状況に重大な変化があった場合、投資有価証券の評価基準は新たな市場利回りに調整されます。

オープンエンド型の投資信託の投資証券又は受益証券は、かかる投資信託事業又はそのエージェントにより報告又は提供される直近の価格又は純資産総額で評価されます。

c) 外国通貨の換算

各々のサブファンドの帳簿と記録は、該当するサブファンドの基準通貨建てとなっています。その他の通貨建ての金額は以下の基準で基準通貨に換算されます。

- () 其他の通貨で表された投資評価並びにその他の資産及び負債は、各営業日の為替レートで基準通貨に換算されます。
- () 外国投資有価証券の売買、収益及び費用は、各々の取引日の為替レートを使用して基準通貨に換算されます。

外国為替の実現純利益及び損失は以下を表します：

- () 外国通貨の売却及び保有による為替利益及び損失

- () 有価証券取引の取引日と決済日の間の利益及び損失
 () 計上される配当及び利息と実際に受取る金額の差から生じる利益及び損失

取引の結果生じる利益及び損失は、損益計算書及び純資産の変動計算書に含まれています。

2012年12月31日現在で使用された主な為替レートは以下のとおりです：					
1 USD =	0.9637	AUD	1 USD =	86.4150	JPY
1 USD =	2.0475	BRL	1 USD =	1,070.5750	KRW
1 USD =	0.9957	CAD	1 USD =	3.0580	MYR
1 USD =	0.9137	CHF	1 USD =	12.9858	MXN
1 USD =	6.2303	CNY	1 USD =	5.5619	NOK
1 USD =	19.0385	CZK	1 USD =	1.2165	NZD
1 USD =	5.6459	DKK	1 USD =	3.0910	PLN
1 USD =	0.7568	EUR	1 USD =	6.4977	SEK
1 USD =	0.6176	GBP	1 USD =	1.2211	SGD
1 USD =	7.7504	HKD	1 USD =	30.5900	THB
1 USD =	9,637.5009	IDR	1 USD =	29.0390	TWD
1 USD =	54.7900	INR			

d) 有価証券取引及び投資収益

有価証券取引は取引日基準で計上されます。受取配当金は配当落ち日に発生します。実現利益及び損失は売却有価証券の平均原価を基準に決定されます。受取利息は日単位で発生します。

e) 設立費用

当会社及び各々のサブファンドの設立費用は、スタンダード・ライフ・グループ会社が負担しました。

f) 先物為替予約

先物為替予約は2012年12月31日現在の先物為替予約レートを基準に評価され、その結果生じる未実現評価純損益の純変動額は、損益計算書及び純資産の変動計算書の「先物為替予約の未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。先物為替予約の実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書に開示されています。

g) スワップ契約

金利スワップ契約は最新の市場金利に基づくその公正価値で評価され、その結果生じる未実現評価（損）益の純変動額は損益計算書及び純資産変動計算書の「スワップ契約に係る未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。支払/受取純額は純資産計算書の「スワップ契約に係る未実現評価（損）益」の項目に計上されています。スワップ契約に係る実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書の「スワップ契約に係る実現純利益（損失）」の項目に開示されています。金利スワップの価値は評価日現在の未経過利息の額を含んでいます。スワップ契約に係る受取（支払）利息は損益計算書及び純資産の変動計算書の「スワップ契約に係る実現純利益（損失）」の項目に含まれています。

インフレ連動スワップ契約のリザルトは純資産計算書の「スワップ契約に係る未実現評価損」の項目に計上され、損益計算書及び純資産変動計算書の「スワップ契約に係る実現純利益（損失）」の項目に計上されています。

h) 先物契約

先物契約は2012年12月31日の先物契約為替レートに基づき評価され、その結果生じる未実現評価純損益の純変動額は、損益計算書及び純資産変動計算書の「先物契約に係る未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。先物契約に係る実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書に開示されています。

i) オプション契約

オプション契約は2012年12月31日のオプション契約為替レートに基づき評価され、その結果生じる未実現評価純損益の純変動額は、損益計算書及び純資産変動計算書の「オプション契約に係る未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。オプション契約に係る実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書に開示されています。

j) 連結

当会社は2007年6月11日に（インド株式サブファンドのために）モーリシャス子会社、スタンダード・ライフ・インベストメントGS（モーリシャス・ホールディングス）を設立しました。モーリシャス子会社は全額出資子会社であり、当会社の投資方針に従って出資しています。現在、このモーリシャス子会社はインド/モーリシャスの二重課税防止条約により恩恵を受けています。将来においてこれが変更されないという保証はありません。インド株式ファンドの連結財務諸表はこの子会社のそれぞれの勘定を含んでいます。

3. 費用

a) 年間管理手数料

この年間管理手数料は、投資顧問会社、副投資顧問会社、主要販売会社、及び指名された副販売会社への支払いに使われます。

サブファンド：	年間管理手数料（年率 %）		
	クラスA	クラスD	クラスZ
Standard Life Investments Global SICAV			
Absolute Return Sub-funds			
Global Absolute Return Strategies Fund ^	1.60	0.85	0.00

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

b) 保管料

保管料はサブファンドの資産が投資される地域又は国ごとに決められたレートで計算されます。現在、年率レートは関連サブファンドの純資産価値に対して、最低が0.0025%、最高が0.50%となっています。

c) 取引費用

取引費用は投資有価証券の取得及び売却において発生する場合があります。この費用はエージェント、アドバイザー、並びにブローカー及びディーラーへの報酬及び手数料を含みます。取引費用は損益計算書及び純資産変動計算書の「投資有価証券の売却に係る実現純利益（損失）」に含まれています。

ディーリング手数料は通常、取引所での有価証券及びデリバティブの取引に対して支払われます。取引費用は取引所で行われない取引については費用が取引価格に含まれるため、個別に確認することはできません。

2012年12月31日に終了した年度について、サブファンドは先物の販売及び購入に関する手数料が発生し、これは「先物契約に係る実現純利益（損失）」として損益勘定に含まれています。同様に、2012年12月31日に終了した年度中に、サブファンドはオプションの販売及び購入に係る手数料が発生し、これは「オプション契約に係る実現純利益（損失）」として損益計算書及び純資産変動計算書に含まれています。

以下の表はサブファンドに発生した確認可能な取引費用の概算です：

サブファンド	通貨	概算取引費用 (2012年)	概算取引費用 (2011年)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	EUR	1,191,253	1,170,711

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

d) 管理事務報酬

管理事務報酬は資産価値に基づくスライド制となっています。報酬は以下のとおり計算されます：

資産価値1億ユーロまでは年率0ペーシス・ポイントで支払
 資産価値1億超2.5億ユーロまでは年率1.25ペーシス・ポイントで支払
 資産価値2.5億超5億ユーロまでは年率0.75ペーシス・ポイントで支払
 資産価値5億ユーロ超は年率0.50ペーシス・ポイントで支払

1サブファンドにつき年間15,000ユーロの定額報酬もあります。

4. 配当金

取締役会はルクセンブルグ法により定められた形式及び条件に基づき中間配当の支払いを決定することができます。2012年12月31日に終了した年度に、当会社は以下の配当を計上しました：

サブファンド	通貨	1株当たりの金額
Global Absolute Return Strategies Fund ^ -クラスA 分配型	EUR	0.1131
Global Absolute Return Strategies Fund ^ -クラスD 分配型	EUR	0.1848

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

Global Absolute Return Strategies Fund クラスA及びD分配型投資証券は、2012年1月4日を配当落ち日及び2012年1月10日を受け渡し日として受益者に総額50,688ユーロを支払いました。

5. 課税

a) 引受税

現在の法令及び実務に従い、当会社はルクセンブルグ所得税の支払い義務がなく、また当会社により支払われた配当金はルクセンブルグ源泉徴収税の支払い義務がありません。ルクセンブルグにおける現行の法規制に従い、本サブファンドは機関投資家専用の投資証券クラスのように0.01%の軽減税率による恩恵を受ける投資証券クラスを除き、年率0.05%の「引受税」が課されます。（かかる条件は、監督官庁及びルクセンブルグにおいてその時々効力のある法規制により解釈されるため）クラスD投資証券は、機関投資家及び、念のため書き添えると、取締役が当該クラスを提供する一般投資家及び機関投資家の代理人となる指名機関専用です。クラスZ投資証券は、スタンダード・ライフ・グループ会社のメンバー、並びに投資顧問会社及び関連の副投資顧問会社（場合に応じて）への報酬や他の費用の支払いのために個別の取決めが行われたその他の機関投資家専用です。引受税は以下のとおり定められた率で、四半期毎に計算され、支払われます：

クラスA このクラスの純資産総額の0.05%
 クラスD このクラスの純資産総額の0.01%
 クラスZ このクラスの純資産総額の0.01%

b) 外国税に関する規定

他の国から受け取った有価証券に係るキャピタル・ゲイン、配当金及び利息は、当該国により課される源泉徴収税又はキャピタル・ゲイン税の対象となる可能性があります。外国キャピタル・ゲイン税及び所得税の対する潜在的責任に備えることは当会社の方針です。

6. 先物為替予約

2012年12月31日現在、当会社は以下の先物為替予約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^					
通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現評価（損）益（ユーロ相当額）
SEK	201	EUR	(23)	01/02/2013	-
GBP	40,487	EUR	(49,264)	01/03/2013	349
USD	11,706	EUR	(8,813)	01/03/2013	46
SEK	992	EUR	(115)	01/03/2013	-
EUR	182	USD	(241)	01/03/2013	-
EUR	1,333,987	JPY	(147,970,000)	01/04/2013	38,147
EUR	245,245	JPY	(27,880,000)	01/04/2013	1,087
EUR	876,144	SEK	(7,517,074)	01/04/2013	755
EUR	1,482,327	USD	(1,958,345)	01/04/2013	350
GBP	4,953	EUR	(6,049)	01/04/2013	21
EUR	4,032	JPY	(460,000)	01/04/2013	3
EUR	6,227,468	JPY	(626,845,105)	01/09/2013	737,922
EUR	26,622,522	USD	(34,389,802)	01/09/2013	599,250
EUR	18,604,672	GBP	(14,873,691)	01/09/2013	379,693
EUR	24,007,380	USD	(31,285,626)	01/09/2013	333,085
EUR	4,650,636	CAD	(5,909,614)	01/09/2013	160,361
EUR	11,624,818	GBP	(9,385,413)	01/09/2013	124,717
EUR	6,509,872	USD	(8,510,134)	01/09/2013	70,128
EUR	2,030,483	CAD	(2,608,809)	01/09/2013	48,243
EUR	1,309,067	AUD	(1,620,496)	01/09/2013	37,599
EUR	2,269,782	AUD	(2,846,702)	01/09/2013	36,212
EUR	1,380,959	USD	(1,784,866)	01/09/2013	30,324

訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

EUR	1,185,102	USD	(1,534,493)	01/09/2013	23,928
EUR	1,072,724	GBP	(858,206)	01/09/2013	21,150
EUR	944,958	GBP	(759,888)	01/09/2013	13,855
EUR	682,500	GBP	(547,898)	01/09/2013	11,152
EUR	2,835,578	GBP	(2,306,400)	01/09/2013	9,509
EUR	664,991	GBP	(535,276)	01/09/2013	9,109
EUR	1,109,612	GBP	(898,243)	01/09/2013	8,980
EUR	681,922	GBP	(550,073)	01/09/2013	7,909
EUR	776,126	GBP	(630,036)	01/09/2013	4,132
EUR	110,245	CAD	(140,936)	01/09/2013	3,159
EUR	136,646	CAD	(177,489)	01/09/2013	1,786
EUR	213,480	AUD	(269,834)	01/09/2013	1,764
EUR	208,781	GBP	(168,986)	01/09/2013	1,720
EUR	89,914	AUD	(113,149)	01/09/2013	1,135
EUR	72,590	AUD	(91,083)	01/09/2013	1,124
EUR	522,666	GBP	(425,773)	01/09/2013	959
SEK	464,875	EUR	(54,073)	01/09/2013	54
EUR	29,251,536	GBP	(23,400,000)	01/10/2013	579,477
EUR	3,708,515	USD	(4,790,208)	01/10/2013	83,728
EUR	30,677,180	GBP	(25,000,000)	01/10/2013	44,639
EUR	5,500,879	DKK	(41,000,000)	01/10/2013	4,836
EUR	99,752	GBP	(80,274)	01/10/2013	1,392
EUR	186,745,324	USD	(241,791,123)	01/14/2013	3,786,847
EUR	1,757,832	USD	(2,235,028)	01/14/2013	66,632
EUR	1,059,243	USD	(1,350,000)	01/14/2013	37,725
EUR	1,366,804	USD	(1,774,038)	01/14/2013	24,425
EUR	1,538,015	USD	(2,004,635)	01/14/2013	21,148
EUR	1,075,541	USD	(1,400,000)	01/14/2013	16,189
EUR	377,532	USD	(481,200)	01/14/2013	13,417
EUR	413,606	USD	(529,125)	01/14/2013	13,228
EUR	815,802	GBP	(655,758)	01/14/2013	12,339
EUR	459,164	USD	(593,098)	01/14/2013	10,379
EUR	274,790	USD	(350,000)	01/14/2013	9,952
EUR	645,937	GBP	(520,000)	01/14/2013	8,811
EUR	478,405	USD	(620,644)	01/14/2013	8,776
EUR	490,741	USD	(638,516)	01/14/2013	7,589
EUR	340,211	USD	(442,775)	01/14/2013	5,173
EUR	380,431	USD	(496,068)	01/14/2013	5,066
EUR	354,383	GBP	(286,030)	01/14/2013	3,927
EUR	379,818	USD	(497,233)	01/14/2013	3,572
EUR	202,826	USD	(263,605)	01/14/2013	3,361
EUR	187,859	GBP	(150,883)	01/14/2013	2,990
EUR	190,585	USD	(248,118)	01/14/2013	2,840
EUR	119,817	GBP	(95,983)	01/14/2013	2,214
EUR	783,046	USD	(1,032,000)	01/14/2013	2,153
EUR	736,950	USD	(971,175)	01/14/2013	2,082

△本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現評価(損)益(ユーロ相当額)
EUR	333,077	GBP	(270,433)	01/14/2013	1,731
EUR	54,526	USD	(70,085)	01/14/2013	1,494
EUR	131,857	GBP	(106,460)	01/14/2013	1,417
EUR	112,307	GBP	(90,725)	01/14/2013	1,148
EUR	88,019	USD	(115,000)	01/14/2013	1,001
EUR	46,348	USD	(60,220)	01/14/2013	781
EUR	257,075	USD	(338,811)	01/14/2013	703
EUR	151,772	GBP	(123,386)	01/14/2013	595
EUR	79,584	USD	(104,731)	01/14/2013	337
EUR	3,798	USD	(4,968)	01/14/2013	39
USD	29,500,815	JPY	(2,305,114,000)	01/22/2013	2,134,372
USD	60,602,725	JPY	(4,747,169,000)	01/23/2013	4,280,543
USD	41,500,000	JPY	(3,259,742,000)	01/24/2013	2,852,712
USD	29,000,000	JPY	(2,388,947,500)	01/24/2013	1,020,913
EUR	1,999,199	USD	(2,563,135)	02/05/2013	60,112
EUR	1,173,490	USD	(1,500,000)	02/05/2013	38,696
EUR	1,273,611	USD	(1,637,881)	02/05/2013	34,506
EUR	663,437	USD	(861,764)	02/05/2013	11,487
USD	1,731,921	EUR	(1,302,414)	02/05/2013	7,835
EUR	194,975	USD	(249,973)	02/05/2013	5,862
EUR	122,913	USD	(156,691)	02/05/2013	4,372
EUR	120,312	USD	(154,722)	02/05/2013	3,260
EUR	137,874	USD	(178,648)	02/05/2013	2,722
EUR	24,098	USD	(30,598)	02/05/2013	950
EUR	23,286	USD	(29,738)	02/05/2013	788
EUR	18,891	USD	(24,013)	02/05/2013	724
EUR	21,369	USD	(27,385)	02/05/2013	651
USD	140,000	EUR	(105,281)	02/05/2013	633
EUR	16,723	USD	(21,296)	02/05/2013	612
EUR	24,097	USD	(31,073)	02/05/2013	589
EUR	29,804	USD	(38,714)	02/05/2013	516
USD	111,118	EUR	(83,579)	02/05/2013	484
EUR	30,503	USD	(39,774)	02/05/2013	413
EUR	17,001	USD	(21,940)	02/05/2013	403
EUR	11,703	USD	(14,982)	02/05/2013	369
EUR	9,238	USD	(11,794)	02/05/2013	316

EUR	11,353	USD	(14,694)	02/05/2013	237
EUR	5,847	USD	(7,455)	02/05/2013	207
EUR	7,601	USD	(9,815)	02/05/2013	175
EUR	8,627	USD	(11,215)	02/05/2013	143
EUR	4,697	USD	(6,025)	02/05/2013	139
USD	22,682	EUR	(17,061)	02/05/2013	99
EUR	6,746	USD	(8,797)	02/05/2013	91
EUR	17,643	USD	(23,227)	02/05/2013	71
EUR	3,859	USD	(5,017)	02/05/2013	64
EUR	14,204	USD	(18,725)	02/05/2013	37
EUR	1,684	USD	(2,179)	02/05/2013	35
USD	8,303	EUR	(6,249)	02/05/2013	32
EUR	8,209	USD	(10,823)	02/05/2013	22
EUR	310	USD	(401)	02/05/2013	6
EUR	548	USD	(716)	02/05/2013	6
EUR	335	USD	(438)	02/05/2013	4
EUR	99,765,395	USD	(130,334,111)	02/07/2013	1,165,464
EUR	45,499,087	GBP	(37,031,434)	02/07/2013	139,642
EUR	5,493,668	CAD	(7,100,247)	02/07/2013	103,494
EUR	6,132,764	AUD	(7,798,202)	02/07/2013	29,357
EUR	835,752	NZD	(1,309,083)	02/07/2013	23,726
EUR	128,344	JPY	(13,273,326)	02/07/2013	12,106
EUR	683,221	GBP	(549,205)	02/07/2013	10,506
USD	2,540,309	EUR	(1,911,714)	02/07/2013	10,072
EUR	700,619	GBP	(563,807)	02/07/2013	10,017
EUR	6,566,834	SEK	(56,382,117)	02/07/2013	8,377
EUR	640,294	NZD	(1,018,831)	02/07/2013	8,312
EUR	17,970	NZD	(27,993)	02/07/2013	606
EUR	16,533	NZD	(25,802)	02/07/2013	528
EUR	22,018	NZD	(34,655)	02/07/2013	521
SEK	837,509	EUR	(97,169)	02/07/2013	251
EUR	11,271	NZD	(17,869)	02/07/2013	187
EUR	31,384	SEK	(269,317)	02/07/2013	57
EUR	138,289,276	GBP	(111,198,047)	02/08/2013	2,085,457
EUR	50,119,232	USD	(65,056,869)	02/08/2013	903,044
EUR	6,177,980	JPY	(641,185,363)	02/08/2013	562,998
EUR	2,945,239	CAD	(3,826,366)	02/08/2013	40,524
EUR	2,572,526	AUD	(3,238,946)	02/08/2013	37,702
EUR	24,249,516	CHF	(29,250,906)	02/08/2013	11,704
EUR	1,504,781	DKK	(11,216,074)	02/08/2013	985
CAD	6,501,477	EUR	(4,925,309)	02/11/2013	9,745
EUR	13,227	CAD	(17,042)	02/11/2013	292
EUR	8,062	CAD	(10,338)	02/11/2013	215
EUR	13,646	CAD	(17,739)	02/11/2013	181
EUR	7,312	CAD	(9,496)	02/11/2013	104
EUR	2,019	CAD	(2,621)	02/11/2013	29
EUR	15,041	CAD	(19,778)	02/11/2013	28
EUR	479,725	GBP	(388,744)	02/15/2013	3,600
EUR	245,050	GBP	(197,263)	02/15/2013	3,448
GBP	353,006	EUR	(429,330)	02/15/2013	3,023
EUR	293,331	GBP	(237,107)	02/15/2013	2,929
EUR	706,392	GBP	(574,664)	02/15/2013	2,557
EUR	159,735	GBP	(128,999)	02/15/2013	1,740
EUR	91,302	GBP	(73,777)	02/15/2013	941
EUR	8,529	JPY	(872,099)	02/15/2013	892
EUR	55,039	GBP	(44,221)	02/15/2013	879
EUR	61,376	GBP	(49,436)	02/15/2013	828
EUR	76,216	GBP	(61,646)	02/15/2013	714
EUR	43,002	GBP	(34,595)	02/15/2013	630
EUR	9,090	JPY	(970,000)	02/15/2013	596
EUR	47,828	GBP	(38,569)	02/15/2013	590
EUR	101,014	GBP	(82,013)	02/15/2013	567
EUR	34,739	GBP	(27,923)	02/15/2013	540
EUR	25,108	GBP	(20,070)	02/15/2013	526
EUR	30,979	GBP	(24,910)	02/15/2013	470
EUR	21,565	GBP	(17,305)	02/15/2013	370
EUR	8,067	JPY	(880,000)	02/15/2013	360
EUR	16,009	GBP	(12,781)	02/15/2013	356
EUR	5,078	JPY	(540,000)	02/15/2013	349
EUR	10,492	JPY	(1,160,000)	02/15/2013	334
EUR	40,421	GBP	(32,744)	02/15/2013	317
EUR	21,963	GBP	(17,720)	02/15/2013	260
EUR	3,003	JPY	(320,000)	02/15/2013	201
EUR	44,559	GBP	(36,224)	02/15/2013	193
EUR	35,936	GBP	(29,192)	02/15/2013	182
GBP	37,328	EUR	(45,564)	02/15/2013	154
EUR	23,924	GBP	(19,418)	02/15/2013	142
EUR	9,248	JPY	(1,040,000)	02/15/2013	140
EUR	26,082	GBP	(21,186)	02/15/2013	134
EUR	28,844	GBP	(23,451)	02/15/2013	122
EUR	15,938	GBP	(12,917)	02/15/2013	117
EUR	21,816	JPY	(2,480,000)	02/15/2013	99
EUR	2,812	JPY	(310,000)	02/15/2013	97
GBP	396,490	EUR	(485,531)	02/15/2013	80
EUR	1,126	JPY	(120,000)	02/15/2013	75
EUR	4,999	GBP	(4,039)	02/15/2013	52
EUR	2,500	JPY	(280,000)	02/15/2013	48
EUR	6,083	GBP	(4,931)	02/15/2013	43
EUR	14,545	GBP	(11,842)	02/15/2013	41
EUR	466	JPY	(50,000)	02/15/2013	28
EUR	463	JPY	(50,000)	02/15/2013	25
CHF	17,323	EUR	(14,337)	02/15/2013	18
EUR	3,527	GBP	(2,867)	02/15/2013	15
EUR	187	JPY	(20,000)	02/15/2013	11
EUR	51,960	GBP	(42,418)	02/15/2013	7
EUR	8,764	JPY	(1,000,000)	02/15/2013	7

訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

SEK	922,029,500	EUR	(106,527,365)	02/20/2013	682,097
SEK	10,648,134	EUR	(1,215,863)	02/20/2013	22,255
SEK	6,662,458	EUR	(757,083)	02/20/2013	17,598
SEK	16,067,101	EUR	(1,850,696)	02/20/2013	17,515
SEK	13,165,854	EUR	(1,516,492)	02/20/2013	14,374
SEK	6,907,174	EUR	(789,408)	02/20/2013	13,727
SEK	14,614,116	EUR	(1,686,212)	02/20/2013	13,052
SEK	4,858,199	EUR	(555,203)	02/20/2013	9,687
SEK	9,415,502	EUR	(1,085,701)	02/20/2013	9,091
SEK	10,057,091	EUR	(1,160,476)	02/20/2013	8,917
SEK	6,770,779	EUR	(779,821)	02/20/2013	7,455
SEK	10,176,129	EUR	(1,176,154)	02/20/2013	7,081
SEK	13,740,717	EUR	(1,591,178)	02/20/2013	6,531
SEK	6,555,746	EUR	(756,364)	02/20/2013	5,909
SEK	10,208,829	EUR	(1,181,131)	02/20/2013	5,906
SEK	9,592,071	EUR	(1,109,490)	02/20/2013	5,833
SEK	7,764,220	EUR	(897,128)	02/20/2013	5,660
SEK	6,333,715	EUR	(731,303)	02/20/2013	5,153
SEK	6,559,046	EUR	(757,508)	02/20/2013	5,148
SEK	7,132,499	EUR	(824,420)	02/20/2013	4,915
SEK	4,911,078	EUR	(566,369)	02/20/2013	4,669
SEK	8,622,039	EUR	(997,958)	02/20/2013	4,575
SEK	4,200,299	EUR	(484,169)	02/20/2013	4,223
SEK	4,476,319	EUR	(516,348)	02/20/2013	4,138
SEK	5,967,106	EUR	(690,520)	02/20/2013	3,309
SEK	3,138,126	EUR	(361,682)	02/20/2013	3,205
SEK	7,604,707	EUR	(881,643)	02/20/2013	2,598
SEK	3,424,606	EUR	(395,745)	02/20/2013	2,453
SEK	3,971,499	EUR	(460,746)	02/20/2013	1,042
SEK	2,885,713	EUR	(334,708)	02/20/2013	830
SEK	628,847	EUR	(72,485)	02/20/2013	634
SEK	236,222	EUR	(27,292)	02/20/2013	175
SEK	3,268	EUR	(376)	02/20/2013	4
EUR	58	SEK	(500)	02/20/2013	-
EUR	115	SEK	(992)	02/20/2013	-
EUR	35	SEK	(300)	02/20/2013	-
EUR	587	SEK	(5,049)	02/20/2013	-
EUR	23	SEK	(201)	02/20/2013	-
EUR	44,822	AUD	(55,590)	02/25/2013	1,375
EUR	48,846	AUD	(61,482)	02/25/2013	793
AUD	71,866	EUR	(55,846)	02/25/2013	323
EUR	153,053,137	GBP	(124,204,457)	03/05/2013	963,578
EUR	2,299,096	USD	(2,987,392)	03/05/2013	39,593
EUR	1,504,758	USD	(1,955,249)	03/05/2013	25,914
EUR	1,765,370	GBP	(1,432,619)	03/05/2013	11,114
EUR	310,347	GBP	(250,000)	03/05/2013	4,220
EUR	233,706	GBP	(188,723)	03/05/2013	2,613
EUR	203,979	GBP	(164,756)	03/05/2013	2,233
EUR	392,669	GBP	(319,437)	03/05/2013	1,515
EUR	23,983,698	USD	(31,031,475)	03/06/2013	513,383
EUR	23,710,339	USD	(30,634,019)	03/11/2013	541,740
EUR	11,521,258	USD	(14,985,770)	03/11/2013	187,476
EUR	7,704,720	USD	(9,970,562)	03/11/2013	163,954
EUR	15,297,242	USD	(20,023,432)	03/11/2013	153,461
EUR	2,070,397	USD	(2,702,895)	03/11/2013	26,190
EUR	1,047,903	USD	(1,367,035)	03/11/2013	14,010
EUR	318,899	USD	(416,024)	03/11/2013	4,259
EUR	2,854,223	JPY	(303,024,044)	03/12/2013	200,669
EUR	5,404,790	AUD	(6,706,653)	03/12/2013	169,373
EUR	5,251,477	AUD	(6,540,488)	03/12/2013	145,773
EUR	2,013,894	JPY	(215,588,344)	03/12/2013	126,006
EUR	4,571,915	HKD	(45,782,126)	03/12/2013	103,327
EUR	1,781,791	JPY	(192,352,404)	03/12/2013	97,379
EUR	3,749,708	HKD	(37,806,274)	03/12/2013	59,608
EUR	3,195,593	HKD	(32,293,472)	03/12/2013	43,573
EUR	1,484,333	AUD	(1,846,959)	03/12/2013	42,541
EUR	1,280,117	JPY	(142,420,051)	03/12/2013	32,957
EUR	2,815,790	GBP	(2,275,006)	03/12/2013	30,283
EUR	619,930	JPY	(67,486,070)	03/12/2013	28,961
EUR	1,500,902	AUD	(1,887,235)	03/12/2013	27,670
EUR	1,643,098	SGD	(2,610,330)	03/12/2013	26,407
EUR	1,098,986	AUD	(1,375,188)	03/12/2013	25,473
EUR	1,614,085	GBP	(1,299,678)	03/12/2013	22,766
EUR	1,544,960	HKD	(15,633,804)	03/12/2013	19,014
EUR	1,961,393	AUD	(2,489,237)	03/12/2013	18,219
EUR	716,554	SGD	(1,131,840)	03/12/2013	15,556
EUR	1,745,528	GBP	(1,414,080)	03/12/2013	14,135
EUR	501,396	AUD	(624,942)	03/12/2013	13,547
EUR	1,607,194	AUD	(2,041,787)	03/12/2013	13,313
EUR	661,400	AUD	(832,518)	03/12/2013	11,511
EUR	1,208,683	HKD	(12,265,949)	03/12/2013	11,458
EUR	977,164	GBP	(789,397)	03/12/2013	10,630
EUR	2,739,799	AUD	(3,497,320)	03/12/2013	9,684
EUR	539,238	SGD	(858,794)	03/12/2013	7,350
EUR	1,942,582	USD	(2,561,287)	03/12/2013	5,492
EUR	319,757	USD	(416,024)	03/12/2013	5,120
EUR	1,082,822	USD	(1,425,301)	03/12/2013	4,873
EUR	799,821	HKD	(8,156,586)	03/12/2013	3,693
EUR	605,732	GBP	(491,932)	03/12/2013	3,413
EUR	2,784,731	GBP	(2,271,639)	03/12/2013	3,347
EUR	1,256,848	HKD	(12,842,554)	03/12/2013	3,344
EUR	692,646	GBP	(563,043)	03/12/2013	3,259
EUR	246,238	SGD	(392,592)	03/12/2013	3,088
EUR	280,984	SGD	(449,431)	03/12/2013	2,632
EUR	347,997	GBP	(283,431)	03/12/2013	966
EUR	586,070	HKD	(5,995,234)	03/12/2013	902

訂正有価証券届出書（内国投資信託受益証券）

EUR	134,172	SGD	(215,635)	03/12/2013	620
EUR	110,117	USD	(144,977)	03/12/2013	471
EUR	528,010	SGD	(852,404)	03/12/2013	79
USD	27,872,640	AUD	(27,000,000)	03/26/2013	24,084
MXN	350,000,000	USD	(26,086,114)	04/18/2013	449,073
MXN	100,000,000	USD	(7,546,828)	04/18/2013	57,503
MXN	350,000,000	USD	(26,113,946)	04/19/2013	426,072
MXN	100,000,000	USD	(7,546,259)	04/19/2013	57,375
MXN	300,000,000	USD	(22,500,563)	04/22/2013	271,579
MXN	70,000,000	USD	(5,272,474)	04/22/2013	46,477
MXN	350,000,000	USD	(26,122,717)	04/23/2013	411,603
MXN	100,000,000	USD	(7,543,697)	04/23/2013	57,074
MXN	350,000,000	USD	(26,159,423)	04/24/2013	381,895
MXN	100,000,000	USD	(7,543,128)	04/24/2013	56,945
USD	85,175,915	CAD	(82,653,856)	05/21/2013	1,835,943
USD	32,941,221	CAD	(32,249,455)	05/22/2013	496,038
USD	32,937,974	CAD	(32,329,280)	05/23/2013	433,786
USD	90,000,000	CAD	(89,526,420)	05/23/2013	285,257
USD	27,500,000	JPY	(2,259,606,250)	08/30/2013	975,244
USD	21,000,000	CNY	(132,630,750)	08/30/2013	17,222
USD	5,900,000	CNY	(37,271,480)	08/30/2013	3,817
					34,399,128
EUR	1,425	USD	(1,892)	01/02/2013	(7)
EUR	2,030	USD	(2,696)	01/02/2013	(10)
EUR	2,120	USD	(2,816)	01/02/2013	(11)
EUR	5,987	USD	(7,951)	01/02/2013	(30)
EUR	17,563	USD	(23,324)	01/02/2013	(88)
EUR	22,050	USD	(29,282)	01/02/2013	(110)
EUR	58,382	USD	(77,531)	01/02/2013	(292)
EUR	89,500	GBP	(73,295)	01/02/2013	(320)
EUR	883,055	SEK	(7,604,707)	01/02/2013	(2,660)
EUR	2,354	CAD	(3,102)	01/03/2013	(4)
EUR	3,962	USD	(5,250)	01/03/2013	(11)
EUR	3,966	GBP	(3,260)	01/03/2013	(29)
EUR	179,545	GBP	(146,545)	01/03/2013	(32)
EUR	6,251	USD	(8,303)	01/03/2013	(32)
HKD	223,531	EUR	(21,860)	01/03/2013	(34)
EUR	6,932	GBP	(5,698)	01/03/2013	(50)
EUR	7,216	GBP	(5,932)	01/03/2013	(53)
EUR	9,182	GBP	(7,548)	01/03/2013	(67)
EUR	11,731	GBP	(9,643)	01/03/2013	(85)
EUR	12,264	GBP	(10,081)	01/03/2013	(89)
EUR	15,816	GBP	(13,000)	01/03/2013	(115)
EUR	17,101	GBP	(14,057)	01/03/2013	(125)
EUR	26,158	GBP	(21,502)	01/03/2013	(191)
USD	145,532	EUR	(110,341)	01/03/2013	(209)
HKD	5,995,234	EUR	(586,317)	01/03/2013	(924)
EUR	461,440	SEK	(3,971,499)	01/03/2013	(1,070)
EUR	429,532	GBP	(353,006)	01/03/2013	(3,043)
JPY	1,000,000	EUR	(8,765)	01/04/2013	(8)
JPY	280,000	EUR	(2,501)	01/04/2013	(48)
JPY	2,480,000	EUR	(21,815)	01/04/2013	(97)
EUR	45,585	GBP	(37,328)	01/04/2013	(157)
EUR	60,103	SEK	(527,719)	01/09/2013	(1,341)
AUD	140,245	EUR	(112,583)	01/09/2013	(2,544)
AUD	147,235	EUR	(118,196)	01/09/2013	(2,673)
EUR	499,618	SEK	(4,315,796)	01/09/2013	(2,885)
SEK	5,034,452	EUR	(589,253)	01/09/2013	(3,074)
CAD	205,698	EUR	(160,055)	01/09/2013	(3,760)
GBP	917,169	EUR	(1,128,755)	01/09/2013	(4,933)
USD	183,062	EUR	(143,647)	01/09/2013	(5,121)
AUD	1,061,829	EUR	(840,252)	01/09/2013	(7,123)
GBP	1,082,881	EUR	(1,340,151)	01/09/2013	(13,279)
SEK	26,796,077	EUR	(3,149,496)	01/09/2013	(29,534)
USD	3,761,202	EUR	(2,879,848)	01/09/2013	(33,691)
EUR	5,032,433	SEK	(44,017,688)	01/09/2013	(92,702)
EUR	7,029,069	CHF	(8,500,000)	01/10/2013	(11,991)
EUR	3,102,253	NOK	(23,000,000)	01/10/2013	(25,751)
EUR	15,878,267	CHF	(19,200,000)	01/10/2013	(26,245)
EUR	2,876,642	SEK	(25,000,000)	01/10/2013	(34,097)
EUR	2,679,313	NOK	(20,000,000)	01/10/2013	(40,691)
EUR	230,915	USD	(305,185)	01/14/2013	(12)
GBP	103,629	EUR	(127,085)	01/14/2013	(114)
EUR	79,486	USD	(105,501)	01/14/2013	(344)
USD	151,360	EUR	(115,043)	01/14/2013	(512)
USD	99,157	EUR	(75,772)	01/14/2013	(742)
USD	57,680	EUR	(44,775)	01/14/2013	(1,129)
USD	105,737	EUR	(81,584)	01/14/2013	(1,575)
USD	639,466	EUR	(487,236)	01/14/2013	(3,365)
USD	621,017	EUR	(474,680)	01/14/2013	(4,770)
USD	270,693	EUR	(209,616)	01/14/2013	(4,788)
USD	331,413	EUR	(255,724)	01/14/2013	(4,950)
USD	456,851	EUR	(351,035)	01/14/2013	(5,345)
USD	353,184	EUR	(272,819)	01/14/2013	(5,572)
USD	1,269,345	EUR	(966,355)	01/14/2013	(5,866)
USD	374,376	EUR	(289,876)	01/14/2013	(6,593)
USD	366,159	EUR	(283,666)	01/14/2013	(6,601)
USD	337,053	EUR	(262,187)	01/14/2013	(7,145)
USD	307,448	EUR	(240,165)	01/14/2013	(7,525)
USD	437,976	EUR	(339,993)	01/14/2013	(8,585)
USD	647,348	EUR	(500,211)	01/14/2013	(10,376)
USD	558,352	EUR	(436,373)	01/14/2013	(13,880)
USD	681,329	EUR	(529,438)	01/14/2013	(13,890)
USD	1,288,046	EUR	(989,182)	01/14/2013	(14,543)
USD	1,824,731	EUR	(1,395,691)	01/14/2013	(14,954)

訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

USD	641,911	EUR	(502,875)	01/14/2013	(17,154)
USD	732,883	EUR	(575,068)	01/14/2013	(20,510)
USD	40,000,000	EUR	(30,896,763)	01/18/2013	(630,685)
USD	10,393	EUR	(7,868)	02/05/2013	(5)
USD	2,291	EUR	(1,740)	02/05/2013	(7)
EUR	1,946	USD	(2,588)	02/05/2013	(12)
USD	1,100	EUR	(846)	02/05/2013	(14)
USD	9,973	EUR	(7,565)	02/05/2013	(20)
USD	6,001	EUR	(4,585)	02/05/2013	(45)
EUR	8,810	USD	(11,706)	02/05/2013	(46)
EUR	10,291	USD	(13,681)	02/05/2013	(60)
USD	13,480	EUR	(10,308)	02/05/2013	(110)
USD	217,769	EUR	(164,860)	02/05/2013	(111)
USD	8,760	EUR	(6,768)	02/05/2013	(141)
USD	8,000	EUR	(6,237)	02/05/2013	(184)
USD	7,971	EUR	(6,214)	02/05/2013	(184)
USD	22,717	EUR	(17,372)	02/05/2013	(186)
USD	21,530	EUR	(16,511)	02/05/2013	(223)
USD	13,663	EUR	(10,580)	02/05/2013	(244)
USD	12,250	EUR	(9,526)	02/05/2013	(258)
USD	9,846	EUR	(7,710)	02/05/2013	(261)
USD	11,455	EUR	(8,935)	02/05/2013	(269)
EUR	74,034	USD	(98,368)	02/05/2013	(385)
USD	40,029	EUR	(30,682)	02/05/2013	(398)
USD	1,958,345	EUR	(1,481,949)	02/05/2013	(403)
USD	26,753	EUR	(20,647)	02/05/2013	(408)
USD	217,653	EUR	(165,096)	02/05/2013	(435)
USD	29,193	EUR	(22,554)	02/05/2013	(469)
USD	19,112	EUR	(14,952)	02/05/2013	(493)
USD	16,948	EUR	(13,332)	02/05/2013	(511)
USD	45,705	EUR	(35,187)	02/05/2013	(609)
USD	50,000	EUR	(38,462)	02/05/2013	(635)
USD	46,997	EUR	(36,198)	02/05/2013	(644)
USD	102,241	EUR	(78,010)	02/05/2013	(662)
USD	83,757	EUR	(64,047)	02/05/2013	(683)
USD	290,251	EUR	(220,465)	02/05/2013	(882)
USD	98,039	EUR	(75,057)	02/05/2013	(887)
USD	104,409	EUR	(80,028)	02/05/2013	(1,039)
USD	52,656	EUR	(41,087)	02/05/2013	(1,252)
USD	127,034	EUR	(97,423)	02/05/2013	(1,318)
USD	111,467	EUR	(85,814)	02/05/2013	(1,486)
USD	201,452	EUR	(154,937)	02/05/2013	(2,533)
USD	282,913	EUR	(216,593)	02/05/2013	(2,561)
USD	358,327	EUR	(273,796)	02/05/2013	(2,711)
USD	116,065	EUR	(90,566)	02/05/2013	(2,759)
USD	108,072	EUR	(84,765)	02/05/2013	(3,005)
USD	107,130	EUR	(84,128)	02/05/2013	(3,081)
USD	141,440	EUR	(110,484)	02/05/2013	(3,481)
USD	243,207	EUR	(187,921)	02/05/2013	(3,928)
USD	210,000	EUR	(163,295)	02/05/2013	(4,424)
USD	337,520	EUR	(259,943)	02/05/2013	(4,599)
USD	723,233	EUR	(551,828)	02/05/2013	(4,680)
USD	187,990	EUR	(147,253)	02/05/2013	(5,033)
USD	285,520	EUR	(221,055)	02/05/2013	(5,051)
USD	200,000	EUR	(156,886)	02/05/2013	(5,580)
USD	766,145	EUR	(589,626)	02/05/2013	(10,014)
USD	600,000	EUR	(464,631)	02/05/2013	(10,714)
USD	358,948	EUR	(282,695)	02/05/2013	(11,140)
USD	958,400	EUR	(737,585)	02/05/2013	(12,527)
USD	2,060,000	EUR	(1,597,499)	02/05/2013	(39,048)
USD	40,711,421	EUR	(31,535,382)	02/05/2013	(735,988)
USD	138,812,126	EUR	(107,524,947)	02/05/2013	(2,509,468)
AUD	169,551	EUR	(132,744)	02/07/2013	(42)
GBP	15,316	EUR	(18,832)	02/07/2013	(71)
AUD	115,910	EUR	(92,355)	02/07/2013	(1,636)
EUR	936,941	GBP	(768,330)	02/07/2013	(4,179)
GBP	585,446	EUR	(721,309)	02/07/2013	(4,202)
AUD	833,970	EUR	(660,099)	02/07/2013	(7,377)
GBP	829,155	EUR	(1,026,506)	02/07/2013	(10,883)
GBP	4,147,097	EUR	(5,109,766)	02/07/2013	(30,028)
USD	1,080,423	EUR	(849,070)	02/07/2013	(31,712)
USD	3,760,255	EUR	(2,919,389)	02/07/2013	(74,693)
GBP	3,841,723	EUR	(4,781,271)	02/07/2013	(75,582)
EUR	13,980,828	SEK	(121,155,944)	02/08/2013	(111,795)
CAD	42,012	EUR	(31,966)	02/11/2013	(76)
CAD	18,446	EUR	(14,135)	02/11/2013	(133)
CAD	10,165	EUR	(7,865)	02/11/2013	(148)
CAD	9,016	EUR	(7,055)	02/11/2013	(211)
CAD	9,361	EUR	(7,367)	02/11/2013	(261)
CAD	10,986	EUR	(8,618)	02/11/2013	(279)
CAD	20,720	EUR	(16,027)	02/11/2013	(299)
CAD	15,866	EUR	(12,358)	02/11/2013	(314)
CAD	12,900	EUR	(10,127)	02/11/2013	(335)
CAD	24,434	EUR	(18,935)	02/11/2013	(388)
CAD	24,445	EUR	(18,983)	02/11/2013	(428)
CAD	24,522	EUR	(19,061)	02/11/2013	(447)
CAD	60,976	EUR	(46,918)	02/11/2013	(634)
CAD	31,355	EUR	(24,492)	02/11/2013	(691)
CAD	34,803	EUR	(27,181)	02/11/2013	(763)
CAD	53,532	EUR	(41,778)	02/11/2013	(1,144)
CAD	47,675	EUR	(37,347)	02/11/2013	(1,159)
CAD	135,960	EUR	(105,620)	02/11/2013	(2,417)
CAD	285,000	EUR	(219,238)	02/11/2013	(2,904)
CAD	381,015	EUR	(294,346)	02/11/2013	(5,130)
CAD	327,359	EUR	(255,813)	02/11/2013	(7,325)
CAD	3,078,916	EUR	(2,346,129)	02/11/2013	(9,026)

訂正有価証券届出書（内国投資信託受益証券）

CAD	543,225	EUR	(425,553)	02/11/2013	(13,210)
CAD	2,673,303	EUR	(2,069,436)	02/11/2013	(40,220)
CAD	36,604,998	EUR	(28,185,616)	02/11/2013	(399,982)
CAD	25,068,831	EUR	(19,665,129)	02/11/2013	(636,214)
CAD	113,931,954	EUR	(89,364,002)	02/11/2013	(2,882,052)
CHF	5,077	EUR	(4,209)	02/15/2013	(2)
CHF	5,065	EUR	(4,199)	02/15/2013	(2)
JPY	460,000	EUR	(4,031)	02/15/2013	(3)
EUR	6,046	GBP	(4,953)	02/15/2013	(20)
GBP	6,276	EUR	(7,709)	02/15/2013	(22)
GBP	1,556	EUR	(1,930)	02/15/2013	(24)
JPY	50,000	EUR	(469)	02/15/2013	(31)
GBP	5,467	EUR	(6,730)	02/15/2013	(35)
EUR	351,113	GBP	(286,723)	02/15/2013	(58)
GBP	9,715	EUR	(11,984)	02/15/2013	(85)
SGD	30,440	EUR	(18,958)	02/15/2013	(101)
GBP	602,440	EUR	(737,956)	02/15/2013	(102)
SGD	5,123	EUR	(3,277)	02/15/2013	(104)
JPY	220,000	EUR	(2,052)	02/15/2013	(126)
GBP	29,389	EUR	(36,148)	02/15/2013	(153)
JPY	152,399	EUR	(1,503)	02/15/2013	(168)
GBP	38,174	EUR	(46,925)	02/15/2013	(170)
JPY	162,885	EUR	(1,606)	02/15/2013	(180)
JPY	720,000	EUR	(6,531)	02/15/2013	(226)
GBP	49,180	EUR	(60,493)	02/15/2013	(259)
GBP	52,395	EUR	(64,499)	02/15/2013	(327)
EUR	49,241	GBP	(40,487)	02/15/2013	(347)
GBP	54,097	EUR	(66,653)	02/15/2013	(396)
GBP	25,112	EUR	(31,195)	02/15/2013	(439)
GBP	22,818	EUR	(28,400)	02/15/2013	(453)
GBP	90,833	EUR	(111,735)	02/15/2013	(484)
GBP	77,517	EUR	(95,431)	02/15/2013	(490)
GBP	22,169	EUR	(27,722)	02/15/2013	(569)
GBP	88,431	EUR	(108,920)	02/15/2013	(611)
GBP	57,462	EUR	(71,111)	02/15/2013	(733)
JPY	1,520,000	EUR	(14,150)	02/15/2013	(840)
GBP	58,486	EUR	(72,612)	02/15/2013	(980)
GBP	54,142	EUR	(67,298)	02/15/2013	(986)
JPY	27,880,000	EUR	(245,258)	02/15/2013	(1,109)
JPY	1,990,000	EUR	(18,550)	02/15/2013	(1,123)
GBP	77,670	EUR	(96,269)	02/15/2013	(1,141)
GBP	127,665	EUR	(157,519)	02/15/2013	(1,158)
JPY	1,970,000	EUR	(18,667)	02/15/2013	(1,416)
GBP	75,728	EUR	(94,371)	02/15/2013	(1,621)
GBP	86,414	EUR	(107,469)	02/15/2013	(1,631)
JPY	3,340,000	EUR	(31,343)	02/15/2013	(2,094)
JPY	3,510,000	EUR	(32,972)	02/15/2013	(2,235)
GBP	287,979	EUR	(355,500)	02/15/2013	(2,791)
GBP	119,926	EUR	(150,028)	02/15/2013	(3,145)
GBP	155,575	EUR	(193,876)	02/15/2013	(3,331)
GBP	311,559	EUR	(385,197)	02/15/2013	(3,607)
GBP	172,453	EUR	(216,014)	02/15/2013	(4,797)
GBP	379,218	EUR	(469,334)	02/15/2013	(4,877)
GBP	275,000	EUR	(341,823)	02/15/2013	(5,009)
GBP	371,826	EUR	(460,418)	02/15/2013	(5,015)
GBP	368,025	EUR	(456,153)	02/15/2013	(5,406)
GBP	613,454	EUR	(758,920)	02/15/2013	(7,577)
SGD	700,000	EUR	(442,177)	02/15/2013	(8,539)
JPY	24,000,000	EUR	(224,906)	02/15/2013	(14,735)
JPY	29,340,000	EUR	(273,366)	02/15/2013	(16,432)
JPY	30,570,000	EUR	(287,455)	02/15/2013	(19,750)
JPY	52,680,000	EUR	(481,633)	02/15/2013	(20,308)
JPY	41,250,000	EUR	(385,486)	02/15/2013	(24,254)
GBP	1,179,025	EUR	(1,474,694)	02/15/2013	(30,653)
JPY	147,970,000	EUR	(1,333,930)	02/15/2013	(38,139)
JPY	299,928,603	EUR	(2,796,302)	02/15/2013	(169,792)
JPY	429,990,000	EUR	(4,065,776)	02/15/2013	(300,303)
JPY	404,960,000	EUR	(3,905,544)	02/15/2013	(359,262)
JPY	430,000,000	EUR	(4,205,449)	02/15/2013	(439,888)
GBP	26,897,498	EUR	(33,463,507)	02/15/2013	(520,105)
JPY	1,900,000,000	EUR	(17,416,588)	02/15/2013	(778,065)
JPY	2,555,760,000	EUR	(23,651,852)	02/15/2013	(1,270,761)
GBP	114,696,979	EUR	(143,459,990)	02/15/2013	(2,981,921)
JPY	14,349,058,407	EUR	(141,512,382)	02/15/2013	(15,855,990)
USD	130,818,697	EUR	(102,853,620)	02/19/2013	(3,897,199)
EUR	317	SEK	(2,735)	02/20/2013	(1)
EUR	139	SEK	(1,206)	02/20/2013	(1)
EUR	239	SEK	(2,068)	02/20/2013	(2)
EUR	333	SEK	(2,893)	02/20/2013	(3)
EUR	355	SEK	(3,080)	02/20/2013	(3)
EUR	867	SEK	(7,513)	02/20/2013	(6)
EUR	1,509	SEK	(13,063)	02/20/2013	(10)
EUR	1,516	SEK	(13,136)	02/20/2013	(12)
EUR	3,002	SEK	(25,996)	02/20/2013	(20)
EUR	1,977	SEK	(17,316)	02/20/2013	(36)
EUR	2,074	SEK	(18,247)	02/20/2013	(48)
EUR	9,515	SEK	(82,240)	02/20/2013	(48)
EUR	6,361	SEK	(55,225)	02/20/2013	(61)
EUR	3,969	SEK	(34,730)	02/20/2013	(69)
EUR	13,550	SEK	(117,227)	02/20/2013	(81)
EUR	17,295	SEK	(149,451)	02/20/2013	(83)
SEK	2,827,444	EUR	(328,875)	02/20/2013	(112)
SEK	7,517,074	EUR	(874,890)	02/20/2013	(838)
EUR	2,557,782	SEK	(22,130,033)	02/20/2013	(15,399)
USD	123,800,210	CAD	(124,170,125)	02/20/2013	(582,724)
USD	178,141,053	CAD	(178,736,400)	02/22/2013	(880,941)

訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

AUD	12,870	EUR	(10,215)	02/25/2013	(157)
AUD	25,869	EUR	(20,689)	02/25/2013	(471)
AUD	33,308	EUR	(26,677)	02/25/2013	(644)
EUR	229,311	AUD	(295,093)	02/25/2013	(1,325)
AUD	150,975	EUR	(121,683)	02/25/2013	(3,686)
AUD	1,936,275	EUR	(1,560,298)	02/25/2013	(46,961)
AUD	16,000,000	EUR	(12,725,712)	02/25/2013	(220,569)
AUD	27,941,500	EUR	(22,208,948)	02/25/2013	(370,669)
AUD	139,064,247	EUR	(112,083,505)	02/25/2013	(3,394,858)
GBP	171,652	EUR	(211,276)	03/05/2013	(1,087)
GBP	205,597	EUR	(253,113)	03/05/2013	(1,358)
EUR	354,186	USD	(468,526)	03/12/2013	(159)
EUR	455,586	HKD	(4,670,444)	03/12/2013	(275)
EUR	1,435,828	HKD	(14,718,636)	03/12/2013	(792)
EUR	727,873	SGD	(1,177,089)	03/12/2013	(1,149)
EUR	421,961	HKD	(4,343,068)	03/12/2013	(1,947)
EUR	1,013,472	HKD	(10,426,490)	03/12/2013	(4,211)
EUR	1,368,782	HKD	(14,077,671)	03/12/2013	(5,276)
EUR	2,146,118	USD	(2,849,965)	03/12/2013	(9,299)
EUR	5,713,075	USD	(7,583,495)	03/12/2013	(22,291)
USD	3,084,609	AUD	(3,000,000)	03/18/2013	(8,007)
USD	27,505,980	AUD	(27,000,000)	03/18/2013	(265,285)
USD	3,084,528	AUD	(3,000,000)	03/19/2013	(7,900)
USD	27,563,625	AUD	(27,000,000)	03/19/2013	(220,178)
USD	3,084,165	AUD	(3,000,000)	03/20/2013	(8,007)
USD	27,746,550	AUD	(27,000,000)	03/20/2013	(80,331)
USD	15,413,625	AUD	(15,000,000)	03/21/2013	(44,640)
USD	29,811,420	AUD	(29,000,000)	03/21/2013	(77,421)
USD	81,174,354	EUR	(62,332,681)	03/22/2013	(946,713)
USD	81,000,000	EUR	(62,294,994)	03/25/2013	(1,042,628)
USD	78,000,000	EUR	(60,808,851)	03/25/2013	(1,825,092)
USD	115,225,000	SGD	(140,879,846)	04/19/2013	(111,517)
INR	6,331,095,238	USD	(115,225,000)	04/19/2013	(1,368,748)
USD	80,550,000	SGD	(98,511,039)	05/21/2013	(96,994)
INR	4,507,175,250	USD	(80,550,000)	05/21/2013	(202,270)
					(47,607,773)
純額(ユーロ)					(13,208,645)

7. スワップ契約

2012年12月31日現在、当会社は以下のスワップ契約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^

期限	契約	カウンターパーティー	通貨	想定元本	未実現評価(損)益 (ユーロ相当額)
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	25,000	193,904
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	25,000	202,968
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	44,000	225,364
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	30,000	229,662
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	45,000	245,101
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	33,000	246,637
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	50,000	268,600
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	55,000	300,445
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	40,000	335,946
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	66,000	337,364
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	50,000	386,943
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	88,000	399,512
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	91,000	527,783
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	136,000	541,034
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	91,000	545,867
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	88,000	550,283
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Deutsche Bank	USD	91,000	554,058
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Deutsche Bank	USD	91,000	565,111
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	133,000	726,490
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	300,000	748,325
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	178,000	762,004
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	150,000	765,150
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	92,652	849,290
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	200,000	907,320
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	165,000	931,450
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	200,000	939,171
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	250,000	1,142,640
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	247,678	1,194,827
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	150,000	1,334,535
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Barclays	GBP	141,872	1,348,870
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	250,000	1,482,239
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	500,000	1,521,700

訂正有価証券届出書（内国投資信託受益証券）

12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	300,000	1,801,440
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	320,000	1,802,263
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co.	USD	200,000	1,952,059
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	International plc	USD	200,000	1,992,703
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Deutsche Bank	JPY	19,700,000	110,542
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	23,000,000	140,854
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	7,950,000	153,482
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,980,000	339,829
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	100,000	54,905
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	200,000	69,201
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	50,000	134,981
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	GBP	56,488	373,720
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	250,000	383,626
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	97,000	424,067
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	300,000	447,375
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	GBP	170,000	447,503

△本サブファン드는香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

期限	契約	カウンターパーティー	通貨	想定元本	未実現評価（損）益 （ユーロ相当額）
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	GBP	79,667	505,291
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	188,000	861,180
12/11/2015	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,900,000	398,997
12/18/2015	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	200,000	20,098
06/20/2016	EDF SA 5.625% 02/21/2033変動金利支払、1.000% 固定金利受取	UBSAG	EUR	(700,000)	6,030
11/24/2017	米ドル修正前CPI連動金利支払、 2.765%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	2,100,000	31
12/17/2017	米ドル修正前CPI連動金利支払、 2.815%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	13,051,636	10,077
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Barclays	USD	(950,000)	2,695
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Deutsche Bank	USD	(10,000,000)	28,365
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	BNP Paribas	EUR	10,000,000	75,781
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	JP Morgan	EUR	12,000,000	90,937
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Credit Suisse International	USD	(40,000,000)	113,461
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Credit Suisse International	USD	(46,000,000)	130,480
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	BNP Paribas	EUR	22,000,000	166,719
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	(61,168,000)	173,505
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Credit Suisse International	EUR	25,000,000	189,453
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	25,000,000	189,453
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Barclays	EUR	25,000,000	189,453
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Barclays	EUR	35,000,000	265,234
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Barclays	EUR	36,556,400	277,029
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Deutsche Bank	EUR	42,000,000	318,281
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	47,443,600	359,533
12/18/2018	EURIBOR変動金利支払、1.520%固定金利受取	International plc	EUR	9,700,000	27,892
12/18/2018	EURIBOR変動金利支払、1.526%固定金利受取	JP Morgan	EUR	9,700,000	29,571
12/21/2018	EURIBOR変動金利支払、1.550%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	EUR	10,200,000	37,131
09/19/2022	米ドル修正前CPI連動金利支払、 2.848%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	3,352,381	20,609
05/24/2042	1.880%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	plc	EUR	73,610,000	2,383,023
05/25/2042	1.794%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	Barclays	EUR	46,480,000	1,731,277
05/28/2042	1.695%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	Barclays	EUR	10,215,000	437,859
05/31/2042	1.805%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	HSBC Bank plc	EUR	56,695,000	2,070,999
07/05/2042	2.394%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	UBS AG	EUR	40,000,000	119,909
09/20/2042	3.205%固定金利支払、 英ポンド修正前RPI連動金利受取	HSBC Bank plc	GBP	1,400,000	56,555
10/04/2042	3.190%固定金利支払、 英ポンド修正前RPI連動金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	950,000	44,558
					43,270,609
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	30,000,000	(1,927,113)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	40,295,000	(1,873,687)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	27,000,000	(1,564,926)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	15,330,000	(1,359,002)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	23,655,000	(949,789)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	20,000,000	(948,188)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	20,000,000	(930,228)

訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,000,000	(921,924)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Deutsche Bank	JPY	10,000,000	(897,673)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	13,636,000	(809,488)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	9,000,000	(785,813)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	15,000,000	(759,729)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	12,573,000	(738,309)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,980,000	(706,755)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	15,000,000	(694,536)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	10,641,000	(606,192)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	10,400,000	(571,409)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	6,805,532	(555,662)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Deutsche Bank	JPY	6,759,000	(495,138)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	6,762,000	(469,430)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Deutsche Bank	JPY	6,768,000	(468,982)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	6,506,000	(463,522)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	6,834,000	(430,344)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	7,071,000	(397,138)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	5,183,000	(278,254)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	3,812,500	(215,373)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	3,395,000	(212,907)
		Morgan Stanley & Co.			
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	International plc	JPY	3,471,000	(186,886)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	1,700,000	(1,656,233)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Barclays	HKD	1,410,991	(1,392,059)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	700,000	(646,262)
		Morgan Stanley & Co.			
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	International plc	HKD	618,400	(532,824)
		Morgan Stanley & Co.			
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	International plc	HKD	342,500	(304,790)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	700,000	(304,728)
		Morgan Stanley & Co.			
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	International plc	HKD	260,000	(244,550)
		Morgan Stanley & Co.			
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	International plc	HKD	260,000	(231,695)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	250,000	(216,322)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	100,000	(87,037)
12/12/2014	固定金利支払、日経225受取	Societe Generale	JPY	10,000,000	(97,021)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	2,080,000	(789,489)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	1,020,000	(404,607)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	BNP Paribas	HKD	1,100,000	(338,056)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	BNP Paribas	HKD	708,434	(262,001)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	BNP Paribas	HKD	564,855	(222,159)
12/08/2017	2.75%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	7,428,364	(3,409)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ				
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Barclays	EUR	(143,614,000)	(2,789,332)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ	Morgan Stanley & Co.			
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	International plc	EUR	(128,772,800)	(2,501,080)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ	Morgan Stanley & Co.			
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	International plc	EUR	(50,000,000)	(971,121)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ				
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Deutsche Bank	EUR	(50,000,000)	(971,121)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ				
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Deutsche Bank	EUR	(45,000,000)	(874,009)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ				
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	BNP Paribas	EUR	(31,834,800)	(618,309)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ	Credit Suisse			
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	International	EUR	(31,778,400)	(617,214)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ				
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	BNP Paribas	EUR	(30,000,000)	(582,673)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ	Credit Suisse			
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	International	EUR	(25,000,000)	(485,561)
	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ				
12/20/2017	18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	JP Morgan	EUR	(24,000,000)	(466,138)
	2.165%固定金利支払、				
09/19-2022	ユーロ修正前CPI(除くタバコ)連動金利受取	Royal Bank of Scotland plc	EUR	2,556,948	(42,727)
	2.115%固定金利支払、				
09/24/2022	ユーロ修正前CPI(除くタバコ)連動金利P	Royal Bank of Scotland plc	EUR	2,543,052	(29,250)
	米ドル修正前CPI連動金利支払、				
09/24/2022	2.763%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	3,047,619	(4,171)
	英ポンド-LIBOR-BBA変動金利支払、				
05/24/2042	3.460%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	GBP	68,170,000	(1,565,192)
	英ポンド-LIBOR-BBA変動金利支払、				
05/24/2042	3.394%固定金利受取	Barclays	GBP	39,695,000	(1,062,274)
	英ポンド-LIBOR-BBA変動金利支払、				
05/24/2042	3.330%固定金利受取	Barclays	GBP	8,720,000	(265,632)
	英ポンド-LIBOR-BBA変動金利支払、				
05/25/2042	3.385%固定金利受取	HSBC Bank plc	GBP	48,415,000	(1,320,206)
	英ポンド-LIBOR-BBA変動金利支払、				
07/05/2042	3.573%固定金利受取	UBS AG	GBP	13,000,000	(206,580)
	英ポンド-LIBOR-BBA変動金利支払	Morgan Stanley & Co.			
09/27/2042	3.700%固定金利受取	International plc	GBP	43,000,000	(318,103)
		Morgan Stanley & Co.			
09/28/2042	2.498%固定金利支払、ユーロ-EURIBOR受取	International plc	EUR	56,000,000	(170,787)
					(44,813,119)
					純額(ユーロ)
					(1,542,510)

8. 先物契約

2012年12月31日現在、当会社は以下の先物契約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^						
種類	満期日	通貨	購入（売却） 契約数	想定元本 （先物契約の通貨）	未実現評価（損）益 （ユーロ相当額）	
ハンセン指数先物	1/30/2013	HKD	235	26,014,333		177,122
スイス市場IX先物	03/15/2013	CHF	(328)	(18,337,645)		278,460
ラッセル2000ミニ先物	03/15/2013	USD	(7,160)	(446,865,983)		812,076
FTSE 100指数先物	03/15/2013	GBP	(1,922)	(137,609,273)		896,997
ユーロ債先物	03/07/2013	EUR	1,029	149,863,560		1,420,700
米国超長期債（CBT）先物	03/19/2013	USD	(1,767)	(219,137,920)		2,232,917 5,818,272
ナスダック100指数ミニ先物	03/15/2013	USD	7,126	278,915,477		(8,091,938)
S&P指数ミニ先物	03/15/2013	USD	2,961	155,064,642		(3,112,129)
ユーロストック銀行先物	03/15/2013	EUR	(13,701)	(76,246,065)		(2,116,805)
米国10年債（CBT）先物	03/19/2013	USD	5,849	588,502,688		(1,927,797)
Euro OAT先物	03/07/2013	EUR	(1,048)	(142,695,680)		(1,002,660)
FTSE MID 250 指数先物	03/15/2013	GBP	(147)	(22,294,269)		(344,070)
ユーロストック50先物	03/15/2013	EUR	(1,661)	(43,435,150)		(271,468)
MSCI 台湾指数先物	01/30/2013	USD	(4,630)	(96,356,710)		(190,261)
OMXS30指数先物	01/18/2013	SEK	(1,097)	(14,153,379)		(83,564)
						(17,140,692)
						純額（ユーロ） (11,322,420)

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

9. オプション契約

2012年12月31日現在、当会社は以下のオプション契約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^								
期限	通貨	契約	カウンターパーティー	ブット/ コール	行使 価格	想定元本	未実現評価（損）益 （ユーロ相当額）	時価 （ユーロ）
01/16/2013	USD	01/2013限月VIXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	21.00	15,400	707,536	3,379,770
01/19/2013	USD	01/2013限月AAPL USブット	Royal Bank of Scotland plc	ブット	560.00	113	(155,972)	455,115
01/19/2013	USD	01/2013限月AAPL USブット	Royal Bank of Scotland plc	ブット	555.00	350	(594,346)	1,298,403
02/13/2013	USD	02/2013限月VIXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	22.00	13,100	(181,662)	2,280,171
02/19/2013	USD	米ドル/日本円コール	HSBC Bank plc	コール	95.00	2,200,000	(10,460)	495
02/26/2013	USD	米ドル/日本円コール	HSBC Bank plc	コール	94.00	1,000,000	(5,197)	496
05/31/2013	USD	日本円/米ドルコール	Barclays Bank plc	コール	97.00	78,944,000	(1,199,942)	145,071
05/31/2013	USD	米ドル/日本円ブット	Barclays Bank plc	ブット	79.00	78,944,000	(2,111,700)	155,144
08/28/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.45	18,477,559	(118,227)	33,459
08/28/2013	USD	人民元/米ドルコール	UBS AG	コール	6.45	21,117,210	(131,022)	38,239
08/28/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.45	26,396,513	(157,897)	47,798
08/28/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.45	18,477,559	165,856	306,497
08/28/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.45	21,117,210	179,515	350,282
08/28/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.45	26,396,513	231,947	437,853
09/20/2013	GBP	09/2013限月UKXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	5,800.00	1,700	(722,406)	6,103,967
09/21/2013	USD	09/2013限月SPXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	1,425.00	3,160	(1,853,728)	17,505,175
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	8,864,337	17,812	53,994
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	11,819,116	14,208	71,992
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	8,864,337	(38,360)	72,855
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	11,819,116	(57,405)	97,140
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	17,728,674	21,651	107,988
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	23,638,232	24,367	143,984
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	17,728,674	(86,787)	145,710
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	29,547,790	35,519	179,980
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	29,547,791	29,765	179,980
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	29,547,791	37,785	179,980
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	23,638,232	(93,618)	194,280
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	29,547,790	(137,847)	242,850
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	29,547,791	(154,147)	242,850

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

期限	通貨	契約	カウンターパーティー	ブット/ コール	行使 価格	想定元本	未実現評価（損）益 （ユーロ相当額）	時価 （ユーロ）
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	29,547,791	(132,181)	242,850
12/12/2013	KRW	韓国証券取引所コール	UBS AG	コール	249.32	3,146,132	1,336,037	6,633,757
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	995.83	15,000	(2,092,409)	383,572
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	982.72	18,500	(2,545,836)	470,958
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	140.43	18,000	(2,362,240)	483,544
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	199.60	18,000	(2,363,559)	493,371
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	3.08	30,500	(4,328,539)	781,864

訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCプットオプション	UBS AG	プット	304.39	30,000	(3,926,445)	852,046
05/12/2014	EUR	EURIBOR支払、2.600%受取	Barclays Bank plc	プット	2.60	82,000,000	4,950,443	5,631,043
05/16/2014	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	88.00	55,000,000	(503,183)	1,560,244
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	UBS AG	コール	267.94	1,598,549	(366,041)	2,713,382
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	BNP Paribas	コール	266.78	1,632,315	(323,372)	2,835,250
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	Deutsche Bank	コール	267.10	1,716,981	(327,541)	2,963,271
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	BNP Paribas	コール	252.24	1,707,599	511,304	3,907,685
07/21/2014	EUR	EURIBOR支払、1.500%受取	Royal Bank of Scotland plc	コール	1.50	34,579,000	221,460	753,312
07/23/2014	EUR	EURIBOR支払、1.500%受取	HSBC Bank plc	コール	1.50	315,421,000	1,293,216	6,863,216
10/24/2014	USD	米ドル/日本円プット	Barclays Bank plc	プット	67.00	21,000,000	(372,119)	75,590
10/24/2014	USD	米ドル/日本円コール	Barclays Bank plc	コール	81.00	21,000,000	515,543	1,335,566
12/08/2014	EUR	EURIBOR支払、1.500%受取	JP Morgan Chase Bank	コール	1.50	206,000,000	441,016	4,126,016
01/19/2015	EUR	EURIBOR支払、2.600%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	プット	2.60	88,370,000	2,856,502	5,256,674
01/13/2016	USD	米ドル/日本円コール	Royal Bank of Scotland plc	コール	82.00	2,000,000	51,808	134,763
01/13/2016	USD	米ドル/日本円コール	Royal Bank of Scotland plc	コール	82.00	18,784,000	(8,550)	1,265,696
								84,215,188
01/19/2013	USD	01/2013満期AAPL USコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	555.00	(350)	1,782,827	(109,922)
01/19/2013	USD	01/2013満期AAPL USコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	560.00	(113)	580,729	(30,358)
02/19/2013	USD	米ドル/日本円プット	HSBC Bank plc	プット	77.00	(2,200,000)	104,088	(34)
02/26/2013	USD	米ドル/日本円プット	HSBC Bank plc	プット	77.00	(1,000,000)	47,652	(37)
04/05/2013	USD	2.800%固定金利支払、米ドルLIBOR受取	HSBC Bank plc	コール	2.80	(50,523,000)	169,573	(1,460,040)
04/10/2013	USD	2.800%固定金利支払、米ドルLIBOR受取	Barclays Bank plc	コール	2.80	(41,795,000)	518,135	(1,231,094)
04/10/2013	USD	2.800%支払、米ドルLIBOR受取	Royal Bank of Scotland plc	コール	2.80	(33,682,000)	525,949	(992,121)
05/14/2013	USD	2.800%支払、米ドルLIBOR受取	HSBC Bank plc	コール	2.80	(14,700,000)	467,784	(478,644)
05/31/2013	USD	米ドル/日本円コール	Barclays Bank plc	コール	79.00	(78,944,000)	3,911,391	(155,144)
05/31/2013	USD	米ドル/日本円コール	Barclays Bank plc	コール	97.00	(78,944,000)	364,318	(145,071)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	81.00	(26,396,513)	(851,283)	(1,349,116)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	81.00	(21,117,210)	(698,749)	(1,079,292)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	81.00	(18,477,559)	(597,565)	(944,381)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	76.00	(26,396,513)	473,090	(56,922)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	76.00	(21,117,210)	383,893	(45,537)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	76.00	(18,477,559)	330,534	(39,845)
09/26/2013	USD	2.40%支払、米ドルLIBOR受取	Morgan Stanley & Co. International	プット	2.40	(25,000,000)	444,389	(409,263)
12/10/2013	USD	2.40%支払、米ドルLIBOR受取	JP Morgan Chase Bank	コール	2.40	(48,000,000)	501,059	(947,923)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(29,547,791)	(289,916)	(1,024,614)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(29,547,791)	(408,249)	(1,024,614)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(29,547,790)	(398,051)	(1,024,614)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(23,638,232)	(358,053)	(819,691)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(17,728,674)	(232,033)	(614,769)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(11,819,116)	(154,688)	(409,846)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(8,864,337)	(73,116)	(307,384)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	79.50	(29,547,791)	261,218	(260,540)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	79.50	(29,547,791)	180,505	(260,540)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	79.50	(29,547,790)	257,819	(260,540)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	79.50	(23,638,232)	242,290	(208,432)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	79.50	(17,728,674)	150,612	(156,324)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	79.50	(11,819,116)	100,408	(104,216)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円プット	UBS AG	プット	79.50	(8,864,337)	26,216	(78,162)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCプットオプション	UBS AG	プット	150.92	(55,000)	2,682,282	(1,612,227)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCプットオプション	UBS AG	プット	161.39	(36,000)	1,806,690	(1,106,462)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCプットオプション	UBS AG	プット	144.08	(34,000)	1,827,529	(966,174)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCプットオプション	UBS AG	プット	158.51	(30,000)	1,556,506	(910,148)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCプットオプション	UBS AG	プット	137.31	(33,000)	1,786,099	(909,290)
05/12/2014	EUR	2.700%固定金利支払、EURIBOR受取	Barclays Bank plc	プット	2.70	(42,000,000)	(2,797,545)	(3,338,505)
05/16/2014	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	プット	71.00	(55,000,000)	1,877,869	(207,778)
07/21/2014	EUR	1.70%固定金利支払、EURIBOR受取	Royal Bank of Scotland plc	プット	1.70	(18,193,000)	25,042	(364,746)
07/23/2014	EUR	1.700%固定金利支払、EURIBOR受取	HSBC Bank plc	プット	1.70	(161,807,000)	1,055,075	(3,244,925)
10/24/2014	USD	日本円/米ドルコール	Barclays Bank plc	コール	81.00	(21,000,000)	(126,979)	(1,335,566)
10/24/2014	USD	米ドル/日本円プット	Barclays Bank plc	プット	67.00	(21,000,000)	792,927	(75,590)
12/08/2014	EUR	1.700%固定金利支払、EURIBOR受取	JP Morgan Chase Bank	コール	1.70	(110,000,000)	(232,444)	(2,232,444)
01/19/2015	EUR	2.800%固定金利支払、EURIBOR受取	Royal Bank of Scotland plc	コール	2.80	(47,000,000)	(1,517,361)	(3,693,725)
01/13/2016	USD	米ドル/日本円コール	Royal Bank of Scotland plc	プット	68.00	(18,784,000)	1,066,469	(237,436)
01/13/2016	USD	米ドル/日本円プット	Royal Bank of Scotland plc	プット	68.00	(2,000,000)	94,167	(25,281)
								(36,289,327)
								純額(ユーロ) 47,925,861

10. 交渉型証券売買手数料

投資顧問会社は、当会社に関して交渉型証券売買手数料を導入しません。投資顧問会社及びその関連当事者はいずれも、サブファンドのために取引を指示する謝礼として証券ブローカー又はディーラーから現金リポートを得る権利を有していません。受領した現金リポートは、当該サブファンドの勘定に計上されます。

11. 関連当事者取引

投資顧問会社及び販売会社以外に関連当事者は存在しません。

2012年12月31日現在、Global Absolute Return Strategies Fundは、関連ファンドのスタンダード・ライフ・インベストメント欧州株式インカム・ファンドに評価額で1億5,500万ユーロを保有していました。この金額はこのサブファンドの純資産の4.71%に相当します。すべての関連取引は通常の市場状況のもとで行われました。

12. 価格変動修正

評価日における各サブファンド内の各々のクラス及びカテゴリーの1投資証券当たりの純資産価値は、当該クラス及びカテゴリーに適切に配分可能なサブファンドの総資産評価額から当該クラス及びカテゴリーに適切に配分可能な当該サブファンドの負債を減じた金額を、当該評価日において発行済みの当該クラス及びカテゴリーの投資証券総数で除することにより決定されます。

しかしながら、評価日にサブファンドの全てのクラス及びカテゴリーの投資証券の累計取引が、そのサブファンドに関する販売会社により随時定められた基準を超える投資証券数の純増加又は減少をもたらした場合（サブファンドの募集、償還、転換及び関連費用に基づき）、当該サブファンドの1投資証券当たりの純資産価値は、サブファンドに発生する可能性のある推定の財務及びディーリング費用を反映する金額に修正されます。この修正は、純変動がサブファンドの全投資証券の増加をもたらす場合は増額となり、減少をもたらす場合は減額となります。同様に、かかる修正が行われた場合、当該サブファンドが保有する有価証券の評価は、予想される呼び値スプレッドを反映して修正される可能性があります。この修正は純資産計算書の「その他の資産」又は「その他の負債」に計上されます。

13. 担保

以下の表は、2012年12月31日現在保有するデリバティブ契約に関してブローカーに供されている現金担保を示しています：

Global Absolute Return Strategies Fund ^	BNP Paribas	EUR	(16,367,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Deutsche Bank AG	EUR	(2,392,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	HSBC Bank plc	EUR	(5,354,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	HSBC Bank plc	GBP	(240,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Royal Bank of Canada	GBP	(320,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Royal Bank of Scotland plc	EUR	(3,875,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Societe Generale	EUR	(3,201,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	UBS AG	EUR	(11,194,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	State Street	GBP	(30,000)

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

14. 重要なイベント

以下の投資証券クラス（ヘッジあり）を当年度中にローンチしました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスA 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスD 累積型投資証券（豪ドル、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスD 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスD 累積型投資証券（シンガポールドル、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスZ 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）

当年度中に当会社に影響を与えるその他の重要なイベントはありませんでした。

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

15. その後のイベント

当年度末以降に当会社に影響を与えるその他の重要なイベントはありませんでした。

Standard Life Investments Global SICAV

Soci t  d'Investissement   Capital Variable

Global Absolute Return Strategies Fund

サブファンドの目的

本サブファンドは、あらゆる市場条件において中・長期にわたって資本増加の形でプラスの絶対収益をもたらすことを目的としています。

運用方針

認められたデリバティブ契約（先物、オプション、スワップ、先物為替予約及びその他のデリバティブなど）、確定利付証券、株式、及び現金によるポートフォリオでの運用によりこの目標を達成する予定です。さらに本サブファンドは、適格な譲渡可能証券、預金、短期金融商品、及び集合投資事業などの形態で投資する場合もあります。

パフォーマンス・レビュー

Global Absolute Return Strategies Fundは、6か月EURIBORの0.85%に対して、レビューを行った12か月間において7.48%の収益をもたらしました。

2012年の初めに金融市場が上昇したため、本サブファンドは株式及びクレジットの収益により恩恵を受けるポジションを構築しました。グローバル株式ポジションが収益に寄与し、投資適格債及びハイイールド債ポジションも収益に寄与しました。レバティブ・バリュ戦略の中では、米国のテクノロジー株が小型株をアウトパフォームするという見通しが功を奏しました。その後市場は、ユーロ圏をめぐる懸念が強まったため、2012年第2四半期に下落しました。その結果、クレジット市場は引き続き小幅な上昇を示しましたが、本サブファンドの主要な株式ポジションは収益にマイナス寄与となりました。これは、株式ボラティリティ戦略にとって厳しい環境となり、ロング・ボラティリティ及びレバティブ・バリュの両戦略が収益にマイナス寄与となりました。

中央銀行の刺激策を受け、同年下半期に入り市場は再び上昇しました。本サブファンドの主要な株式ポジションは収益にプラス寄与となった一方、ハイイールド債及び社債の保有も収益をもたらしました。最近導入したフランスに対するドイツのデレレーション戦略など、金利及びデレレーション戦略は概してプラスの収益をもたらしました。同年の第4四半期に入り、株式市場が更に上昇した結果、欧州及びロシアの株式により大きな収益を生み出しました。米国市場の中では、小型株が大型株をアウトパフォームし、本ファンドにとってはマイナスとなりました。しかし、グローバル上場不動産株の新たなポジションが収益を上げました。

* パフォーマンスは、機関投資家向け投資証券クラス及び報酬控除後を基準に、株価パフォーマンスに基づき本報告期間について計算されています。

見直し

訂正有価証券届出書（内国投資信託受益証券）

グローバル市場の回復は不安定であり、長期化すると引き続き考えられ、金融機関の追加規制により金融機関のクレジット・リスクは低下し、その高い相対スプレッドを活用することが可能となります。したがって、ロング及びレバティフ・バリュエーションの戦略によるクレジット・ポジションは引き続き、本サブファンドのポートフォリオの一部を形成します。欧州の銀行株についてリストラ圧力を活用するポジションも構築します。新興市場の成長可能性も継続的な投資テーマであり、本ファンドはそれに関して多くの戦略を有しています。

投資有価証券明細表 地理的分類
2012年12月31日現在（純資産総額に対する割合で表示）

オーストラリア	1.28%
オーストリア	0.11%
バルバドス	0.00%
ベルギー	0.19%
バミューダ	0.20%
ブラジル	0.02%
カナダ	0.58%
ケイマン諸島	0.36%
クロアチア	0.00%
キプロス	0.00%
チェコ共和国	0.04%
デンマーク	0.41%
欧州連合	26.81%
フィンランド	0.12%
フランス	3.25%
ドイツ	2.06%
ガンジー島	0.01%
香港	0.60%
インド	0.02%
インドネシア	0.01%
アイルランド	0.54%
イタリア	0.57%
日本	0.61%
ジャージー島	0.67%
ルクセンブルグ	0.72%
マレーシア	0.02%
マーシャル諸島	0.01%
メキシコ	3.30%
オランダ	2.08%
ニュージーランド	0.07%
ノルウェー	0.21%
ポルトガル	0.08%
ロシア	2.82%
シンガポール	0.14%
超国家	0.35%
南アフリカ	0.02%
韓国	0.02%
スペイン	0.55%
スウェーデン	0.93%
スイス	0.42%
トルコ	0.01%
アラブ首長国連邦	0.02%
英国	15.81%
米国	14.99%

保有上位10銘柄
2012年12月31日現在
（純資産総額に対する割合で表示）

スタンダード・ライフ・インベストメント欧州株式インカム・ファンド	4.71%
ICAP 0.300% 01/17/2013満期	1.86%
Barclays 0.000% 01/09/2013満期	1.83%
KBC Bank NV 0.160% 02/28/2013満期	1.52%
Societe Generale 0.090% 01/31/2013満期	1.52%
Sumi 0.090% 02/06/2013満期	1.52%
Deutsche Bank 0.0175% 06/06/2013満期	1.52%
ING Bank 0.320% 05/02/2013満期	1.37%
Societe Generale 0.740% 01/01/2013満期	1.22%
Svenska 0.200% 02/15/2013満期	1.22%

本サブファンドのグローバル・エクスポージャーのリスク測定及び計算について、絶対バリュエーション・アット・リスク（以下、「VaR」）が用いられています。

絶対VaRは、サブファンドのNAVの20%未満に制限されています。以下の数値は、本サブファンドのこの20%のVaRリミットに対する2012年12月31日における99%信頼水準のVaRを示しています。使用したモデルは、3.5年（180週）の期間についての週単位の価格リターンに基づくリスク・プロフィールを計算する中期ボラティリティ・モデルのAPTモデルです。この計算において各々の週間リターンは均等な重要性を有しています。このモデルにより算出されたボラティリティの数値は、3か月から2年までの中期的な予測のためのものです。使用された保有期間は1か月（20日）であり、計算のための観測期間は2012年1月1日から2012年12月31日までの間です。

最大：15.40%
最低：23.50%
平均：18.85%

レバレッジは、デリバティブの用いられた国の合計として計算されています。該当期間に用いられたレバレッジの水準は320%でした。

本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

[次へ](#)

投資有価証券明細表（ユーロ表示）
2012年12月31日現在

数量/想定元本	通貨	有価証券の銘柄	時価 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
取引所上場を認められた譲渡可能証券及び短期金融商品				
オーストラリア				
150,000	GBP	APT Pipelines Ltd 4.250% 26 November 2024	184,096	0.01%
1,207,000	AUD	Australia Government Bond 4.000% 20 August 2015	1,717,392	0.05%
1,811,000	AUD	Australia Government Bond 3.000% 20 September 2025	1,946,692	0.06%
3,445,000	AUD	Australia Government Bond 2.500% 20 September 2030	3,506,134	0.11%
550,000	EUR	BHP Billiton Finance Ltd 2.125% 29 November 2018	573,518	0.02%
216,030	AUD	Brambles Ltd	1,273,966	0.04%
1,258,418	AUD	Centro Retail Australia	2,243,132	0.07%
1,582,000	GBP	Commonwealth Bank of Australia 3.875% 14 December 2015	2,079,112	0.06%
4,171,093	AUD	Dexus Property Group	3,324,451	0.10%
1,683,435	AUD	GPT Group	4,864,612	0.15%
3,049,312	AUD	Mirvac Group	3,555,759	0.11%
162,000	EUR	National Australia Bank Ltd 3.500% 23 January 2015	171,434	0.01%
300,000	GBP	National Australia Bank Ltd 3.625% 08 November 2017	396,734	0.01%
187,147	AUD	Oil Search Ltd	1,030,160	0.03%
400,000	EUR	Origin Energy Finance Ltd FRN 16 June 2071	422,196	0.01%
783,000	GBP	QBE Insurance Group Ltd 6.125% 28 September 2015	1,058,490	0.03%
1,106,000	EUR	Santos Finance Ltd FRN 22 September 2070	1,170,978	0.04%
108,167	AUD	Santos Ltd	942,805	0.03%
92,000	EUR	Wesfarmers Ltd 3.875% 10 July 2015	98,969	0.00%
300,000	EUR	Wesfarmers Ltd 2.750% 02 August 2022	307,778	0.01%
935,612	AUD	Westfield Group	7,758,248	0.24%
308,000	EUR	Westpac Banking Corp 4.250% 22 September 2016	345,640	0.01%
		オーストラリア合計	38,972,296	1.20%
オーストリア				
59,883	EUR	Oesterreichische Post AG	1,868,350	0.06%
300,000	EUR	Wienerberger AG FRN 09 February 2017	258,750	0.01%
		オーストリア合計	2,127,100	0.07%
バルバドス				
51,000	USD	Barbados Government International Bond 7.250% 15 December 2021	40,139	0.00%
		バルバドス合計	40,139	0.00%
ベルギー				
18,007	EUR	Anheuser-Busch InBev NV	1,183,780	0.04%
44,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 6.570% 27 February 2014	47,025	0.00%
90,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 8.625% 30 January 2017	117,556	0.00%
470,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 1.250% 24 March 2017	476,221	0.01%
365,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 4.000% 26 April 2018	416,522	0.01%
91,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 4.000% 02 June 2021	105,237	0.00%
440,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 2.875% 25 September 2024	458,800	0.01%
8,142	EUR	Anheuser-Busch InBev NV strip VVPR	8	0.00%
208,000	EUR	Barry Callebaut Services NV 6.000% 13 July 2017	233,496	0.01%
80,000	EUR	Fortis Bank SA/NV 4.500% 30 May 2014	84,163	0.00%
15,279	EUR	KBC Groep NV	399,546	0.01%
27,863	EUR	UCB SA	1,204,239	0.04%
46,865	EUR	Umicore SA	1,953,802	0.06%
		ベルギー合計	6,680,395	0.19%
バミューダ				
450,000	EUR	Central European Media Enterprises Ltd 11.625% 15 September 2016	474,750	0.01%
349,000	USD	Hongkong Land Holdings Ltd	1,846,166	0.06%
12,265	USD	Invesco Ltd	239,287	0.01%
406,500	HKD	Kerry Properties Ltd	1,597,619	0.05%
40,967	GBP	Lancashire Holdings Ltd	389,324	0.01%
47,861	USD	Lazard Ltd	1,078,636	0.03%
		バミューダ合計	5,625,782	0.17%
ブラジル				
100,000	EUR	Vale SA 4.375% 24 March 2018	110,788	0.00%
500,000	EUR	Vale SA 3.750% 10 January 2023	525,781	0.02%
		ブラジル合計	636,569	0.02%
カナダ				
1,856,000	USD	Air Canada 9.250% 01 August 2015	1,474,808	0.05%
300,000	EUR	Bombardier Inc 6.125% 15 May 2021	321,348	0.01%
18,802	CAD	Enovus Energy Inc	471,150	0.01%
1,205,000	USD	Novelis Inc/GA 8.750% 15 December 2020	1,021,347	0.03%
34,538	CAD	Suncor Energy Inc	845,783	0.03%
500,000	USD	Teck Resources Ltd 3.750% 01 February 2023	390,062	0.01%
		カナダ合計	4,524,498	0.14%
ケイマン諸島				
18,155	USD	51 Job Inc	637,916	0.02%
8,679	USD	Baidu Inc	650,239	0.02%
277,000	HKD	China Mengniu Dairy Co Ltd	595,044	0.02%
532,200	HKD	China Metal Recycling Holdings Ltd	416,769	0.01%
1,200,000	HKD	China Resources Land Ltd	2,472,353	0.07%
800,000	EUR	Hutchison Whampoa Finance 09 Ltd 4.750% 14 November 2016	908,907	0.03%
200,000	EUR	IPIC GMTN Ltd 4.875% 14 May 2016	222,666	0.01%
200,000	USD	IPIC GMTN Ltd 3.750% 01 March 2017	162,140	0.01%
321,981	GBP	Punch Taverns Finance B Ltd 7.369% 30 June 2022	367,938	0.01%
508,000	GBP	Punch Taverns Finance B Ltd 5.943% 30 December 2024	552,525	0.02%

400,000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd 3.706% 31 March 2034	860,045	0.03%
68,000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd FRN 31 March 2038	87,470	0.00%
301,460	GBP	Sutton Bridge Financing Ltd 8.625% 30 June 2022	427,878	0.01%
290,000	EUR	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd 3.250% 09 November 2016	314,275	0.01%
450,000	GBP	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd FRN 21 July 2025	605,546	0.02%
644,000	GBP	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd FRN 13 September 2030	897,646	0.03%
356,000	EUR	UPCB Finance Ltd 7.625% 15 January 2020	393,380	0.01%
200,000	EUR	Viridian Group FundCo II 11.125% 01 April 2017	209,994	0.01%
		ケイマン諸島合計	10,782,731	0.34%
100,000	EUR	クロアチア Agrokor DD 9.125% 01 February 2020	109,000	0.00%
		クロアチア合計	109,000	0.00%
23,157	NOK	キプロス ProSafe SE	149,099	0.00%
		キプロス合計	149,099	0.00%
270,000	EUR	チェコ共和国 CET 21 spol sro 9.000% 01 November 2017	294,300	0.01%
200,000	EUR	CEZ AS 6.000% 18 July 2014	216,250	0.01%
250,000	EUR	CEZ AS 5.750% 26 May 2015	279,265	0.01%
214,000	EUR	CEZ AS 3.625% 27 May 2016	233,746	0.01%
66,000	EUR	CEZ AS 4.500% 29 June 2020	77,441	0.00%
54,000	EUR	CEZ AS 5.000% 19 October 2021	66,092	0.00%
67,000	EUR	CEZ AS 4.875% 16 April 2025	81,496	0.00%
		チェコ共和国合計	1,248,590	0.04%
99	DKK	デンマーク AP Moeller - Maersk A/S	565,305	0.02%
734,000	EUR	AP Moeller - Maersk A/S 4.875% 30 October 2014	780,602	0.02%
430,000	EUR	AP Moeller - Maersk A/S 3.375% 28 August 2019	451,764	0.01%
422,000	EUR	Carlsberg Breweries A/S 6.000% 28 May 2014	453,437	0.01%
553,000	GBP	Carlsberg Breweries A/S 7.250% 28 November 2016	812,347	0.02%
87,690	DKK	Danske Bank A/S	1,124,276	0.03%
412,000	EUR	Danske Bank A/S 4.750% 04 June 2014	434,422	0.01%
405,000	GBP	Danske Bank A/S 4.000% 09 December 2015	526,506	0.02%
250,000	EUR	Danske Bank A/S 3.875% 18 May 2016	271,942	0.01%
396,000	GBP	Danske Bank A/S FRN 15 February 2017	452,308	0.01%
190,000	EUR	Danske Bank A/S 3.875% 28 February 2017	208,779	0.01%
188,000	EUR	Danske Bank A/S FRN 16 March 2018	190,268	0.01%
121,000	EUR	DONG Energy A/S 4.000% 16 December 2016	134,909	0.00%
400,000	EUR	DONG Energy A/S 6.500% 07 May 2019	508,292	0.02%
58,000	EUR	DONG Energy A/S 4.875% 16 December 2021	69,477	0.00%
1,550,000	GBP	DONG Energy A/S 4.875% 12 January 2032	2,045,745	0.06%
435,000	EUR	DONG Energy A/S FRN 01 June 2010	486,741	0.02%
574,000	EUR	ISS A/S 8.875% 15 May 2016	598,303	0.02%
17,474	DKK	Novo Nordisk A/S	2,146,656	0.07%
400,000	EUR	TDC A/S 3.500% 23 February 2015	422,447	0.01%
15,158	DKK	Tryg A/S	866,560	0.03%
		デンマーク合計	13,551,086	0.41%
400,000	EUR	フィンランド Fortum OYJ 4.000% 24 May 2021	457,085	0.01%
580,000	EUR	Fortum OYJ 2.250% 06 September 2022	575,809	0.02%
235,000	EUR	Nokia OYJ 5.500% 04 February 2014	243,011	0.01%
340,000	EUR	Pohjola Bank Plc 5.750% 28 February 2022	400,512	0.01%
32,849	EUR	Sampo	799,545	0.02%
48,321	EUR	Wartsila OYJ Abp	1,581,063	0.05%
		フィンランド合計	4,057,025	0.12%
350,000	EUR	フランス Air Liquide Finance SA 3.889% 09 June 2020	405,303	0.01%
400,000	EUR	Alstom SA 4.000% 23 September 2014	420,749	0.01%
100,000	EUR	Alstom SA 3.875% 02 March 2016	107,590	0.00%
100,000	EUR	Areva SA 3.875% 23 September 2016	106,004	0.00%
600,000	EUR	Areva SA 4.625% 05 October 2017	656,059	0.02%
200,000	EUR	Areva SA 4.875% 23 September 2024	218,677	0.01%
150,000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA 4.125% 13 April 2020	169,600	0.01%
51,000	EUR	AXA SA FRN 06 July 2016	50,416	0.00%
669,000	GBP	AXA SA FRN 16 October 2019	791,968	0.02%
639,000	GBP	AXA SA 7.125% 15 December 2020	905,850	0.03%
600,000	EUR	AXA SA FRN 16 April 2040	628,274	0.02%
100,000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.000% 22 October 2020	105,007	0.00%
200,000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.250% 23 August 2022	215,211	0.01%
50,000	EUR	Banque PSA Finance SA 3.500% 17 January 2014	50,622	0.00%
350,000	EUR	Banque PSA Finance SA 6.000% 16 July 2014	368,952	0.01%
61,597	EUR	BNP Paribas SA	2,623,108	0.08%
600,000	EUR	BNP Paribas SA 3.500% 07 March 2016	645,618	0.02%
400,000	EUR	BNP Paribas SA 3.000% 24 February 2017	428,326	0.01%
450,000	EUR	BNP Paribas SA 5.431% 07 September 2017	514,703	0.02%
1,000,000	EUR	BNP Paribas SA 2.500% 23 August 2019	1,041,336	0.03%
280,000	EUR	BNP Paribas SA 2.875% 24 October 2022	292,947	0.01%
21,042	EUR	Bouygues SA	471,341	0.01%
200,000	EUR	Bouygues SA 4.000% 12 February 2018	224,171	0.01%
155,000	EUR	BPCE SA 9.250% 22 April 2015	164,494	0.01%
300,000	EUR	BPCE SA 4.250% 06 February 2023	345,889	0.01%
100,000	EUR	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA 3.750% 22 January 2015	101,951	0.00%
150,000	EUR	Carrefour Banque SA 2.875% 25 September 2015	156,241	0.01%

		訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
100,000	EUR	Carrefour SA 5.125% 10 October 2014	107,424 0.00%
100,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 5.500% 30 January 2015	108,893 0.00%
250,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 4.379% 08 February 2017	276,048 0.01%
450,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 4.481% 12 November 2018	509,639 0.02%
400,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 4.726% 26 May 2021	458,050 0.01%
250,000	EUR	Christian Dior SA 3.750% 23 September 2014	259,993 0.01%
400,000	EUR	Christian Dior SA 4.000% 12 May 2016	426,592 0.01%
66,000	EUR	Cie de St-Gobain 7.250% 16 September 2013	68,982 0.00%
420,000	EUR	Cie de St-Gobain 3.500% 30 September 2015	445,540 0.01%
750,000	GBP	Cie de St-Gobain 5.625% 15 December 2016	1,022,903 0.03%
100,000	EUR	Cie de St-Gobain 4.750% 11 April 2017	112,778 0.00%
100,000	EUR	Cie de St-Gobain 4.500% 30 September 2019	111,851 0.00%
340,000	EUR	Cie de St-Gobain 3.625% 28 March 2022	351,878 0.01%
400,000	GBP	Cie de St-Gobain 5.625% 15 November 2024	558,458 0.02%
		Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 5.000% 24 May 2021	778,036 0.02%
650,000	EUR	Cie Generale de Geophysique- Veritas	450,874 0.01%
19,959	EUR	Cie Generale de Geophysique- Veritas 9.500% 15 May 2016	327,802 0.01%
402,000	USD	CMA CGM SA 8.875% 15 April 2019	80,530 0.00%
100,000	EUR	CNP Assurances FRN 30 September 2041	103,553 0.00%
100,000	GBP	CNP Assurances FRN 30 September 2041	256,492 0.01%
200,000	EUR	Credit Agricole SA 5.971% 01 February 2018	1,193,137 0.04%
1,050,000	GBP	Credit Agricole SA FRN 30 January 2020	806,398 0.02%
700,000	EUR	Credit Agricole SA 3.900% 19 April 2021	557,357 0.02%
550,000	EUR	Credit Agricole SA/London 3.000% 20 July 2015	840,788 0.03%
800,000	EUR	Credit Agricole SA/London 1.875% 18 October 2017	202,926 0.01%
200,000	EUR	Credit Logement SA 5.454% 16 February 2021	335,214 0.01%
300,000	EUR	Dexia Credit Local SA 5.375% 21 July 2014	40,997 0.00%
40,000	EUR	Edenred	536,273 0.02%
23,016	EUR	Electricite de France SA 6.250% 25 January 2021	130,264 0.00%
100,000	EUR	Electricite de France SA 3.875% 18 January 2022	450,332 0.01%
400,000	EUR	Electricite de France SA 4.625% 11 September 2024	176,903 0.01%
150,000	EUR	Electricite de France SA 5.875% 18 July 2031	2,143,532 0.07%
1,500,000	GBP	Electricite de France SA 5.625% 21 February 2033	71,429 0.00%
55,000	EUR	Europcar Groupe SA 11.500% 15 May 2017	425,000 0.01%
400,000	EUR	Europcar Groupe SA 9.375% 15 April 2018	203,063 0.01%
225,000	EUR	Eutelsat SA 4.125% 27 March 2017	333,864 0.01%
300,000	EUR	Eutelsat SA 5.000% 14 January 2019	235,192 0.01%
200,000	EUR	Faurecia 9.375% 15 December 2016	232,441 0.01%
200,000	EUR	Faurecia 8.750% 15 June 2019	422,000 0.01%
400,000	EUR	France Government Bond OAT 2.500% 25 July 2013	1,211 0.00%
1,000	EUR	France Government Bond OAT 1.600% 25 July 2015	6,131,349 0.19%
4,800,000	EUR	France Government Bond OAT 1.100% 25 July 2022	10,490,750 0.32%
8,879,000	EUR	France Government Bond OAT 2.100% 25 July 2023	6,104,200 0.19%
4,623,000	EUR	France Government Bond OAT 3.400% 25 July 2029	3,427,191 0.10%
1,854,000	EUR	France Government Bond OAT 3.150% 25 July 2032	1,108,551 0.03%
613,000	EUR	France Government Bond OAT 1.800% 25 July 2040	1,979,754 0.06%
1,360,000	EUR	France Telecom SA 4.750% 21 February 2017	94,635 0.00%
83,000	GBP	France Telecom SA 8.000% 20 December 2017	740,391 0.02%
482,000	EUR	France Telecom SA 4.125% 23 January 2019	226,553 0.01%
200,000	GBP	France Telecom SA 7.250% 10 November 2020	314,829 0.01%
200,000	EUR	France Telecom SA 3.375% 16 September 2022	324,255 0.01%
300,000	GBP	France Telecom SA 5.250% 05 December 2025	1,256,180 0.04%
899,000	EUR	France Telecom SA 8.125% 28 January 2033	39,523 0.00%
25,000	EUR	GDF Suez 1.500% 20 July 2017	895,853 0.03%
880,000	EUR	GDF Suez 6.375% 18 January 2021	116,344 0.00%
88,000	EUR	GDF Suez 2.625% 20 July 2022	787,584 0.02%
766,000	EUR	GDF Suez 3.500% 18 October 2022	46,476 0.00%
42,000	GBP	GDF Suez 7.000% 30 October 2028	1,699,028 0.05%
1,000,000	EUR	Gecina SA	294,943 0.01%
3,474	EUR	Groupe Auchan SA 3.625% 19 October 2018	562,128 0.02%
500,000	EUR	Ingenico	670,628 0.02%
15,596	EUR	Kleppierre	581,998 0.02%
19,387	EUR	Labco SAS 8.500% 15 January 2018	176,375 0.01%
170,000	EUR	Lafarge SA	1,084,644 0.03%
22,489	GBP	Lafarge SA 10.000% 30 May 2017	589,182 0.02%
400,000	EUR	Lafarge SA 6.625% 29 November 2018	2,380,097 0.07%
2,100,000	EUR	Lafarge SA 5.875% 09 July 2019	908,526 0.03%
830,000	EUR	Lagardere SCA 4.875% 06 October 2014	209,960 0.01%
200,000	EUR	Lagardere SCA 4.125% 31 October 2017	313,517 0.01%
300,000	EUR	Legrand SA 4.375% 21 March 2018	343,496 0.01%
300,000	EUR	L'Oreal SA	2,063,068 0.06%
19,667	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SA	2,040,221 0.06%
14,699	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SA 4.000% 06 April 2018	114,657 0.00%
100,000	EUR	Mercialys SA 4.125% 26 March 2019	220,515 0.01%
200,000	EUR	Pernod-Ricard SA 7.000% 15 January 2015	167,980 0.01%
150,000	EUR	Pernod-Ricard SA 4.875% 18 March 2016	500,572 0.02%
450,000	EUR	Pernod-Ricard SA 5.000% 15 March 2017	573,331 0.02%
500,000	EUR	Peugeot SA 6.875% 30 March 2016	213,556 0.01%
200,000	EUR	Peugeot SA 5.000% 28 October 2016	91,632 0.00%
90,000	EUR	PPR	628,614 0.02%
4,463	EUR	PPR 8.625% 03 April 2014	121,661 0.00%
111,000	EUR	PPR 3.750% 08 April 2015	897,893 0.03%
845,000	EUR	PPR 3.125% 23 April 2019	826,361 0.03%
762,000	EUR	RCI Banque SA 4.000% 11 July 2013	868,569 0.03%
859,000	EUR	RCI Banque SA 3.250% 17 January 2014	339,816 0.01%
333,000	EUR	RCI Banque SA 2.125% 24 November 2014	446,240 0.01%
440,000	EUR	RCI Banque SA 5.625% 13 March 2015	194,561 0.01%
179,000	EUR	Renault SA	1,814,144 0.05%
44,590	EUR	Renault SA 4.625% 25 May 2016	210,204 0.01%
200,000	EUR	Renault SA 5.625% 22 March 2017	545,193 0.02%
500,000	EUR	Renault SA 4.625% 18 September 2017	261,135 0.01%
250,000	EUR	RTE Reseau de transport d'electricite 5.125% 12 September 2018	298,597 0.01%

		RTE Reseau de transport d'electricite 3.875% 28 June 2022	224,766	0.01%
200,000	EUR	Safran SA	481,135	0.01%
14,761	EUR	Sanofi	4,110,993	0.12%
57,585	EUR	Schneider Electric SA	1,479,478	0.04%
26,983	EUR	SCOR SE	670,836	0.02%
32,868	EUR	Societe Des Autoroutes Paris-Rhin-Rhone 7.500% 12 January 2015	505,882	0.02%
450,000	EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA 4.625% 25 May 2016	321,882	0.01%
300,000	EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA 3.500% 28 November 2017	206,942	0.01%
200,000	EUR	Societe Generale SA	2,630,717	0.08%
92,827	EUR	Societe Generale SA FRN 22 May 2013	96,623	0.00%
100,000	EUR	Societe Generale SA 2.500% 15 January 2014	122,925	0.00%
160,000	USD	Societe Generale SA 3.750% 21 August 2014	52,389	0.00%
50,000	EUR	Societe Generale SA 3.000% 31 March 2015	417,497	0.01%
400,000	EUR	Societe Generale SA 2.375% 13 July 2015	206,625	0.01%
200,000	EUR	Societe Generale SA 4.000% 20 April 2016	436,351	0.01%
400,000	EUR	Societe Generale SA 5.400% 30 January 2018	673,829	0.02%
525,000	GBP	Societe Generale SA 5.000% 20 December 2018	409,473	0.01%
300,000	GBP	Societe Generale SA FRN 04 September 2019	391,589	0.01%
350,000	EUR	Societe Generale SA 4.750% 02 March 2021	708,993	0.02%
600,000	EUR	SPCM SA 5.500% 15 June 2020	425,000	0.01%
400,000	EUR	Suez Environnement Co 4.078% 17 May 2021	229,909	0.01%
200,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE	2,272,737	0.07%
12,491	EUR	Unibaii-Rodamco SE 3.375% 11 March 2015	297,252	0.01%
282,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 3.500% 06 April 2016	215,484	0.01%
200,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 4.625% 23 September 2016	505,170	0.02%
450,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 3.875% 13 December 2017	145,004	0.00%
130,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 2.250% 01 August 2018	442,026	0.01%
428,000	EUR	Valeo SA 5.750% 19 January 2017	339,399	0.01%
300,000	EUR	Valeo SA 4.875% 11 May 2018	111,501	0.00%
100,000	EUR	Veolia Environnement SA 5.250% 24 April 2014	132,412	0.00%
125,000	EUR	Veolia Environnement SA 5.375% 28 May 2018	122,936	0.00%
104,000	EUR	Veolia Environnement SA 5.125% 24 May 2022	63,393	0.00%
53,000	EUR	Veolia Environnement SA 4.625% 30 March 2027	679,351	0.02%
600,000	EUR	Veolia Environnement SA 6.125% 29 October 2037	431,170	0.01%
300,000	GBP	Vinci SA 3.375% 30 March 2020	323,587	0.01%
300,000	EUR	Vivendi SA 7.750% 23 January 2014	214,340	0.01%
200,000	EUR	Vivendi SA 4.250% 01 December 2016	109,855	0.00%
100,000	EUR	Vivendi SA 4.125% 18 July 2017	109,847	0.00%
100,000	EUR	Vivendi SA 4.875% 02 December 2019	116,357	0.00%
100,000	EUR	Vivendi SA 4.750% 13 July 2021	576,201	0.02%
500,000	EUR	Wendel SA 5.875% 17 September 2019	107,780	0.00%
100,000	EUR	フランス合計	107,822,140	3.25%
		ドイツ		
300,000	EUR	ALBA Group Plc & Co KG 8.000% 15 May 2018	325,515	0.01%
400,000	EUR	Allianz Se Var 5.625% 17 October 2042	453,890	0.01%
24,723	EUR	BASF SE	1,759,042	0.05%
1,410,000	EUR	BASF SE 2.000% 05 December 2022	1,410,232	0.04%
9,107	EUR	Bayerische Motoren Werke AG	664,174	0.02%
2,000,000	EUR	Bundesobligation 2.750% 08 April 2016	2,174,742	0.07%
1,350,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 4.000% 04 January 2018	1,593,129	0.05%
150,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 3.500% 04 July 2019	176,981	0.01%
3,800,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 1.500% 04 September 2022	3,852,871	0.12%
300,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 4.750% 04 July 2028	416,323	0.01%
5,188,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesobligation Inflation Linked Bond 2.250% 15 April 2013	5,866,201	0.18%
830,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesobligation Inflation Linked Bond 0.750% 15 April 2018	954,878	0.03%
56,000	EUR	Commerzbank AG 5.000% 06 February 2014	58,648	0.00%
530,000	EUR	Commerzbank AG 3.875% 22 March 2017	585,098	0.02%
14,583	EUR	Continental AG	1,277,324	0.04%
378,000	EUR	Daimler AG 4.625% 02 September 2014	402,769	0.01%
354,000	EUR	Daimler AG 2.000% 05 May 2017	367,634	0.01%
970,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 2.000% 20 February 2023	965,659	0.03%
45,332	EUR	Deutsche Bank AG	1,493,689	0.05%
4,541,000	EUR	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1.500% 15 April 2016	5,686,550	0.17%
5,162,000	EUR	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1.750% 15 April 2020	6,659,435	0.20%
4,135,000	EUR	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15 April 2023	4,466,537	0.14%
49,501	EUR	Deutsche Post AG	821,717	0.02%
500,000	EUR	Deutsche Telekom International 2.000% 30 October 2019	511,115	0.02%
113,239	EUR	Deutsche Wohnen AG	1,585,346	0.05%
600,000	EUR	German Treasury Bill 0.000% 26 June 2013	600,078	0.02%
400,000	EUR	Heckler & Koch GmbH 9.500% 15 May 2018	348,000	0.01%
250,000	EUR	Heidelberger Druckmaschinen AG 9.250% 15 April 2018	221,250	0.01%
521,000	EUR	Henkel AG & Co KGaA FRN 25 November 2104	561,914	0.02%
7,469	EUR	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	464,572	0.01%
400,000	EUR	IKB Deutsche Industriebank AG 4.500% 09 July 2013	396,500	0.01%
136,881	EUR	Infineon Technologies AG	838,944	0.03%
36,519	EUR	Kabel Deutschland Holding AG	2,065,880	0.06%
300,000	EUR	Kabel Deutschland Holding AG 6.500% 31 July 2017	328,401	0.01%
200,000	EUR	Kabel Deutschland Vertrieb und Service GmbH 6.500% 29 June 2018	216,814	0.01%
741,000	GBP	KfW 5.750% 07 June 2032	1,281,677	0.04%
840,000	GBP	KfW 5.000% 09 June 2036	1,343,474	0.04%
715,000	EUR	KM Germany Holdings GmbH 8.750% 15 December 2020	750,414	0.02%
6,190	EUR	Linde AG	817,080	0.02%
340,000	EUR	Linde AG 1.750% 17 September 2020	342,572	0.01%
200,000	EUR	Mondi Consumer Packaging International AG 9.750% 15 July 2017	233,000	0.01%
400,000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs AG FRN 26 May 2042	485,464	0.02%
369,000	EUR	RWE AG FRN 28 September 2015	376,320	0.01%

				訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
30,317	EUR	SAP AG	1,839,938	0.06%	
29,709	EUR	Symrise AG	805,708	0.02%	
300,000	EUR	Techem Energy Metering Service GmbH & Co KG 7.875% 01 October 2020	331,896	0.01%	
215,000	EUR	Techem GmbH 6.125% 01 October 2019	231,663	0.01%	
466,000	EUR	ThyssenKrupp AG 8.000% 18 June 2014	509,110	0.02%	
831,000	EUR	UniCredit Bank AG 6.000% 05 February 2014	867,225	0.03%	
220,000	EUR	UniCredit Bank AG 3.250% 15 July 2014	226,652	0.01%	
418,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 8.125% 01 December 2017	454,575	0.01%	
590,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 7.500% 15 March 2019	651,437	0.02%	
200,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.500% 15 September 2022	206,000	0.01%	
460,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.750% 15 January 2023	481,925	0.01%	
636,000	EUR	Unitymedia KabelBW GmbH 9.625% 01 December 2019	719,609	0.02%	
945,000	EUR	Unitymedia KabelBW GmbH 9.500% 15 March 2021	1,099,743	0.03%	
13,000	EUR	Volkswagen Financial Services AG 6.875% 15 January 2014	13,839	0.00%	
530,000	EUR	Volkswagen International Finance NV 2.125% 19 January 2015	544,438	0.02%	
200,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 2.250% 10 November 2014	205,679	0.01%	
350,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 2.750% 13 July 2015	367,201	0.01%	
300,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 1.500% 15 September 2015	305,356	0.01%	
300,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 3.375% 03 June 2016	323,819	0.01%	
200,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 3.250% 10 May 2018	218,484	0.01%	
16,530	EUR	Wirecard AG	307,458	0.01%	
		ドイツ合計	66,913,608	2.06%	
72,107	GBP	ガンジー島 Resolution Ltd	218,700	0.01%	
		ガンジー島合計	218,700	0.01%	
583,000	HKD	香港 BOC Hong Kong Holdings Ltd	1,371,931	0.04%	
1,460,000	HKD	China Overseas Land & Investment Ltd	3,293,150	0.10%	
1,099,000	HKD	Henderson Land Development Co Ltd	5,869,913	0.18%	
512,000	HKD	Sun Hung Kai Properties Ltd	5,809,286	0.18%	
1,342,800	HKD	Swire Properties Ltd	3,389,367	0.10%	
		香港合計	19,733,647	0.60%	
33,551	USD	インド Tata Motors Ltd	719,571	0.02%	
		インド合計	719,571	0.02%	
3,485,232	IDR	インドネシア Lippo Karawaci Tbk PT	273,674	0.01%	
		インドネシア合計	273,674	0.01%	
47,000	EUR	アイルランド Allied Irish Banks Plc 5.625% 12 November 2014	47,388	0.00%	
445,000	EUR	Ardagh Glass Finance Plc 9.250% 01 July 2016	484,494	0.02%	
83,000	EUR	Ardagh Glass Finance Plc 7.125% 15 June 2017	86,113	0.00%	
400,000	EUR	Ardagh Glass Finance Plc 8.750% 01 February 2020	422,500	0.01%	
180,000	EUR	Ardagh Packaging Finance Plc 7.375% 15 October 2017	198,900	0.01%	
150,000	EUR	Ardagh Packaging Finance Plc 9.250% 15 October 2020	164,813	0.01%	
395,000	EUR	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh MP Holdings USA Inc 7.375% 15 October 2017	436,475	0.01%	
450,000	EUR	Bank of Ireland Mortgage Bank 3.125% 20 November 2015	457,147	0.01%	
260,000	EUR	Bord Gais Eireann 3.625% 04 December 2017	270,901	0.01%	
157,088	EUR	C&C Group Plc	714,750	0.02%	
100,000	EUR	Caterpillar International Finance Ltd 1.375% 18 May 2015	101,658	0.00%	
270,000	EUR	Cloverie Plc for Swiss Reinsurance Co Ltd FRN 01 September 2042	328,785	0.01%	
350,000	EUR	Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd FRN 24 July 2039	429,741	0.01%	
417,000	EUR	CRH Finance Ltd 7.375% 28 May 2014	454,607	0.01%	
91,265	EUR	Dragon Oil Plc	621,150	0.02%	
510,000	EUR	ESB Finance Ltd 6.250% 11 September 2017	585,723	0.02%	
290,000	EUR	ESB Finance Ltd 4.375% 21 November 2019	306,412	0.01%	
100,000	EUR	FGA Capital Ireland Plc 4.000% 28 March 2013	100,725	0.00%	
350,000	EUR	FGA Capital Ireland Plc 5.250% 28 February 2014	359,722	0.01%	
180,000	EUR	FGA Capital Ireland Plc 4.375% 18 September 2014	185,624	0.01%	
108,000	EUR	GE Capital European Funding 4.750% 30 July 2014	114,833	0.00%	
474,000	EUR	GE Capital European Funding 2.000% 27 February 2015	486,147	0.02%	
131,000	EUR	GE Capital European Funding 5.250% 18 May 2015	144,458	0.00%	
97,000	EUR	GE Capital European Funding 2.875% 17 September 2015	102,047	0.00%	
1,678,000	EUR	GE Capital European Funding 4.250% 01 March 2017	1,881,275	0.06%	
315,000	EUR	GE Capital European Funding 3.625% 15 June 2017	343,593	0.01%	
200,000	EUR	GE Capital European Funding 6.000% 15 January 2019	249,201	0.01%	
189,000	EUR	GE Capital European Funding 2.875% 18 June 2019	202,213	0.01%	
297,000	EUR	GE Capital European Funding 5.375% 23 January 2020	363,943	0.01%	
100,000	EUR	GE Capital European Funding 4.625% 22 February 2027	120,622	0.00%	
295,000	EUR	Governor & Co of the Bank of Ireland 4.625% 08 April 2013	295,040	0.01%	
200,000	EUR	Nara Cable Funding Ltd 8.875% 01 December 2018	202,584	0.01%	
500,000	EUR	Ono Finance II Plc 11.125% 15 July 2019	482,500	0.01%	
19,905	EUR	Paddy Power Plc	1,244,063	0.04%	
800,000	EUR	Rottapharm Ltd 6.125% 15 November 2019	832,000	0.03%	
338,404	EUR	Ryanair Holdings Plc	1,599,635	0.05%	
114,000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions 7.250% 15 November 2017	123,120	0.00%	
225,000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions 5.125% 15 September 2018	237,375	0.01%	
647,000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions 7.750% 15 November 2019	719,788	0.02%	
200,000	EUR	Willow No.2 Ireland Plc for Zurich Insurance Co Ltd 3.375% 27 June 2022	216,729	0.01%	

		アイルランド合計	16,718,794	0.51%
		イタリア		
412,000	EUR	Assicurazioni Generali SpA 5.125% 16 September 2024	441,204	0.01%
229,000	EUR	Atlantia SpA 5.625% 06 May 2016	254,866	0.01%
111,000	EUR	Atlantia SpA 3.375% 18 September 2017	115,242	0.00%
290,000	EUR	Atlantia SpA 4.375% 16 March 2020	310,284	0.01%
609,000	GBP	Atlantia SpA 6.250% 09 June 2022	814,362	0.03%
141,000	EUR	Atlantia SpA 4.375% 16 September 2025	146,517	0.00%
1,015,000	EUR	Banco Popolare SC 4.000% 06 April 2013	1,018,456	0.03%
156,000	EUR	Edison SpA 4.250% 22 July 2014	162,814	0.01%
259,000	EUR	Edison SpA 3.250% 17 March 2015	269,026	0.01%
420,000	EUR	Edison SpA 3.875% 10 November 2017	456,000	0.01%
97,000	EUR	Enel SpA 5.250% 14 January 2015	103,158	0.00%
44,000	EUR	Enel SpA 3.500% 26 February 2016	45,045	0.00%
350,000	EUR	Enel SpA 5.250% 20 June 2017	386,411	0.01%
49,000	EUR	Enel SpA 4.750% 12 June 2018	53,060	0.00%
95,000	GBP	Enel SpA 6.250% 20 June 2019	127,084	0.00%
81,201	EUR	Eni SpA	1,489,226	0.05%
150,000	EUR	Eni SpA 4.125% 16 September 2019	169,572	0.01%
200,000	EUR	Guala Closures SpA 5.568% 15 November 2019	203,500	0.01%
150,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 3.375% 19 January 2015	153,537	0.00%
500,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 3.875% 01 April 2015	516,059	0.02%
1,200,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.875% 10 July 2015	1,269,239	0.04%
200,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.375% 16 August 2016	217,785	0.01%
300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.125% 19 September 2016	313,695	0.01%
150,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 3.750% 23 November 2016	155,139	0.00%
300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 5.000% 28 February 2017	323,968	0.01%
200,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.750% 15 June 2017	215,306	0.01%
141,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.000% 09 November 2017	145,964	0.00%
50,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 08 May 2018	52,318	0.00%
50,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA FRN 28 May 2018	46,174	0.00%
300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.000% 08 November 2018	307,628	0.01%
50,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA FRN 02 March 2020	42,172	0.00%
149,000	GBP	Intesa Sanpaolo SpA FRN 18 March 2024	144,970	0.00%
300,000	EUR	Lottomatica Group SpA 3.500% 05 March 2020	308,889	0.01%
57,878	EUR	Prysmian SpA	868,749	0.03%
28,085	EUR	Saipem SpA	822,891	0.02%
251,790	EUR	Snam SpA	884,790	0.03%
510,000	EUR	Snam SpA 3.875% 19 March 2018	546,872	0.02%
180,000	EUR	Snam SpA 3.500% 13 February 2020	183,787	0.01%
320,000	EUR	Telecom Italia SpA 4.625% 15 June 2015	341,978	0.01%
200,000	EUR	Telecom Italia SpA 5.125% 25 January 2016	217,644	0.01%
320,000	EUR	Telecom Italia SpA 4.500% 20 September 2017	342,133	0.01%
450,000	GBP	Telecom Italia SpA 7.375% 15 December 2017	625,982	0.02%
900,000	EUR	Telecom Italia SpA 4.750% 25 May 2018	969,723	0.03%
600,000	GBP	Telecom Italia SpA 6.375% 24 June 2019	793,709	0.02%
100,000	EUR	Telecom Italia SpA 5.250% 10 February 2022	107,193	0.00%
480,000	EUR	UniCredit SpA 4.875% 07 March 2017	515,394	0.02%
370,000	EUR	UniCredit SpA 3.375% 11 January 2018	369,769	0.01%
175,000	EUR	UniCredit SpA 4.250% 31 July 2018	192,088	0.01%
		イタリア合計	18,561,372	0.57%
		日本		
23,600	JPY	Japan Tobacco Inc	504,291	0.02%
278,000	JPY	Mitsubishi Estate Co Ltd	4,988,453	0.15%
303,000	JPY	Mitsui Fudosan Co Ltd	5,545,849	0.17%
8,640	JPY	ORIX Corp	733,190	0.02%
88,000	JPY	Sekisui House Ltd	725,960	0.02%
41,200	JPY	Seven & I Holdings Co Ltd	879,290	0.03%
81,500	JPY	Yokogawa Electric Corp	671,624	0.02%
		日本合計	14,048,657	0.43%
		ジャージー島		
915,000	EUR	ASIF III Jersey Ltd 4.750% 11 September 2013	947,444	0.03%
100,000	GBP	Aston Martin Capital Ltd 9.250% 15 July 2018	121,932	0.00%
160,000	GBP	CPUK Finance Ltd 11.625% 28 February 2018	218,130	0.01%
100,000	GBP	Gatwick Funding Ltd 6.125% 02 March 2026	150,648	0.00%
312,430	GBP	Glencore International Plc	1,345,013	0.04%
776,000	EUR	Heathrow Funding Ltd FRN 30 September 2014	827,207	0.03%
250,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 3.000% 08 June 2015	317,050	0.01%
102,000	EUR	Heathrow Funding Ltd 4.125% 12 October 2016	112,861	0.00%
136,000	EUR	Heathrow Funding Ltd 4.375% 25 January 2017	151,902	0.00%
117,000	EUR	Heathrow Funding Ltd FRN 15 February 2018	133,105	0.00%
1,687,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 6.250% 10 September 2018	2,348,792	0.07%
350,000	GBP	Heathrow Funding Ltd FRN 15 February 2023	495,085	0.02%
1,061,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 6.750% 03 December 2026	1,709,122	0.05%
202,000	GBP	Heathrow Funding Ltd FRN 10 December 2031	313,057	0.01%
420,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 3.334% 09 December 2039	738,393	0.02%
1,736,000	GBP	HSBC Bank Capital Funding Sterling LP FRN 05 November 2031	2,081,426	0.06%
73,000	GBP	HSBC Capital Funding LP/Jersey FRN 30 June 2015	99,189	0.00%
250,720	GBP	Informa Plc	1,379,529	0.04%
125,353	GBP	Petrofac Ltd	2,493,153	0.08%
719,000	GBP	QBE Capital Funding IV Ltd FRN 24 May 2041	918,737	0.03%
26,781	GBP	Shire Plc	619,290	0.02%
505,000	GBP	UBM Plc 6.500% 23 November 2016	706,646	0.02%
62,843	GBP	Wolseley Plc	2,233,318	0.07%
174,067	GBP	WPP Plc	1,894,196	0.06%
		ジャージー島合計	22,355,225	0.67%
		ルクセンブルグ		
100,000	EUR	Albea Beauty Holdings SA 8.750% 01 November 2019	106,250	0.00%
172,000	EUR	ArcelorMittal 8.250% 03 June 2013	176,560	0.01%
100,000	EUR	ArcelorMittal 4.500% 29 March 2018	106,890	0.00%
1,970,000	USD	ArcelorMittal 6.000% 01 March 2021	1,498,583	0.05%

			訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
1,452,000	USD	ArcelorMittal 7.250% 01 March 2041	1,029,705	0.03%
547,285	EUR	ARD Finance SA 11.125% 01 June 2018	571,913	0.02%
		Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA		
100,000	EUR	8.000% 15 December 2016	102,500	0.00%
		Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA		
108,000	EUR	9.500% 15 June 2017	112,860	0.00%
750,000	GBP	Cabot Financial Luxembourg SA 10.375% 01 October 2019	1,015,592	0.03%
100,000	EUR	Capsugel FinanceCo SCA 9.875% 01 August 2019	112,875	0.00%
375,000	EUR	Cirsa Funding Luxembourg SA 8.750% 15 May 2018	371,719	0.01%
445,000	EUR	Codere Finance Luxembourg SA 8.250% 15 June 2015	369,600	0.01%
241,000	EUR	ConvaTec Healthcare E SA 7.375% 15 December 2017	261,702	0.01%
200,000	EUR	Fiat Finance & Trade SA 6.375% 01 April 2016	206,000	0.01%
100,000	EUR	Fiat Finance & Trade SA 7.750% 17 October 2016	106,620	0.00%
210,000	EUR	Fiat Industrial Finance Europe SA 5.250% 11 March 2015	223,020	0.01%
1,795,000	EUR	Fiat Industrial Finance Europe SA 6.250% 09 March 2018	2,013,990	0.06%
62,000	EUR	Finmeccanica Finance SA/Old 8.125% 03 December 2013	65,894	0.00%
200,000	EUR	FMC Finance VIII SA 6.500% 15 September 2018	235,000	0.01%
150,000	EUR	Gategroup Finance Luxembourg SA 6.750% 01 March 2019	160,376	0.01%
404,000	EUR	Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 8.125% 04 February 2015	457,917	0.01%
390,000	EUR	Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 3.755% 15 March 2017	414,814	0.01%
300,000	EUR	GCL Holdings SCA 9.375% 15 April 2018	323,250	0.01%
725,000	EUR	Geo Travel Finance SCA 10.375% 01 May 2019	746,750	0.02%
600,000	EUR	Hannover Finance Luxembourg SA FRN 26 February 2024	628,095	0.02%
		HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 7.500%		
291,000	EUR	31 October 2014	320,941	0.01%
		HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 9.500%		
200,000	EUR	15 December 2018	257,714	0.01%
		Holcim US Finance Sari & Cie SCS 6.000% 30 December		
175,000	USD	2019	150,742	0.00%
840,000	EUR	INEOS Group Holdings SA 7.875% 15 February 2016	837,900	0.03%
589,000	USD	Intelsat Jackson Holdings SA 7.250% 15 October 2020	486,416	0.02%
3,459,000	USD	Intelsat Luxembourg SA 11.250% 04 February 2017	2,778,027	0.08%
100,000	EUR	KION Finance SA 7.875% 15 April 2018	108,500	0.00%
575,000	EUR	Matterhorn Mobile Holdings SA 8.250% 15 February 2020	629,625	0.02%
193,000	EUR	Michelin Luxembourg SCS 8.625% 24 April 2014	213,291	0.01%
180,000	EUR	Michelin Luxembourg SCS 2.750% 20 June 2019	188,647	0.01%
200,000	EUR	Numericable Finance & Co SCA 8.750% 15 February 2019	214,000	0.01%
200,000	EUR	Spie BondCo 3 SCA 11.000% 15 August 2019	219,000	0.01%
23,826	NOK	Subsea 7 SA	428,253	0.01%
		Sunrise Communications Holdings SA 8.500% 31 December		
586,000	EUR	2018	645,778	0.02%
		Sunrise Communications International SA 7.000% 31		
200,000	EUR	December 2017	218,204	0.01%
100,000	EUR	Talanx Finanz Luxembourg SA FRN 15 June 2042	122,346	0.00%
80,000	USD	Telecom Italia Capital SA 5.250% 15 November 2013	62,328	0.00%
21,000	EUR	Telecom Italia Finance SA 7.750% 24 January 2033	24,335	0.00%
730,000	EUR	Wind Acquisition Finance SA 7.375% 15 February 2018	744,600	0.02%
100,000	EUR	Xefin Lux SCA 8.000% 01 June 2018	107,500	0.00%
620,000	EUR	Zinc Capital SA 8.875% 15 May 2018	663,399	0.02%
		ルクセンブルグ合計	20,840,021	0.63%
		マレーシア		
1,018,900	MYR	UEM Land Holdings Bhd	529,516	0.02%
		マレーシア合計	529,516	0.02%
		マーシャル諸島		
		Navios Maritime Holdings Inc / Navios Maritime Finance		
276,000	USD	US Inc 8.875% 01 November 2017	209,393	0.01%
		マーシャル諸島合計	209,393	0.01%
		メキシコ		
232,000	EUR	America Movil SAB de CV 3.750% 28 June 2017	257,284	0.01%
150,000	EUR	America Movil SAB de CV 4.125% 25 October 2019	172,185	0.01%
440,000	EUR	America Movil SAB de CV 3.000% 12 July 2021	462,667	0.01%
170,000	EUR	America Movil SAB de CV 4.750% 28 June 2022	202,549	0.01%
750,000	GBP	America Movil SAB de CV 5.750% 28 June 2030	1,134,206	0.03%
		Kansas City Southern de Mexico SA de CV 8.000% 01		
132,000	USD	February 2018	111,133	0.00%
		Kansas City Southern de Mexico SA de CV 6.125% 15 June		
130,000	USD	2021	111,170	0.00%
433,500,000	MXN	Mexican Bonos 6.500% 10 June 2021	27,376,898	0.83%
334,736,300	MXN	Mexican Bonos 10.000% 05 December 2024	27,349,707	0.83%
369,950,500	MXN	Mexican Bonos 7.500% 03 June 2027	25,091,688	0.76%
339,033,500	MXN	Mexican Bonos 8.500% 31 May 2029	25,003,512	0.76%
		Mexico Government International Bond 3.625% 15 March		
62,000	USD	2022	51,378	0.00%
347,000	EUR	Petroleos Mexicanos 5.500% 09 January 2017	395,198	0.01%
849,000	GBP	Petroleos Mexicanos 8.250% 02 June 2022	1,345,018	0.04%
		メキシコ合計	109,064,593	3.30%
		オランダ		
460,000	EUR	ABB Finance BV 2.625% 26 March 2019	488,205	0.02%
925,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 4.250% 11 April 2016	1,020,946	0.03%
200,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 3.625% 06 October 2017	221,116	0.01%
613,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 6.375% 27 April 2021	703,107	0.02%
360,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 7.125% 06 July 2022	424,859	0.01%
112,000	EUR	Achmea BV 7.375% 16 June 2014	122,377	0.00%
500,000	EUR	Aegon NV 4.125% 08 December 2014	531,227	0.02%
180,000	EUR	Aegon NV 3.000% 18 July 2017	192,688	0.01%
243,000	EUR	Allianz Finance II BV FRN 17 February 2017	244,246	0.01%
250,000	EUR	Allianz Finance II BV 4.750% 22 July 2019	299,450	0.01%
400,000	EUR	Allianz Finance II BV FRN 08 July 2041	459,791	0.01%
30,877	EUR	ASML Holding NV	1,482,096	0.04%
734,000	EUR	BMW Finance NV 4.000% 17 September 2014	776,189	0.02%
109,000	EUR	BMW Finance NV 3.875% 18 January 2017	121,256	0.00%
200,000	EUR	BMW Finance NV 3.625% 29 January 2018	223,168	0.01%

			訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
950,000	GBP	BMW Finance NV 3.375% 14 December 2018	1,239,009	0.04%
143,000	EUR	British American Tobacco Holdings The Netherlands BV 4.000% 07 July 2020	163,970	0.01%
400,000	EUR	British American Tobacco Holdings The Netherlands BV 2.375% 19 January 2023	400,586	0.01%
250,000	EUR	Carlson Wagonlit BV 7.500% 15 June 2019	268,125	0.01%
100,000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV 7.875% 15 January 2014	106,139	0.00%
214,000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV 4.250% 16 November 2016	230,453	0.01%
188,000	EUR	Conti-Gummi Finance BV 8.500% 15 July 2015	203,980	0.01%
200,000	EUR	Conti-Gummi Finance BV 6.500% 15 January 2016	215,000	0.01%
1,353,000	EUR	Conti-Gummi Finance BV 7.500% 15 September 2017	1,456,546	0.04%
600,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 4.375% 05 May 2016	667,303	0.02%
519,000	USD	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands FRN 26 July 2016	426,310	0.01%
875,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 4.750% 15 January 2018	1,020,517	0.03%
272,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 3.500% 17 October 2018	302,176	0.01%
700,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 4.125% 14 January 2020	805,135	0.02%
100,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 6.875% 19 March 2020	112,142	0.00%
280,000	GBP	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 2.250% 22 November 2022	459,288	0.01%
700,000	EUR	CRH Finance BV 5.000% 25 January 2019	810,090	0.02%
260,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 4.750% 14 March 2018	308,451	0.01%
250,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 3.000% 08 March 2024	270,115	0.01%
200,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 3.750% 09 July 2025	232,188	0.01%
777,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 6.000% 20 January 2017	922,563	0.03%
22,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 6.625% 29 March 2018	27,747	0.00%
500,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 4.250% 16 March 2020	579,518	0.02%
79,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 5.375% 27 July 2021	96,935	0.00%
582,000	GBP	Deutsche Telekom International Finance BV 6.500% 08 April 2022	895,843	0.03%
109,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 4.250% 13 July 2022	127,718	0.00%
310,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 2.750% 24 October 2024	313,706	0.01%
493,000	EUR	E.ON International Finance BV 5.500% 19 January 2016	560,920	0.02%
577,000	EUR	E.ON International Finance BV 6.375% 29 May 2017	706,921	0.02%
1,200,000	GBP	E.ON International Finance BV 6.000% 30 October 2019	1,801,370	0.06%
550,000	GBP	E.ON International Finance BV 6.375% 07 June 2032	884,419	0.03%
1,085,000	EUR	EDP Finance BV 5.750% 21 September 2017	1,166,103	0.04%
200,000	EUR	En Germany Holdings BV 10.750% 15 November 2015	190,000	0.01%
320,000	EUR	Enel Finance International NV 4.125% 12 July 2017	338,751	0.01%
610,000	EUR	Enel Finance International NV 3.625% 17 April 2018	629,371	0.02%
1,100,000	EUR	Enel Finance International NV 5.750% 24 October 2018	1,250,062	0.04%
160,000	EUR	Enel Finance International NV 4.875% 11 March 2020	172,802	0.01%
158,000	EUR	Enel Finance International NV 5.000% 14 September 2022	169,097	0.01%
1,019,000	GBP	Enel Finance International NV 5.625% 14 August 2024	1,268,299	0.04%
1,207,000	GBP	Enel Finance International NV 5.750% 14 September 2040	1,361,051	0.04%
260,000	EUR	Enexis Holding NV 1.875% 13 November 2020	260,805	0.01%
31,282	EUR	European Aeronautic Defence and Space Co NV	922,819	0.03%
24,390	EUR	Gemalto NV	1,658,520	0.05%
1,365,000	EUR	HeidelbergCement Finance BV 8.000% 31 January 2017	1,596,983	0.05%
100,000	EUR	HIT Finance BV 5.750% 09 March 2018	111,556	0.00%
300,000	EUR	Iberdrola International BV 4.875% 18 February 2013	302,070	0.01%
300,000	EUR	Iberdrola International BV 4.250% 11 October 2018	325,563	0.01%
596,000	EUR	ING Bank NV 3.375% 03 March 2015	627,420	0.02%
300,000	EUR	ING Bank NV 2.125% 10 July 2015	308,894	0.01%
150,000	EUR	ING Bank NV 3.875% 24 May 2016	163,710	0.01%
192,000	GBP	ING Bank NV 3.875% 23 December 2016	250,884	0.01%
718,000	EUR	ING Bank NV FRN 15 March 2019	712,175	0.02%
280,000	EUR	ING Bank NV 4.875% 18 January 2021	332,833	0.01%
1,300,000	GBP	ING Bank NV 5.375% 15 April 2021	1,875,719	0.06%
430,000	EUR	ING Bank NV 4.500% 21 February 2022	501,062	0.02%
307,948	EUR	ING Groep NV	2,174,421	0.07%
71,000	EUR	ING Groep NV 4.125% 23 March 2015	75,713	0.00%
203,000	GBP	InterGen NV 9.500% 30 June 2017	222,646	0.01%
132,000	EUR	InterGen NV 8.500% 30 June 2017	118,140	0.00%
150,000	EUR	International Endesa BV 5.375% 21 February 2013	150,674	0.00%
454,000	EUR	InterXion Holding NV 9.500% 12 February 2017	507,913	0.02%
650,000	EUR	KBC Internationale Financieringsmaatschappij NV 3.875% 31 March 2015	687,089	0.02%
400,000	EUR	KBC Internationale Financieringsmaatschappij NV 4.375% 26 October 2015	432,591	0.01%
261,000	EUR	KBC Internationale Financieringsmaatschappij NV 3.000% 29 August 2016	274,892	0.01%
12,066	EUR	Koninklijke Boskalis Westminster NV	410,244	0.01%
61,000	EUR	Koninklijke KPN NV 6.500% 15 January 2016	69,744	0.00%
487,000	EUR	Koninklijke KPN NV 7.500% 04 February 2019	620,628	0.02%
220,000	EUR	Koninklijke KPN NV 3.250% 01 February 2021	220,849	0.01%
120,000	EUR	Koninklijke KPN NV 4.500% 04 October 2021	130,633	0.00%
320,000	GBP	Koninklijke KPN NV 5.750% 17 September 2029	437,819	0.01%
350,000	EUR	LeasePlan Corp NV 4.125% 13 January 2015	368,941	0.01%
54,000	EUR	LeasePlan Corp NV 3.875% 16 September 2015	57,421	0.00%
140,000	EUR	LeasePlan Corp NV 2.500% 19 September 2016	144,378	0.00%
163,000	EUR	LeasePlan Finance NV 3.750% 18 March 2013	163,929	0.01%
58,000	EUR	Linde Finance BV 1.750% 11 June 2019	59,493	0.00%
137,000	EUR	Linde Finance BV 3.875% 01 June 2021	158,979	0.01%
1,270,000	EUR	Linde Finance BV FRN 29 July 2049	1,313,955	0.04%

訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)			
274,000	EUR	Linde Finance BV FRN 14 July 2066	321,615 0.01%
31,951	USD	LyondellBasell Industries NV	1,342,221 0.04%
575,000	USD	LyondellBasell Industries NV 5.000% 15 April 2019	483,013 0.01%
1,495,000	USD	LyondellBasell Industries NV 5.750% 15 April 2024	1,340,688 0.04%
88,000	EUR	Magyar Telecom BV 9.500% 15 December 2016	48,400 0.00%
398,000	EUR	O1 European Group BV 6.750% 15 September 2020	455,710 0.01%
160,000	EUR	PACCAR Financial Europe BV 1.375% 08 June 2015	162,479 0.01%
100,000	EUR	Polish Television Holding BV 11.250% 15 May 2017	109,500 0.00%
200,000	EUR	Portugal Telecom International Finance BV 5.625% 08 February 2016	211,331 0.01%
105,000	GBP	Roche Finance Europe BV 5.375% 29 August 2023	162,889 0.01%
154,000	EUR	RWE Finance BV 4.625% 23 July 2014	163,514 0.01%
367,000	EUR	RWE Finance BV 5.000% 10 February 2015	399,636 0.01%
62,000	EUR	RWE Finance BV 5.125% 23 July 2018	74,269 0.00%
800,000	EUR	RWE Finance BV 6.625% 31 January 2019	1,033,586 0.03%
200,000	EUR	RWE Finance BV 6.500% 10 August 2021	270,242 0.01%
1,500,000	GBP	RWE Finance BV 5.625% 06 December 2023	2,224,559 0.07%
1,100,000	GBP	RWE Finance BV 6.125% 06 July 2039	1,679,214 0.05%
200,000	EUR	Schaeffler Finance BV 7.750% 15 February 2017	224,000 0.01%
230,000	EUR	Schaeffler Finance BV 6.750% 01 July 2017	250,413 0.01%
325,000	EUR	Schaeffler Finance BV 8.750% 15 February 2019	377,000 0.01%
950,000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.500% 10 March 2020	946,040 0.03%
124,000	EUR	SNS Bank NV 3.625% 18 July 2013	125,278 0.00%
210,000	EUR	SNS Bank NV 2.125% 30 August 2017	214,890 0.01%
400,000	EUR	Swiss Reinsurance Co via ELM BV FRN 25 May 2016	411,677 0.01%
85,000	EUR	TenneT Holding BV 3.250% 09 February 2015	89,262 0.00%
265,000	EUR	TenneT Holding BV FRN 01 June 2017	286,304 0.01%
100,000	EUR	TenneT Holding BV 4.625% 21 February 2023	118,894 0.00%
56,412	EUR	Unilever NV	1,626,640 0.05%
200,000	EUR	UPC Holding BV 9.750% 15 April 2018	214,762 0.01%
362,000	EUR	UPC Holding BV 8.375% 15 August 2020	406,939 0.01%
280,000	EUR	UPC Holding BV 6.375% 15 September 2022	285,950 0.01%
340,000	EUR	Volkswagen International Finance NV 3.250% 21 January 2019	371,468 0.01%
506,000	EUR	Ziggo Bond Co BV 8.000% 15 May 2018	557,157 0.02%
486,000	EUR	Ziggo Finance BV 6.125% 15 November 2017	521,284 0.02%
		オランダ合計	66,734,369 2.07%
		ニュージーランド	
521,000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd 3.875% 20 March 2017	579,997 0.02%
		ニュージーランド合計	579,997 0.02%
		ノルウェー	
136,036	NOK	DNB ASA	1,303,087 0.04%
473,000	EUR	DNB Bank ASA 4.500% 29 May 2014	499,662 0.02%
500,000	GBP	DNB Bank ASA FRN 29 January 2018	618,851 0.02%
400,000	EUR	DNB Bank ASA 4.375% 24 February 2021	470,363 0.01%
500,000	EUR	DNB Bank ASA FRN 08 March 2022	546,152 0.02%
121,000	EUR	SpareBank 1 SR Bank ASA 3.625% 24 March 2015	127,631 0.00%
480,000	EUR	SpareBank 1 SR Bank ASA 2.000% 14 May 2018	488,825 0.02%
480,000	EUR	Statkraft AS 2.500% 28 November 2022	482,261 0.01%
60,585	NOK	Statoil ASA	1,145,847 0.03%
80,197	NOK	Telenor ASA	1,224,328 0.04%
		ノルウェー合計	6,907,007 0.21%
		ポルトガル	
156,349	EUR	Galp Energia SGPS SA	1,838,664 0.06%
36,888	EUR	Jeronimo Martins SGPS SA	538,565 0.02%
		ポルトガル合計	2,377,229 0.08%
		ロシア	
3,176,843	USD	Gazprom OAO	22,743,388 0.69%
355,454	USD	Lukoil OAO	17,915,376 0.54%
247,498	USD	Magnit OJSC	7,510,768 0.23%
449,787	USD	MMC Norilsk Nickel OJSC	6,273,365 0.19%
63,875	USD	NovaTek OAO	5,791,033 0.18%
1,876,955	USD	Rosneft OAO	12,656,098 0.38%
1,462,320	USD	Sberbank of Russia	13,611,808 0.41%
128,638	USD	Uralkali OJSC	3,719,757 0.11%
1,159,799	USD	VTB Bank OJSC	3,036,876 0.09%
		ロシア合計	93,258,469 2.82%
		シンガポール	
1,115,000	SGD	Ascendas Real Estate Investment Trust	1,637,786 0.05%
1,359,000	SGD	CapitaLand Ltd	3,116,415 0.09%
		シンガポール合計	4,754,201 0.14%
		超国家	
1,800,000	GBP	European Investment Bank 5.500% 15 April 2025	2,814,866 0.09%
1,475,000	GBP	European Investment Bank 5.625% 07 June 2032	2,417,105 0.07%
688,000	GBP	European Investment Bank 3.875% 08 June 2037	889,088 0.03%
1,605,000	GBP	European Investment Bank 5.000% 15 April 2039	2,481,169 0.08%
1,744,000	GBP	European Investment Bank 4.500% 07 March 2044	2,497,389 0.08%
		超国家合計	11,099,617 0.35%
		南アフリカ	
223,000	EUR	Edcon Pty Ltd 3.433% 15 June 2014	215,753 0.01%
250,000	EUR	Peermont Global Pty Ltd 7.750% 30 April 2014	246,875 0.01%
		南アフリカ合計	462,628 0.02%
		韓国	
501	KRW	Samsung Electronics Co Ltd	539,018 0.02%
		韓国合計	539,018 0.02%
		スペイン	

500,000	EUR	Altadis Emisiones Financieras SAU 4.000% 11 December 2015	541,691	0.02%
900,000	EUR	Amadeus Capital Markets SA 4.875% 15 July 2016	986,376	0.03%
68,023	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	473,440	0.01%
50,000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 4.250% 30 March 2015	51,820	0.00%
		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.500% 05 December 2017	601,611	0.02%
600,000	EUR	Banco de Sabadell SA	238,975	0.01%
121,000	EUR	Banco Popular Espanol SA	173,456	0.01%
296,000	EUR	Bankia SA 3.500% 13 November 2014	389,826	0.01%
400,000	EUR	BBVA Senior Finance SAU 3.250% 23 April 2015	800,137	0.02%
800,000	EUR	Campofrio Food Group SA 8.250% 31 October 2016	91,378	0.00%
85,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 5.625% 09 February 2017	449,222	0.01%
400,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 4.125% 26 January 2018	265,459	0.01%
250,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 5.000% 13 February 2018	110,224	0.00%
100,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 5.375% 24 May 2019	557,764	0.02%
500,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 6.000% 27 January 2020	343,082	0.01%
300,000	EUR	Grifols SA	1,920,061	0.06%
73,843	EUR	Grifols S.A. Eur0.10	70,517	0.00%
3,692	EUR	Grifols S.A. - Rights 03 January 2013	3	0.00%
		Iberdrola Finanzas SAU 7.500% 25 November 2015	115,412	0.00%
100,000	EUR	Iberdrola Finanzas SAU 4.625% 07 April 2017	109,148	0.00%
100,000	EUR	Iberdrola Finanzas SAU 4.125% 23 March 2020	323,868	0.01%
300,000	EUR	Iberdrola Finanzas SAU 6.000% 01 July 2022	1,302,438	0.04%
1,000,000	GBP	Inditex SA	1,406,526	0.04%
13,332	EUR	Obrascon Huarte Lain SA 7.375% 28 April 2015	215,214	0.01%
200,000	EUR	Santander International Debt SAU 3.500% 12 August 2014	1,012,279	0.03%
1,000,000	EUR	Santander International Debt SAU 4.500% 18 May 2015	517,115	0.02%
500,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.431% 03 February 2014	676,832	0.02%
650,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 4.967% 03 February 2016	324,308	0.01%
300,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.496% 01 April 2016	219,764	0.01%
200,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.811% 05 September 2017	454,482	0.01%
400,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 3.661% 18 September 2017	156,696	0.01%
150,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.375% 02 February 2018	1,411,176	0.04%
1,092,000	GBP	Telefonica Emisiones SAU 4.797% 21 February 2018	109,527	0.00%
100,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 4.693% 11 November 2019	273,162	0.01%
250,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 4.710% 20 January 2020	433,533	0.01%
400,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.289% 09 December 2022	247,455	0.01%
200,000	GBP	スペイン合計	17,373,977	0.52%
		スウェーデン		
42,493	SEK	Africa Oil Corp	226,175	0.01%
400,000	EUR	Akzo Nobel Sweden Finance AB 7.750% 31 January 2014	429,343	0.01%
141,480	SEK	Elektro AB	1,670,878	0.05%
570,000	EUR	Investor AB 4.875% 18 November 2021	699,256	0.02%
41,709	SEK	Investment AB Kinnevik	659,206	0.02%
49,982	SEK	Lundin Petroleum AB	870,296	0.03%
400,000	EUR	Norcell Sweden Holding 2 AB 10.750% 29 September 2019	434,000	0.01%
259,000	EUR	Nordea Bank AB 2.750% 11 August 2015	272,648	0.01%
200,000	EUR	Nordea Bank AB 3.625% 11 February 2016	216,962	0.01%
440,000	EUR	Nordea Bank AB FRN 10 September 2018	452,175	0.01%
181,000	EUR	Nordea Bank AB 4.000% 29 June 2020	208,321	0.01%
259,000	EUR	Nordea Bank AB 4.000% 29 March 2021	280,238	0.01%
320,000	EUR	Nordea Bank AB FRN 15 February 2022	346,584	0.01%
440,000	EUR	Nordea Bank AB 3.250% 05 July 2022	478,288	0.01%
47,485	SEK	Sandvik AB	572,412	0.02%
420,000	EUR	Sandvik AB 6.875% 25 February 2014	449,957	0.01%
1,000,000	GBP	Skandinaviska Enskilda Banken AB 6.625% 09 July 2014	1,319,999	0.04%
		Skandinaviska Enskilda Banken AB 2.500% 01 September 2015	252,867	0.01%
242,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.750% 19 May 2016	381,840	0.01%
350,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.875% 14 November 2019	494,121	0.02%
490,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 12 September 2022	296,853	0.01%
280,000	EUR	Svenska Cellulosa AB	981,472	0.03%
59,765	SEK	Svenska Handelsbanken AB	783,116	0.02%
28,932	SEK	Svenska Handelsbanken AB 1.500% 06 July 2015	509,699	0.02%
500,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB 3.625% 16 February 2016	271,858	0.01%
250,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB 2.250% 14 June 2018	482,966	0.01%
460,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB 4.375% 20 October 2021	236,683	0.01%
200,000	EUR	Swedbank AB	1,483,140	0.04%
100,269	SEK	Swedbank AB 3.375% 09 February 2017	199,061	0.01%
183,000	EUR	Sweden Government Bond 3.500% 01 December 2015	278,652	0.01%
1,760,000	SEK	Sweden Government Bond 0.250% 01 June 2022	5,232,694	0.16%
43,460,000	SEK	Sweden Government Bond 3.500% 01 December 2028	2,923,856	0.09%
13,480,000	SEK	Swedish Match AB	696,638	0.02%
27,412	SEK	Tele2 AB	884,161	0.03%
64,828	SEK	TeliaSonera AB 3.625% 14 February 2024	643,576	0.02%
580,000	EUR	TeliaSonera AB 3.875% 01 October 2025	121,061	0.00%
106,000	EUR	TeliaSonera AB 3.000% 07 September 2027	226,533	0.01%
220,000	EUR	Vattenfall AB 4.250% 19 May 2014	64,126	0.00%
61,000	EUR	Vattenfall AB 6.250% 17 March 2021	81,448	0.00%
61,000	EUR	Vattenfall AB 6.875% 15 April 2039	1,781,935	0.05%
1,014,000	GBP	Volvo AB	1,519,941	0.05%
146,961	SEK	Volvo Treasury AB 9.875% 27 February 2014	113,705	0.00%
103,000	EUR	スウェーデン合計	30,528,740	0.93%
		スイス		
16,226	USD	ACE Ltd	969,710	0.03%
6,531	EUR	Aryzta AG	254,709	0.01%
542,000	EUR	Credit Suisse AG/Guernsey 2.875% 24 September 2015	571,670	0.02%
163,000	EUR	Credit Suisse AG/London 3.875% 25 January 2017	181,083	0.01%
59,141	CHF	Nestle SA	2,919,449	0.09%
52,986	CHF	Novartis AG	2,521,257	0.08%
14,939	CHF	Swiss Re AG	815,404	0.02%
9,577	CHF	Syngenta AG	2,907,956	0.09%

			訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
55,096	CHF	UBS AG	651,193	0.02%
458,000	EUR	UBS AG/Jersey FRN 25 September 2018	459,211	0.01%
109,000	EUR	UBS AG/Jersey FRN 16 September 2019	111,813	0.00%
7,015	CHF	Zurich Insurance Group AG	1,414,212	0.04%
		スイス合計	13,777,667	0.42%
		トルコ		
23,098	TRY	Koza Altin Isletmeleri AS	422,009	0.01%
		トルコ合計	422,009	0.01%
		アラブ首長国連邦		
320,000	EUR	IPIC GMTN Ltd 2.375% 30 May 2018	328,838	0.01%
460,000	EUR	Xstrata Finance Dubai Ltd 1.500% 19 May 2016	459,235	0.01%
		アラブ首長国連邦合計	788,073	0.02%
		英国		
218,000	GBP	Abbey National Treasury Services Plc/London 5.500% 18 June 2014	280,851	0.01%
440,000	EUR	Abbey National Treasury Services Plc/London 3.375% 20 October 2015	467,762	0.01%
358,276	GBP	Aberdeen Asset Management Plc	1,611,750	0.05%
350,000	GBP	ABP Finance Plc 6.250% 14 December 2026	478,848	0.01%
557,557	GBP	Afren Plc	895,752	0.03%
123,000	GBP	Anglian Water Osprey Financing Plc 7.000% 31 January 2018	164,729	0.01%
180,000	GBP	Anglian Water Services Financing Plc 5.250% 30 October 2015	243,117	0.01%
143,000	EUR	Anglian Water Services Financing Plc 6.250% 27 June 2016	169,586	0.01%
27,680	GBP	Anglo American Plc	642,453	0.02%
400,000	GBP	Arkle Master Issuer Plc 4.681% 17 February 2017	547,617	0.02%
163,579	GBP	ARM Holdings Plc	1,539,517	0.05%
124,686	GBP	Ashtead Group Plc	651,371	0.02%
43,494	GBP	ASOS Plc	1,434,296	0.04%
95,047	GBP	Associated British Foods Plc	1,821,674	0.06%
77,869	GBP	AstraZeneca Plc	2,776,378	0.08%
20,375	GBP	Aveva Group Plc	544,814	0.02%
448,207	GBP	Aviva Plc	2,048,722	0.06%
37,000	EUR	Aviva Plc FRN 28 November 2014	36,068	0.00%
380,000	EUR	Aviva Plc FRN 29 September 2015	377,156	0.01%
200,000	EUR	Aviva Plc FRN 02 October 2023	201,399	0.01%
850,000	GBP	Aviva Plc FRN 14 November 2036	1,082,673	0.03%
850,000	GBP	Aviva Plc FRN 03 June 2041	1,097,869	0.03%
260,000	GBP	Aviva Plc FRN 2022/29/29	301,780	0.01%
150,000	GBP	AWG Parent Co Ltd/UK 6.625% 15 January 2029	249,378	0.01%
203,634	GBP	Babcock International Group Plc	2,409,340	0.07%
250,000	GBP	Bank of Scotland Plc 1.835% 24 March 2016	394,641	0.01%
224,000	EUR	Barclays Bank Plc 5.250% 27 May 2014	238,130	0.01%
130,000	EUR	Barclays Bank Plc 4.125% 15 March 2016	142,859	0.00%
380,000	EUR	Barclays Bank Plc 4.000% 20 January 2017	422,991	0.01%
350,000	GBP	Barclays Bank Plc FRN 15 December 2017	368,466	0.01%
175,000	EUR	Barclays Bank Plc FRN 04 March 2019	177,215	0.01%
463,000	GBP	Barclays Bank Plc FRN 15 June 2019	759,096	0.02%
109,000	EUR	Barclays Bank Plc 6.000% 14 January 2021	123,704	0.00%
550,000	GBP	Barclays Bank Plc 10.000% 21 May 2021	908,358	0.03%
1,377,000	GBP	Barclays Bank Plc 5.750% 17 August 2021	2,049,822	0.06%
150,000	EUR	Barclays Bank Plc 6.625% 30 March 2022	177,516	0.01%
2,490,000	USD	Barclays Bank Plc 7.625% 21 November 2022	1,891,443	0.06%
1,089,812	GBP	Barclays Plc	3,504,379	0.11%
55,000	EUR	BAT International Finance Plc 5.875% 12 March 2015	61,035	0.00%
250,000	EUR	BAT International Finance Plc 3.625% 09 November 2021	279,126	0.01%
1,050,000	GBP	BAT International Finance Plc 6.000% 29 June 2022	1,602,054	0.05%
331,000	GBP	BAT International Finance Plc 5.750% 05 July 2040	496,206	0.02%
83,798	GBP	Bellway Plc	1,061,817	0.03%
117,292	GBP	Berkeley Group Holdings Plc	2,525,432	0.08%
240,000	EUR	BG Energy Capital Plc 3.000% 16 November 2018	261,087	0.01%
338,657	GBP	BG Group Plc	4,201,948	0.13%
188,655	GBP	BHP Billiton Plc	4,923,133	0.15%
600,000	GBP	BMW UK Capital Plc 5.000% 02 October 2017	834,141	0.03%
628,300	GBP	Booker Group Plc	751,856	0.02%
200,000	EUR	Boparan Finance Plc 9.750% 30 April 2018	227,500	0.01%
109,000	EUR	BP Capital Markets Plc 3.100% 07 October 2014	113,935	0.00%
1,594,012	GBP	BP Plc	8,297,967	0.25%
450,000	EUR	Brambles Finance Plc 4.625% 20 April 2018	520,096	0.02%
135,341	GBP	British American Tobacco Plc	5,176,292	0.16%
376,848	GBP	British Land Co Plc	2,595,363	0.08%
783,000	EUR	British Telecommunications Plc 6.125% 11 July 2014	845,393	0.03%
1,150,000	GBP	British Telecommunications Plc 8.500% 07 December 2016	1,751,461	0.05%
63,858	GBP	Britvic Plc	318,419	0.01%
990,351	GBP	BT Group Plc	2,804,689	0.09%
80,370	GBP	Burberry Group Plc	1,207,480	0.04%
279,156	GBP	Capital & Counties Properties Plc	827,862	0.02%
385,201	GBP	Centrica Plc	1,574,741	0.05%
363,000	GBP	Centrica Plc 4.375% 13 March 2029	479,463	0.01%
97,208	GBP	Close Brothers Group Plc	1,028,036	0.03%
292,842	GBP	Compass Group Plc	2,601,758	0.08%
363,000	GBP	Compass Group Plc 7.000% 08 December 2014	493,643	0.02%
700,000	EUR	Coventry Building Society 2.250% 04 December 2017	714,665	0.02%
51,872	GBP	Croda International Plc	1,510,341	0.05%
90,000	GBP	Delamare Finance Plc 5.546% 19 February 2029	126,305	0.00%
64,532	GBP	Derwent London Plc	1,665,440	0.05%
226,483	GBP	Diageo Plc	4,959,704	0.15%
80,000	GBP	Dignity Finance Plc 8.151% 31 December 2030	139,687	0.00%
310,000	GBP	Direct Line Insurance Group Pl Var 9.250% 27 April 2042	447,730	0.01%
1,267,320	GBP	DS Smith Plc	3,177,514	0.10%
235,177	GBP	easyJet Plc	2,206,153	0.07%

		訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
169,000	EUR	EC Finance Plc 9.750% 01 August 2017	185,689 0.01%
399,000	GBP	Enterprise Inns Plc 6.500% 06 December 2018	477,992 0.01%
601,000	GBP	Eversholt Funding Plc 6.359% 02 December 2025	913,405 0.03%
100,000	GBP	Experian Finance Plc 5.625% 12 December 2013	127,508 0.00%
238,000	GBP	Experian Finance Plc 4.750% 23 November 2018	327,018 0.01%
470,000	EUR	Experian Finance Plc 4.750% 04 February 2020	557,442 0.02%
350,000	EUR	FCE Bank Plc 7.125% 15 January 2013	352,373 0.01%
250,000	EUR	FCE Bank Plc 7.250% 15 July 2013	257,531 0.01%
100,000	EUR	FCE Bank Plc 9.375% 17 January 2014	108,328 0.00%
300,000	EUR	FCE Bank Plc 4.750% 19 January 2015	319,375 0.01%
150,000	GBP	FCE Bank Plc 5.125% 16 November 2015	197,962 0.01%
400,000	EUR	FCE Bank Plc 2.875% 03 October 2017	414,322 0.01%
99,888	GBP	Fenner Plc	485,102 0.01%
40,000	GBP	First Hydro Finance Plc 9.000% 31 July 2021	61,027 0.00%
380,000	EUR	G4S International Finance Plc 2.875% 02 May 2017	392,857 0.01%
200,000	EUR	G4S International Finance Plc 2.625% 06 December 2018	200,041 0.01%
200,000	EUR	G4S International Finance Plc 2.625% 06 December 2018	200,041 0.01%
149,000	GBP	G4S Plc 7.750% 13 May 2019	224,953 0.01%
270,000	GBP	Gala Electric Casinos Plc 11.500% 01 June 2019	324,264 0.01%
101,711	GBP	Galliford Try Plc	927,335 0.03%
1,025,906	GBP	GKN Plc	2,876,467 0.09%
100,000	GBP	GKN Holdings Plc 5.375% 19 September 2022	127,651 0.00%
200,000	EUR	GlaxoSmithKline Capital Inc 4.000% 16 June 2025	234,917 0.01%
378,159	GBP	GlaxoSmithKline Plc	6,186,590 0.19%
703,000	GBP	Go-Ahead Group Plc 5.375% 29 September 2017	943,931 0.03%
268,412	GBP	Grainger Plc	390,106 0.01%
371,714	GBP	Great Portland Estates Plc	2,227,933 0.07%
200,000	GBP	Great Rolling Stock Co Plc 6.500% 05 April 2031	306,918 0.01%
150,027	GBP	Greene King Plc	1,149,985 0.03%
307,283	GBP	Hammerson Plc	1,838,742 0.06%
758,000	EUR	Hammerson Plc 4.875% 19 June 2015	830,093 0.03%
400,000	EUR	Hammerson Plc 2.750% 26 September 2019	412,899 0.01%
750,000	GBP	Hammerson Plc 6.000% 23 February 2026	1,112,692 0.03%
770,000	GBP	Heathrow Finance Plc 5.375% 02 September 2019	957,750 0.03%
200,000	GBP	House of Fraser Funding Plc 8.875% 15 August 2018	257,180 0.01%
1,105,994	GBP	Howden Joinery Group Plc	2,343,383 0.07%
419,000	EUR	HSBC Bank Plc 3.875% 24 October 2018	476,977 0.01%
1,629,406	GBP	HSBC Holdings Plc	12,917,012 0.39%
283,000	EUR	HSBC Holdings Plc 6.000% 10 June 2019	342,910 0.01%
500,000	GBP	HSBC Holdings Plc FRN 18 October 2022	682,060 0.02%
1,400,000	GBP	HSBC Holdings Plc 7.000% 07 April 2038	2,234,915 0.07%
937,000	GBP	HSBC Holdings Plc 6.000% 29 March 2040	1,365,696 0.04%
192,431	GBP	IMI Plc	2,586,886 0.08%
323,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 7.250% 15 September 2014	357,175 0.01%
616,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 8.375% 17 February 2016	748,253 0.02%
300,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 5.500% 22 November 2016	414,403 0.01%
280,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 4.500% 05 July 2018	320,452 0.01%
177,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 5.000% 02 December 2019	210,790 0.01%
185,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 9.000% 17 February 2022	322,264 0.01%
463,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 8.125% 15 March 2024	781,469 0.02%
340,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 5.500% 28 September 2026	487,442 0.02%
125,214	GBP	Imperial Tobacco Group Plc	3,641,214 0.11%
299,747	GBP	Inchcape Plc	1,582,803 0.05%
200,000	EUR	Ineos Finance Plc 9.250% 15 May 2015	215,000 0.01%
241,000	GBP	Infinis Plc 9.125% 15 December 2014	305,667 0.01%
123,669	GBP	Inmarsat Plc	885,811 0.03%
1,125,909	GBP	ITV Plc	1,451,492 0.04%
124,531	GBP	J Sainsbury Plc	526,645 0.02%
400,000	GBP	Jaguar Land Rover Plc 8.125% 15 May 2018	542,820 0.02%
220,000	GBP	Jaguar Land Rover Plc 8.250% 15 March 2020	299,727 0.01%
34,703	GBP	Johnson Matthey Plc	1,010,437 0.03%
310,000	EUR	Kerling Plc 10.625% 01 February 2017	299,925 0.01%
24,173	GBP	Kier Group Plc	392,798 0.01%
441,969	GBP	Kingfisher Plc	1,538,717 0.05%
292,000	GBP	Land Securities Capital Markets Plc FRN 07 November 2019	406,289 0.01%
335,612	GBP	Land Securities Group Plc	3,345,728 0.10%
940,000	GBP	LBG Capital No.1 Plc 11.040% 19 March 2020	1,350,630 0.04%
363,000	GBP	LBG Capital No.1 Plc 7.869% 25 August 2020	474,309 0.01%
370,000	GBP	LBG Capital No.2 Plc 15.000% 21 December 2019	607,118 0.02%
1,469,479	GBP	Legal & General Group Plc	2,621,926 0.08%
76,000	GBP	Legal & General Group Plc FRN 01 April 2019	97,130 0.00%
307,000	EUR	Legal & General Group Plc FRN 08 June 2025	304,383 0.01%
7,394,865	GBP	Lloyds Banking Group Plc	4,342,075 0.13%
16,000	EUR	Lloyds Banking Group Plc 5.875% 08 July 2014	16,965 0.00%
270,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 4.500% 15 September 2014	287,140 0.01%
206,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 3.750% 07 September 2015	220,956 0.01%
319,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 6.375% 17 June 2016	374,371 0.01%
645,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc FRN 05 March 2018	625,334 0.02%
363,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc 6.750% 24 October 2018	544,117 0.02%
270,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 6.500% 24 March 2020	309,147 0.01%
617,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc FRN 16 December 2021	898,694 0.03%
1,200,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc 7.500% 15 April 2024	1,961,405 0.06%
278,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc FRN 09 July 2025	329,956 0.01%
490,000	GBP	London Stock Exchange Group Plc 9.125% 18 October 2019	787,358 0.02%
323,030	GBP	Marks & Spencer Group Plc	1,513,362 0.05%
573,000	GBP	Marks & Spencer Plc 5.625% 24 March 2014	733,038 0.02%
417,000	GBP	Marks & Spencer Plc 6.125% 02 December 2019	585,267 0.02%
190,000	GBP	Marks & Spencer Plc 4.750% 12 June 2025	236,836 0.01%
275,000	GBP	Matalan Finance Plc 8.875% 29 April 2016	351,742 0.01%
385,000	GBP	Matalan Finance Plc 9.625% 31 March 2017	467,080 0.01%
208,565	GBP	Melrose Industries Plc	571,235 0.02%
100,019	GBP	Micro Focus International Plc	713,347 0.02%
53,947	GBP	Mitchells & Butlers Finance Plc 5.965% 15 December 2023	71,459 0.00%
73,000	GBP	Mitchells & Butlers Finance Plc 6.469% 15 September 2030	86,024 0.00%

			訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
492,000	EUR	Mondi Finance Plc 5.750% 03 April 2017	565,766	0.02%
530,000	EUR	Mondi Finance Plc 3.375% 28 September 2020	549,160	0.02%
149,000	GBP	Motability Operations Group Plc 5.250% 28 September 2016	206,273	0.01%
390,000	EUR	Motability Operations Group Plc 3.250% 30 November 2018	426,242	0.01%
149,000	GBP	Motability Operations Group Plc 6.625% 10 December 2019	231,055	0.01%
104,589	GBP	National Express Group Plc	261,592	0.01%
241,000	GBP	National Express Group Plc 6.250% 13 January 2017	328,770	0.01%
900,000	GBP	National Express Group Plc 6.625% 17 June 2020	1,283,894	0.04%
153,000	GBP	National Grid Electricity Transmission Plc 7.375% 13 January 2031	266,794	0.01%
93,000	GBP	National Grid Gas Plc 4.188% 14 December 2022	226,287	0.01%
1,000,000	GBP	National Grid Gas Plc 7.000% 16 December 2024	1,651,488	0.05%
650,000	EUR	National Grid Plc 6.500% 22 April 2014	698,103	0.02%
97,000	EUR	National Grid Plc 5.000% 02 July 2018	115,418	0.00%
300,000	EUR	National Grid Plc 4.375% 10 March 2020	351,358	0.01%
70,000	GBP	National Westminster Bank Plc 7.875% 09 September 2015	94,505	0.00%
426,000	EUR	Nationwide Building Society 3.750% 20 January 2015	450,825	0.01%
742,000	EUR	Nationwide Building Society 3.125% 03 April 2017	800,696	0.02%
807,000	GBP	Nationwide Building Society 5.625% 09 September 2019	1,165,169	0.04%
822,000	EUR	Nationwide Building Society 6.750% 22 July 2020	965,044	0.03%
520,000	GBP	Nationwide Building Society FRN 06 February 2026	558,980	0.02%
313,000	GBP	Network Rail Infrastructure Finance Plc 1.750% 22 November 2027	579,723	0.02%
879,000	GBP	Network Rail Infrastructure Finance Plc 1.375% 22 November 2037	1,611,743	0.05%
690,000	USD	Nord Anglia Education UK Holdings Plc 10.250% 01 April 2017	582,227	0.02%
73,000	GBP	Northern Gas Networks Finance Plc 5.875% 08 July 2019	106,694	0.00%
198,000	GBP	Northumbrian Water Finance Plc 5.625% 29 April 2033	293,135	0.01%
300,000	GBP	Old Mutual Plc 8.000% 03 June 2021	401,020	0.01%
111,719	GBP	Persimmon Plc	1,095,248	0.03%
200,000	GBP	Phones4u Finance Plc 9.500% 01 April 2018	256,580	0.01%
239,074	GBP	Prudential Plc	2,535,683	0.08%
216,480	GBP	Punch Taverns Finance Plc 6.820% 15 July 2020	260,477	0.01%
80,000	GBP	Punch Taverns Finance Plc 7.567% 15 April 2026	46,077	0.00%
24,966	GBP	Reckitt Benckiser Group Plc	1,186,764	0.04%
190,433	GBP	Restaurant Group Plc	902,894	0.03%
365,000	EUR	Rexam Plc 4.375% 15 March 2013	367,091	0.01%
616,000	EUR	Rexam Plc FRN 29 June 2067	646,800	0.02%
35,017	GBP	Rightmove Plc	616,210	0.02%
156,764	GBP	Rio Tinto Plc	6,745,818	0.21%
400,000	EUR	Rio Tinto Finance Plc 2.000% 11 May 2020	406,436	0.01%
320,000	GBP	Rio Tinto Finance Plc 4.000% 11 December 2029	395,921	0.01%
300,000	GBP	RL Finance Bonds Plc FRN 15 December 2015	325,789	0.01%
17,162,548	GBP	Rolls-Royce Holdings Plc - C Shares	21,032	0.00%
225,823	GBP	Rolls-Royce Holdings Plc	2,417,278	0.07%
538,000	EUR	Royal Bank of Scotland Group Plc 5.250% 15 May 2013	546,923	0.02%
79,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 6.000% 10 May 2013	80,312	0.00%
600,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 4.750% 18 May 2016	667,845	0.02%
667,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 4.875% 20 January 2017	755,642	0.02%
337,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 5.375% 30 September 2019	403,166	0.01%
121,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 5.500% 23 March 2020	146,304	0.00%
369,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc FRN 22 September 2021	352,365	0.01%
300,000	GBP	Royal Bank of Scotland Plc/The 6.375% 29 April 2014	390,851	0.01%
85,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc/The 5.750% 21 May 2014	90,561	0.00%
1,245,000	GBP	Royal Bank of Scotland Plc/The 6.625% 17 September 2018	1,847,799	0.06%
240,000	GBP	Royal Bank of Scotland Plc/The 7.500% 29 April 2024	390,925	0.01%
517,345	GBP	Royal Dutch Shell Plc	13,578,291	0.41%
1,016,593	GBP	RSA Insurance Group Plc	1,565,950	0.05%
500,000	GBP	RSA Insurance Group Plc FRN 20 May 2039	785,941	0.02%
24,117	GBP	SABMiller Plc	834,906	0.03%
518,000	EUR	SABMiller Plc 4.500% 20 January 2015	557,424	0.02%
677,000	GBP	Scottish Widows Plc FRN 24 September 2015	752,903	0.02%
173,000	GBP	Segro Plc 6.250% 30 September 2015	234,784	0.01%
200,000	GBP	Segro Plc 5.500% 20 June 2018	274,493	0.01%
280,000	GBP	Segro Plc 6.000% 30 September 2019	401,286	0.01%
841,000	GBP	Segro Plc 6.750% 23 November 2021	1,261,674	0.04%
419,000	GBP	Segro Plc 6.750% 23 February 2024	629,016	0.02%
203,000	GBP	Severn River Crossing Plc 6.125% 30 June 2013	458,193	0.01%
249,000	GBP	Seyn Trent Utilities Finance Plc 6.125% 26 February 2024	379,071	0.01%
945,000	GBP	Silverstone Master Issuer Plc 5.063% 21 October 2016	1,304,751	0.04%
1,000,000	GBP	South Eastern Power Networks Plc 5.500% 05 June 2026	1,456,166	0.04%
1,200,000	GBP	Southern Electric Power Distribution Plc 5.500% 07 June 2032	1,789,214	0.05%
350,000	GBP	Southern Gas Networks Plc 4.875% 05 October 2023	489,831	0.02%
56,530	GBP	Spectris Plc	1,419,438	0.04%
1,381,000	EUR	SSE Plc FRN 01 October 2015	1,433,518	0.04%
323,000	GBP	SSE Plc 5.000% 01 October 2018	453,919	0.01%
500,000	GBP	SSE Plc 6.250% 27 August 2038	799,788	0.02%
350,000	EUR	SSE Plc FRN 29 September 2049	371,967	0.01%
318,269	GBP	Stagecoach Group Plc	1,198,150	0.04%
200,000	GBP	Standard Chartered Bank FRN 11 May 2016	274,110	0.01%
186,695	GBP	Standard Chartered Plc	3,599,938	0.11%
204,000	EUR	Standard Chartered Plc 5.750% 30 April 2014	217,641	0.01%
409,493	GBP	SVG Capital Plc	1,444,720	0.04%
165,630	GBP	Telecity Group Plc	1,596,369	0.05%
48,957	GBP	Telereal Securitisation Plc 5.565% 10 December 2031	71,478	0.00%
125,000	GBP	Tesco Plc FRN 24 March 2036	193,754	0.01%
150,000	EUR	Thomas Cook Group Plc 6.750% 22 June 2015	128,303	0.00%
241,426	GBP	Tullow Oil Plc	3,730,738	0.11%
53,935	GBP	Unilever Plc	1,563,799	0.05%
730,000	GBP	Unilever Plc 4.750% 16 June 2017	1,022,580	0.03%
600,000	GBP	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30 March 2021	705,859	0.02%
300,000	GBP	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28 March 2024	302,398	0.01%

			訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
115,933	GBP	United Kingdom Gilt 5.000% 07 March 2018	171,337	0.00%
20,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.500% 16 August 2013	68,704	0.00%
894,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2017	1,587,373	0.05%
1,374,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.500% 16 April 2020	6,267,491	0.19%
1,906,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.875% 22 November 2022	3,575,008	0.11%
965,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22 March 2024	1,295,474	0.04%
859,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.500% 17 July 2024	3,574,312	0.11%
577,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2027	1,111,373	0.03%
4,044,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22 March 2029	5,365,889	0.16%
1,134,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 4.125% 22 July 2030	4,417,730	0.13%
2,153,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2032	3,795,342	0.12%
3,195,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.750% 22 March 2034	4,803,197	0.15%
1,470,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.000% 26 January 2035	3,639,392	0.11%
2,230,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.125% 22 November 2037	4,218,505	0.13%
1,876,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 22 March 2040	2,979,754	0.09%
1,224,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 22 November 2042	2,008,165	0.06%
179,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22 March 2044	219,879	0.01%
1,961,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.750% 22 November 2047	3,437,475	0.10%
2,892,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.500% 22 March 2050	4,593,880	0.14%
498,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.250% 22 March 2052	636,632	0.02%
3,451,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2055	7,897,574	0.24%
2,436,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.375% 22 March 2062	3,462,963	0.11%
234,749	GBP	United Utilities Group Plc	1,937,478	0.06%
113,000	EUR	United Utilities Water Plc 4.250% 24 January 2020	130,105	0.00%
1,200,000	GBP	United Utilities Water Plc 5.625% 20 December 2027	1,781,184	0.05%
139,000	GBP	Virgin Media Finance Plc 8.875% 15 October 2019	194,549	0.01%
70,000	GBP	Virgin Media Secured Finance Plc 7.000% 15 January 2018	92,991	0.00%
4,204,844	GBP	Vodafone Group Plc	7,958,539	0.24%
116,000	EUR	Vodafone Group Plc 6.250% 15 January 2016	135,059	0.00%
743,000	GBP	Vodafone Group Plc 5.375% 05 December 2017	1,059,535	0.03%
47,301	GBP	Weir Group Plc	1,089,163	0.03%
909,000	GBP	Western Power Distribution West Midlands Plc 5.750% 16 April 2032	1,323,920	0.04%
73,306	GBP	Whitbread Plc	2,198,210	0.07%
229,000	GBP	William Hill Plc 7.125% 11 November 2016	312,900	0.01%
266,732	GBP	Xstrata Plc	3,461,519	0.11%
		英国合計	364,226,689	11.09%
		米国		
1,195,000	USD	Accellent Inc 8.375% 01 February 2017	954,088	0.03%
480,000	USD	Access Midstream Partners LP / ACP Finance Corp 4.875% 15 May 2023	370,518	0.01%
944,000	USD	Accuride Corp 9.500% 01 August 2018	692,966	0.02%
24,357	USD	Acuity Brands Inc	1,220,069	0.04%
1,182,000	USD	Aleris International Inc 7.625% 15 February 2018	912,401	0.03%
480,000	USD	Alliance Data Systems Corp 6.375% 01 April 2020	383,232	0.01%
2,030,000	USD	Alliance One International Inc 10.000% 15 July 2016	1,632,275	0.05%
74,817	USD	Altria Group Inc	1,760,312	0.05%
164,000	USD	Altria Group Inc 4.125% 11 September 2015	134,797	0.00%
49,000	USD	Altria Group Inc 9.700% 10 November 2018	51,983	0.00%
77,000	USD	Altria Group Inc 9.250% 06 August 2019	81,330	0.00%
250,000	USD	Altria Group Inc 4.750% 05 May 2021	215,317	0.01%
433,000	USD	Altria Group Inc 2.850% 09 August 2022	325,880	0.01%
224,000	USD	Altria Group Inc 10.200% 06 February 2039	286,310	0.01%
534,000	USD	AMC Entertainment Inc 8.750% 01 June 2019	449,583	0.01%
2,200,000	USD	AMC Entertainment Inc 9.750% 01 December 2020	1,931,296	0.06%
463,000	USD	American Axle & Manufacturing Inc 7.750% 15 November 2019	381,923	0.01%
1,442,000	USD	American Axle & Manufacturing Inc 6.625% 15 October 2022	1,113,099	0.03%
12,889	USD	Amgen Inc	831,440	0.03%
210,000	EUR	Amgen Inc 4.375% 05 December 2018	244,715	0.01%
390,000	EUR	Amgen Inc 2.125% 13 September 2019	399,354	0.01%
7,038	USD	Anadarko Petroleum Corp 15 July 2016	385,138	0.01%
7,866	USD	Apple Inc	3,032,422	0.09%
696,000	USD	Apria Healthcare Group Inc 11.250% 01 November 2014	545,811	0.02%
37,418	USD	Arthur J Gallagher & Co	976,091	0.03%
20,994	USD	AT&T Inc	529,381	0.02%
950,000	GBP	AT&T Inc 5.875% 28 April 2017	1,353,386	0.04%
440,000	EUR	AT&T Inc 3.550% 17 December 2032	460,788	0.01%
315,000	USD	Atlas Pipeline Partners LP / Atlas Pipeline Finance Corp 8.750% 15 June 2018	255,072	0.01%
734,000	USD	Atwood Oceanics Inc 6.500% 01 February 2020	599,913	0.02%
64,824	USD	AvalonBay Communities Inc	6,572,704	0.20%

		Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc		
540,000	USD	9.625% 15 March 2018	457,699	0.01%
860,000	USD	B/E Aerospace Inc 5.250% 01 April 2022	693,133	0.02%
250,000	EUR	Bank of America Corp 5.125% 26 September 2014	267,140	0.01%
1,150,000	EUR	Bank of America Corp 7.000% 15 June 2016	1,362,878	0.04%
750,000	EUR	Bank of America Corp 4.750% 03 April 2017	845,711	0.03%
150,000	EUR	Bank of America Corp 4.625% 07 August 2017	169,271	0.01%
400,000	EUR	Bank of America Corp FRN 28 March 2018	374,042	0.01%
650,000	GBP	Bank of America Corp 6.125% 15 September 2021	938,849	0.03%
23,873	USD	Baxter International Inc	1,184,985	0.04%
29,530	USD	Beam Inc	1,341,976	0.04%
450,000	USD	Beazer Homes USA Inc 8.125% 15 June 2016	364,388	0.01%
1,180,000	USD	Beazer Homes USA Inc 6.625% 15 April 2018	953,275	0.03%
1,122,000	USD	Beazer Homes USA Inc 9.125% 15 June 2018	891,560	0.03%
196,000	USD	Berry Plastics Corp 8.250% 15 November 2015	155,374	0.00%
585,000	USD	BI-LO LLC / BI-LO Finance Corp 9.250% 15 February 2019	475,919	0.01%
720,000	USD	Biomet Inc 6.500% 01 August 2020	580,978	0.02%
450,000	EUR	BMW US Capital LLC 1.250% 20 July 2016	455,502	0.01%
1,909,000	USD	Boise Paper Holdings LLC / Boise Co-Issuer Co 8.000% 01 April 2020	1,603,605	0.05%
30,524	USD	BorgWarner Inc 15 February 2020	1,618,146	0.05%
85,517	USD	Boston Properties Inc	6,791,439	0.21%
2,130,000	USD	Boyd Gaming Corp 9.000% 01 July 2020	1,595,817	0.05%
49,414	USD	Brookdale Senior Living Inc	908,708	0.03%
3,159,000	USD	Cablevision Systems Corp 8.625% 15 September 2017	2,800,060	0.09%
893,000	USD	Caesars Entertainment Operating Co Inc 11.250% 01 June 2017	727,332	0.02%
2,880,000	USD	Caesars Entertainment Operating Co Inc 9.000% 15 February 2020	2,195,866	0.07%
121,490	USD	Calpine Corp	1,631,950	0.05%
2,484,000	USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 7.875% 30 April 2018	2,032,572	0.06%
1,015,000	USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 7.375% 01 June 2020	856,464	0.03%
2,070,000	USD	CDW LLC / CDW Finance Corp 8.500% 01 April 2019	1,703,601	0.05%
383,000	GBP	Cellco Partnership / Verizon Wireless Capital LLC 8.875% 18 December 2018	642,139	0.02%
133,000	EUR	Cemex Finance LLC 9.625% 14 December 2017	143,973	0.00%
8,322	USD	Centurylink Inc	242,847	0.01%
200,000	USD	Centurylink Inc 6.875% 15 January 2028	156,789	0.01%
300,000	USD	CF Industries Inc 7.125% 01 May 2020	286,769	0.01%
2,189,000	USD	Chaparral Energy Inc 8.250% 01 September 2021	1,813,961	0.06%
94,007	USD	Charles Schwab Corp	1,005,953	0.03%
1,504,000	USD	Chesapeake Energy Corp 7.250% 15 December 2018	1,246,322	0.04%
385,000	USD	Chesapeake Energy Corp 6.875% 15 November 2020	317,218	0.01%
7,623	USD	Chevron Corp	614,101	0.02%
2,500,000	USD	Chrysler Group LLC / CG Co-Issuer Inc 8.250% 15 June 2021	2,097,693	0.06%
90,481	USD	Citigroup Inc	2,671,171	0.08%
494,000	EUR	Citigroup Inc 6.400% 27 March 2013	500,654	0.02%
652,000	EUR	Citigroup Inc 4.000% 26 November 2015	706,274	0.02%
500,000	EUR	Citigroup Inc 4.375% 30 January 2017	561,692	0.02%
200,000	EUR	Citigroup Inc FRN 31 May 2017	185,681	0.01%
200,000	EUR	Citigroup Inc FRN 30 November 2017	189,998	0.01%
400,000	GBP	Citigroup Inc 7.625% 03 April 2018	602,797	0.02%
675,000	GBP	Citigroup Inc 5.125% 12 December 2018	882,347	0.03%
317,000	EUR	Citigroup Inc FRN 10 February 2019	307,363	0.01%
820,000	EUR	Citigroup Inc 7.375% 04 September 2019	1,078,383	0.03%
729,000	GBP	Citigroup Inc 5.875% 01 July 2024	977,965	0.03%
1,200,000	GBP	Citigroup Inc 6.500% 16 August 2030	1,817,073	0.06%
321,000	GBP	Citigroup Inc 7.375% 01 September 2039	537,946	0.02%
2,294,816	USD	CityCenter Holdings LLC / CityCenter Finance Corp 10.750% 15 January 2017	1,901,649	0.06%
925,000	USD	Clear Channel Communications Inc 9.000% 01 March 2021	628,267	0.02%
1,692,000	USD	Clear Channel Worldwide Holdings Inc 7.625% 15 March 2020	1,296,080	0.04%
17,664	USD	CMS Energy Corp	321,494	0.01%
33,530	USD	Cobalt International Energy Inc	609,248	0.02%
120,000	USD	Concho Resources Inc 7.000% 15 January 2021	101,711	0.00%
950,000	USD	Concho Resources Inc 6.500% 15 January 2022	794,427	0.02%
735,000	USD	Concho Resources Inc 5.500% 01 October 2022	589,605	0.02%
1,613,000	USD	Continental Resources Inc/OK 5.000% 15 September 2022	1,321,389	0.04%
2,559,000	USD	Cricket Communications Inc 7.750% 15 October 2020	1,985,009	0.06%
116,000	USD	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp II 7.625% 15 May 2017	93,273	0.00%
225,000	USD	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp III 6.250% 01 February 2021	187,515	0.01%
4,460	USD	Cummins Inc	357,167	0.01%
600,000	USD	CVS Pass-Through Trust 9.350% 10 January 2023	524,499	0.02%
460,000	USD	DaVita HealthCare Partners Inc 5.750% 15 August 2022	368,134	0.01%
378,652	USD	DDR Corp	4,421,549	0.13%
2,585,000	USD	Del Monte Corp 7.625% 15 February 2019	2,051,638	0.06%
603,000	USD	DineEquity Inc 9.500% 30 October 2018	520,794	0.02%
370,000	GBP	DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Co Inc 4.375% 14 September 2029	455,801	0.01%
772,000	USD	DISH DBS Corp 7.875% 01 September 2019	695,967	0.02%
2,260,000	USD	DISH DBS Corp 6.750% 01 June 2021	1,962,589	0.06%
985,000	USD	DISH DBS Corp 5.875% 15 July 2022	807,855	0.02%
940,000	USD	DJO Finance LLC / DJO Finance Corp 7.750% 15 April 2018	686,473	0.02%
1,260,000	USD	DJO Finance LLC / DJO Finance Corp 9.875% 15 April 2018	989,298	0.03%
8,902	USD	Dominion Resources Inc	344,118	0.01%
194,000	USD	DR Horton Inc 6.500% 15 April 2016	164,433	0.01%
990,000	USD	DR Horton Inc 4.375% 15 September 2022	770,750	0.02%
42,103	USD	Dr Pepper Snapple Group Inc	1,398,131	0.04%
47,149	USD	eBay Inc	1,777,286	0.05%
1,460,000	USD	El Paso LLC 7.000% 15 June 2017	1,267,830	0.04%

			訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
270,000	USD	EI Paso LLC 7.750% 15 January 2032	242,439	0.01%
504,000	USD	EI Paso Pipeline Partners Operating Co LLC 6.500% 01 April 2020	467,978	0.01%
25,284	USD	EMC Corp	475,106	0.01%
500,000	USD	Endo Health Solutions Inc 7.000% 15 December 2020	405,349	0.01%
520,000	USD	Endo Health Solutions Inc 7.250% 15 January 2022	424,023	0.01%
1,362,000	USD	Energy Future Intermediate Holding Co LLC / EFIH		
1,876,000	USD	Finance Inc 10.000% 01 December 2020	1,169,880	0.04%
5,479	USD	Energy XXI Gulf Coast Inc 7.750% 15 June 2019	1,558,137	0.05%
1,485,000	USD	EOG Resources Inc	491,803	0.01%
21,421	USD	EP Energy LLC / EP Energy Finance Inc 9.375% 01 May 2020	1,269,911	0.04%
30,908	USD	Essex Property Trust Inc	2,367,931	0.07%
40,242	USD	Estee Lauder Cos Inc	1,355,011	0.04%
109,894	USD	Express Scripts Holding Co	1,611,943	0.05%
9,040	USD	Extra Space Storage Inc	2,979,813	0.09%
3,970	USD	Exxon Mobil Corp	582,192	0.02%
100,000	USD	Facebook Inc	77,844	0.00%
41,513	USD	FAGE Dairy Industry SA / FAGE USA Dairy Industry Inc 9.875% 01 February 2020	81,921	0.00%
700,000	USD	Federal Realty Investment Trust	3,254,081	0.10%
142,633	USD	First Data Corp 10.550% 24 September 2015	544,974	0.02%
552,000	USD	Ford Motor Co	1,389,207	0.04%
360,000	USD	Ford Motor Co 7.450% 16 July 2031	532,620	0.02%
168,000	USD	Ford Motor Co 8.900% 15 January 2032	361,664	0.01%
32,985	USD	Ford Motor Credit Co LLC 8.125% 15 January 2020	163,721	0.01%
2,133,000	USD	Freeport-McMoRan Copper & Gold Inc	827,251	0.02%
1,446,000	USD	Freescale Semiconductor Inc 10.750% 01 August 2020	1,739,308	0.05%
1,470,000	USD	Frontier Communications Corp 8.250% 15 April 2017	1,272,124	0.04%
85,000	EUR	Frontier Communications Corp 8.125% 01 October 2018	1,282,114	0.04%
365,000	EUR	GE Capital Trust II FRN 15 September 2067	84,421	0.00%
8,143	USD	GE Capital Trust IV FRN 15 September 2066	360,401	0.01%
230,000	GBP	General Dynamics Corp	418,306	0.01%
383,000	GBP	General Electric Capital Corp 5.250% 07 December 2028	320,047	0.01%
27,594	USD	General Electric Capital Corp 5.375% 18 December 2040	529,849	0.02%
396,465	USD	General Electric Co	426,839	0.01%
482,000	USD	General Growth Properties Inc	5,904,705	0.18%
2,790,000	USD	GenOn Americas Generation LLC 8.500% 01 October 2021	417,658	0.01%
5,767	USD	GenOn Energy Inc 9.500% 15 October 2018	2,507,298	0.08%
1,256,000	USD	Gilead Sciences Inc	315,847	0.01%
4,229	USD	Goodrich Petroleum Corp 8.875% 15 March 2019	912,492	0.03%
408,000	USD	Google Inc	2,240,321	0.07%
53,268	USD	GWR Operating Partnership LLP 10.875% 01 April 2017	352,764	0.01%
1,362,000	USD	Hanesbrands Inc	1,410,115	0.04%
1,288,000	USD	HCA Inc 7.875% 15 February 2020	1,151,842	0.04%
1,800,000	USD	HCA Inc 7.250% 15 September 2020	1,086,823	0.03%
1,774,000	USD	HCA Inc 5.875% 01 May 2023	1,413,282	0.04%
2,255,000	USD	HCA Inc 7.500% 15 November 2095	1,201,559	0.04%
130,000	USD	HDTFS Inc 5.875% 15 October 2020	1,791,860	0.05%
95,084	USD	HDTFS Inc 6.250% 15 October 2022	105,268	0.00%
817,000	USD	Health Care REIT Inc	4,377,171	0.13%
308,000	USD	Health Management Associates Inc 7.375% 15 January 2020	670,842	0.02%
200,000	USD	HealthSouth Corp 7.250% 01 October 2018	255,231	0.01%
1,768,000	USD	HealthSouth Corp 5.750% 01 November 2024	155,707	0.00%
1,414,000	USD	Hexion US Finance Corp 6.625% 15 April 2020	1,364,743	0.04%
26,424	USD	Hexion US Finance Corp / Hexion Nova Scotia Finance ULC 8.875% 01 February 2018	1,104,861	0.03%
442,860	USD	Home Depot Inc	1,212,824	0.04%
545,000	EUR	Host Hotels & Resorts Inc	5,154,554	0.16%
1,328,000	USD	HSBC Finance Corp 3.750% 04 November 2015	585,684	0.02%
1,007,000	USD	IASIS Healthcare LLC / IASIS Capital Corp 8.375% 15 May 2019	954,751	0.03%
95,000	USD	Infor US Inc 11.500% 15 July 2018	895,438	0.03%
1,110,000	USD	Infor US Inc 9.375% 01 April 2019	81,060	0.00%
3,903	USD	Innovation Ventures LLC / Innovation Ventures Finance Corp 9.500% 15 August 2019	804,322	0.02%
1,565,000	USD	Intercontinental Exchange Inc	365,255	0.01%
1,230,000	USD	Jabil Circuit Inc 4.700% 15 September 2022	1,250,977	0.04%
495,000	USD	Jarden Corp 7.500% 01 May 2017	1,051,845	0.03%
25,680	USD	Jarden Corp 6.125% 15 November 2022	406,446	0.01%
72,520	USD	JB Hunt Transport Services Inc	1,136,503	0.03%
250,000	EUR	JPMorgan Chase & Co	2,373,077	0.07%
365,000	EUR	JPMorgan Chase & Co 6.125% 01 April 2014	266,799	0.01%
200,000	GBP	JPMorgan Chase & Co 3.750% 15 June 2016	399,867	0.01%
150,000	EUR	JPMorgan Chase & Co 4.250% 25 January 2017	266,157	0.01%
1,150,000	GBP	JPMorgan Chase & Co FRN 31 March 2018	144,177	0.00%
100,000	EUR	JPMorgan Chase Bank NA 5.375% 28 September 2016	1,562,336	0.05%
13,864	USD	JPMorgan Chase Bank NA FRN 30 November 2021	106,292	0.00%
174,337	USD	Kansas City Southern	860,971	0.03%
1,167,000	USD	Kimco Realty Corp	2,513,349	0.08%
41,603	USD	Kinetic Concepts Inc / KCI USA Inc 10.500% 01 November 2018	930,629	0.03%
780,000	USD	Kraft Foods Group Inc	1,398,214	0.04%
495,000	USD	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15 February 2019	662,597	0.02%
3,420,000	USD	Laredo Petroleum Inc 7.375% 01 May 2022	408,319	0.01%
250,000	USD	Laureate Education Inc 9.250% 01 September 2019	2,717,587	0.08%
1,775,000	USD	Level 3 Financing Inc 9.375% 01 April 2019	212,844	0.01%
410,000	USD	Level 3 Financing Inc 8.125% 01 July 2019	1,467,534	0.04%
1,215,000	USD	Level 3 Financing Inc 8.625% 15 July 2020	345,573	0.01%
670,000	USD	Libbey Glass Inc 6.875% 15 May 2020	993,044	0.03%
34,000	USD	Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp 6.500% 15 May 2019	514,647	0.02%
3,498	USD	Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp 8.625% 15 April 2020	28,175	0.00%
205,000	USD	Lockheed Martin Corp	241,796	0.01%
	USD	Ltd Brands Inc 6.625% 01 April 2021	178,410	0.01%

			訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)	
1,350,000	USD	Ltd Brands Inc 5.625% 15 February 2022	1,116,152	0.03%
190,000	USD	Ltd Brands Inc 6.950% 01 March 2033	147,023	0.00%
14,160	USD	Macy's Inc	400,349	0.01%
999	USD	Mastercard Inc	365,219	0.01%
3,289	USD	McKesson Corp	238,674	0.01%
15,736	USD	Mead Johnson Nutrition Co	775,372	0.02%
10,896	USD	Merck & Co Inc	335,111	0.01%
100,000	EUR	Merrill Lynch & Co Inc 6.000% 11 February 2013	100,554	0.00%
46,000	EUR	Merrill Lynch & Co Inc 4.450% 31 January 2014	47,650	0.00%
500,000	EUR	Merrill Lynch & Co Inc 4.875% 30 May 2014	526,245	0.02%
700,000	GBP	Merrill Lynch & Co Inc 7.750% 30 April 2018	1,045,513	0.03%
765,000	GBP	Merrill Lynch & Co Inc 5.500% 22 November 2021	1,004,093	0.03%
1,496,000	USD	MetroPCS Wireless Inc 6.625% 15 November 2020	1,207,144	0.04%
100,000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I 4.625% 16 May 2017	114,949	0.00%
		Metropolitan Life Global Funding I 2.375% 30 September 2019	462,120	0.01%
440,000	EUR	MGM Resorts International 7.500% 01 June 2016	1,418,845	0.04%
1,740,000	USD	MGM Resorts International 7.625% 15 January 2017	1,508,542	0.05%
1,850,000	USD	Michael Foods Group Inc 9.750% 15 July 2018	759,426	0.02%
900,000	USD	Michael Foods Holding Inc 8.500% 15 July 2018	193,924	0.01%
250,000	USD	Micron Technology Inc	1,017,709	0.03%
219,379	USD	Microsoft Corp	435,082	0.01%
21,654	USD	Mobile Mini Inc 7.875% 01 December 2020	45,889	0.00%
55,000	USD	Mondelez International Inc	291,904	0.01%
15,270	USD	Mondelez International Inc 6.250% 20 March 2015	181,802	0.01%
163,000	EUR	Monster Beverage Corp	935,487	0.03%
23,827	EUR	Morgan Stanley 4.500% 29 October 2014	211,304	0.01%
200,000	EUR	Morgan Stanley 4.000% 17 November 2015	77,621	0.00%
73,000	EUR	Morgan Stanley 4.500% 23 February 2016	968,922	0.03%
900,000	GBP	Morgan Stanley 5.750% 14 February 2017	541,107	0.02%
400,000	EUR	Morgan Stanley 3.750% 21 September 2017	136,581	0.00%
128,000	EUR	Morgan Stanley 5.500% 02 October 2017	498,272	0.02%
437,000	EUR	Morgan Stanley 5.375% 10 August 2020	227,856	0.01%
200,000	USD	National Oilwell Varco Inc	1,374,344	0.04%
27,566	USD	Newfield Exploration Co 5.625% 01 July 2024	966,670	0.03%
1,180,000	USD	NPC International Inc 10.500% 15 January 2020	1,547,289	0.05%
1,755,000	USD	NRG Energy Inc 8.250% 01 September 2020	813,063	0.02%
955,000	USD	Occidental Petroleum Corp	343,017	0.01%
6,013	USD	ON Semiconductor Corp	1,199,234	0.04%
231,337	USD	Oracle Corp	585,163	0.02%
23,417	USD	Orbital Sciences Corp	78,322	0.00%
7,805	USD	Pall Corp	1,399,729	0.04%
30,997	USD	Peabody Energy Corp 6.250% 15 November 2021	945,196	0.03%
1,170,000	GBP	Pemex Project Funding Master Trust 7.500% 18 December 2013	683,097	0.02%
526,000	EUR	Pemex Project Funding Master Trust 6.375% 05 August 2016	447,613	0.01%
385,000	EUR	Pemex Project Funding Master Trust 5.500% 24 February 2025	56,228	0.00%
49,000	USD	Penn National Gaming Inc	307,260	0.01%
8,380	USD	PepsiCo Inc	292,229	0.01%
5,677	USD	Pfizer Inc	1,039,099	0.03%
55,165	EUR	Pfizer Inc 5.750% 03 June 2021	261,668	0.01%
200,000	USD	Philip Morris International Inc	1,056,305	0.03%
16,888	EUR	Philip Morris International Inc 2.125% 30 May 2019	196,797	0.01%
190,000	USD	Pinnacle Entertainment Inc 8.750% 15 May 2020	335,010	0.01%
408,000	USD	Pioneer Natural Resources Co 7.500% 15 January 2020	308,864	0.01%
321,000	USD	Plains Exploration & Production Co 7.625% 01 April 2020	600,094	0.02%
708,000	USD	Polycom Inc	676,589	0.02%
85,554	USD	Precision Castparts Corp	1,614,054	0.05%
11,479	USD	priceline.com Inc	702,239	0.02%
1,524	USD	Procter & Gamble Co	326,097	0.01%
6,417	EUR	Procter & Gamble Co/The 2.000% 16 August 2022	130,579	0.00%
130,000	USD	Production Resource Group Inc 8.875% 01 May 2019	645,229	0.02%
1,160,000	USD	Prologis Inc	3,724,498	0.11%
137,588	USD	Public Storage	3,320,206	0.10%
30,582	USD	Qualcomm Inc	579,638	0.02%
12,637	USD	Quicksilver Resources Inc 9.125% 15 August 2019	144,946	0.00%
214,000	GBP	Rabobank Capital Funding Trust IV FRN 31 December 2019	311,723	0.01%
253,000	USD	Regions Bank 7.500% 15 May 2018	1,577,952	0.05%
1,725,000	USD	Reynolds Group Issuer Inc 8.500% 15 May 2018	450,071	0.01%
576,000	USD	Reynolds Group Issuer Inc 7.875% 15 August 2019	1,750,275	0.05%
2,065,000	USD	Rite Aid Corp 7.500% 01 March 2017	1,791,247	0.05%
2,298,000	USD	Rite Aid Corp 9.250% 15 March 2020	1,180,743	0.04%
1,465,000	GBP	Roche Holdings Inc 5.500% 04 March 2015	60,341	0.00%
45,000	USD	Salesforce.com Inc	342,303	0.01%
2,755	USD	SandRidge Energy Inc 8.750% 15 January 2020	1,401,022	0.04%
1,683,000	USD	Schlumberger Ltd	509,883	0.02%
9,914	USD	Service Corp International/US 7.625% 01 October 2018	90,435	0.00%
100,000	USD	Service Corp International/US 7.000% 15 May 2019	399,501	0.01%
481,000	USD	Service Corp International/US 4.500% 15 November 2020	134,754	0.00%
175,000	USD	Service Corp International/US 8.000% 15 November 2021	1,060,397	0.03%
1,130,000	USD	ServiceMaster Co/TN 7.000% 15 August 2020	472,721	0.01%
620,000	USD	Simon Property Group Inc	9,139,633	0.28%
77,407	USD	Sky Growth Acquisition Corp 7.375% 15 October 2020	529,744	0.02%
700,000	USD	SL Green Realty Corp	5,986,676	0.18%
104,598	USD	SolarWinds Inc	166,744	0.00%
4,285	USD	Sprint Capital Corp 6.875% 15 November 2028	1,466,540	0.04%
1,850,000	USD	Sprint Nextel Corp	490,827	0.01%
115,817	USD	Sprint Nextel Corp 9.125% 01 March 2017	201,350	0.01%
225,000	USD	Sprint Nextel Corp 8.375% 15 August 2017	1,415,428	0.04%
1,602,000	USD	Sprint Nextel Corp 7.000% 15 August 2020	1,328,902	0.04%
1,600,000	USD	Sprint Nextel Corp 6.000% 15 November 2022	1,640,883	0.05%
2,100,000	USD	Starbucks Corp	1,414,006	0.04%
35,495	USD	Starwood Hotels & Resorts Worldwide Inc	4,311,300	0.13%
101,477	USD	Stryker Corp	412,848	0.01%
10,019	USD			

訂正有価証券届出書 (内国投資信託受益証券)

1,853,000	USD	SunGard Data Systems Inc 7.625% 15 November 2020	1,542,540	0.05%
12,803	USD	SunTrust Banks Inc	269,258	0.01%
760,000	USD	SUPERVALU Inc 7.500% 15 November 2014	560,772	0.02%
660,000	USD	SUPERVALU Inc 8.000% 01 May 2016	478,246	0.01%
333,000	EUR	Swiss Re Treasury US Corp 7.000% 19 May 2014	361,704	0.01%
6,157	USD	Target Corp	272,906	0.01%
501,000	USD	Tenet Healthcare Corp 10.000% 01 May 2018	433,174	0.01%
11,739	USD	Time Warner Cable Inc	845,561	0.03%
626,000	GBP	Time Warner Cable Inc 5.750% 02 June 2031	909,795	0.03%
40,286	USD	TJX Cos Inc	1,268,892	0.04%
9,629	USD	TransDigm Group Inc	969,537	0.03%
775,000	USD	TransUnion Holding Co Inc 9.625% 15 June 2018	623,159	0.02%
445,000	USD	TransUnion Holding Co Inc 8.125% 15 June 2018	349,395	0.01%
600,000	USD	Triumph Group Inc 8.625% 15 July 2018	506,284	0.02%
1,491,912	USD	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 02 July 2022	1,213,724	0.04%
5,571	USD	Union Pacific Corp	520,846	0.02%
1,380,000	USD	United Rentals North America Inc 5.750% 15 July 2018	1,130,512	0.03%
620,000	USD	United Rentals North America Inc 7.625% 15 April 2022	526,679	0.02%
		United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.375% 15 April 2032	1,399,976	0.04%
1,993,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15 April 2013	1,648,832	0.05%
1,815,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.875% 15 July 2013	1,758,464	0.05%
990,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.000% 15 January 2014	968,426	0.03%
25,910,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15 April 2015	21,848,850	0.66%
10,965,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.875% 15 July 2015	10,765,120	0.33%
3,000,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15 April 2016	2,506,033	0.08%
13,196,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15 January 2017	13,319,052	0.40%
238,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.625% 15 January 2018	230,913	0.01%
22,198,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15 July 2018	20,999,399	0.64%
2,076,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.875% 15 July 2019	2,075,439	0.06%
2,622,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15 January 2020	2,521,244	0.08%
9,423,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15 July 2020	8,993,953	0.27%
7,250,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.125% 15 January 2021	6,833,486	0.21%
4,136,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15 July 2021	3,662,476	0.11%
11,870,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15 January 2022	10,002,820	0.30%
7,537,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15 January 2025	9,501,448	0.29%
3,828,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15 January 2027	4,611,618	0.14%
4,608,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.750% 15 January 2028	5,020,687	0.15%
5,465,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.875% 15 April 2029	9,717,219	0.30%
5,471,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15 February 2040	6,573,962	0.20%
2,561,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15 February 2041	3,059,798	0.09%
1,460,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15 February 2042	1,256,232	0.04%
576,992	USD	US Airways 2001-1G Pass Through Trust 7.076% 20 March 2021	454,121	0.01%
551,941	USD	US Airways 2011-1 Class A Pass Through Trust 7.125% 22 October 2023	469,908	0.01%
845,000	USD	Valeant Pharmaceuticals International 6.750% 01 October 2017	693,833	0.02%
1,112,000	USD	Valeant Pharmaceuticals International 6.750% 15 August 2021	904,652	0.03%
234,000	USD	Vector Group Ltd 11.000% 15 August 2015	185,277	0.01%
171,000	USD	Verso Paper Holdings LLC / Verso Paper Inc 8.750% 01 February 2019	50,470	0.00%
17,197	USD	Virgin Media Inc	473,851	0.01%
2,159,000	USD	Visant Corp 10.000% 01 October 2017	1,470,495	0.04%
200,000	EUR	Wachovia Corp 4.375% 01 August 2016	224,782	0.01%
100,000	EUR	Wachovia Corp 4.375% 27 November 2018	111,342	0.00%
1,017,000	GBP	Wal-Mart Stores Inc 5.625% 27 March 2034	1,600,024	0.05%
55,776	USD	Walt Disney Co	2,074,623	0.06%
13,007	USD	Wells Fargo & Co	333,790	0.01%
760,000	EUR	Wells Fargo & Co 2.625% 16 August 2022	787,849	0.02%
500,000	GBP	Wells Fargo & Co 4.875% 29 November 2035	621,446	0.02%
600,000	GBP	Wells Fargo Bank NA 5.250% 01 August 2023	844,914	0.03%
24,128	USD	Wesco Aircraft Holdings Inc	240,478	0.01%
150,000	USD	West Corp 7.875% 15 January 2019	118,057	0.00%
517,000	USD	Westvaco Corp 8.200% 15 January 2030	520,321	0.02%
464,000	USD	Windstream Corp 7.875% 01 November 2017	397,672	0.01%
3,870,000	USD	Windstream Corp 7.750% 01 October 2021	3,184,992	0.10%
		米國合計	466,239,956	14.13%

取引所上場を認められた譲渡可能証券及び短期金融商品合計

1,566,582,867 47.64%

オープンエンド型投資信託

157,812,546	英ポンド	Standard Life Investments European Equity Income Fund	154,732,446	4.71%
オープンエンド型投資信託合計			154,732,446	4.71%
取引所上場を認められたもの以外の譲渡可能証券及び短期金融商品				
オーストラリア				
1,740,000	USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd 8.250% 01 November 2019	1,408,969	0.04%
290,000	USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd 6.875% 01 April 2022	225,775	0.01%
923,000	AUD	New South Wales Treasury Corp 2.750% 20 November 2025	945,130	0.03%
		オーストラリア合計	2,579,874	0.08%
オーストリア				
1,550,000	USD	OGX Austria GmbH 8.500% 01 June 2018	1,064,502	0.03%
600,000	USD	Sappi Papier Holding GmbH 6.625% 15 April 2021	449,526	0.01%
		オーストリア合計	1,514,028	0.04%
バミューダ				
1,260,000	USD	Digicel Group Ltd 8.250% 30 September 2020	1,053,661	0.03%
		バミューダ合計	1,053,661	0.03%
カナダ				
480,000	USD	Ainsworth Lumber Co Ltd 7.500% 15 December 2017	381,870	0.01%
2,920,000	CAD	Canadian Government Bond 4.250% 01 December 2021	4,609,100	0.14%
626,000	CAD	Canadian Government Bond 4.250% 01 December 2026	1,063,440	0.03%
2,935,000	CAD	Canadian Government Bond 4.000% 01 December 2031	5,176,493	0.16%
881,000	CAD	Canadian Government Bond 2.000% 01 December 2041	1,066,395	0.03%
200,000	USD	First Quantum Minerals Ltd 7.250% 15 October 2019	153,815	0.00%
1,370,000	USD	HudBay Minerals Inc 9.500% 01 October 2020	1,102,880	0.03%
1,410,000	USD	Inmet Mining Corp 8.750% 01 June 2020	1,168,428	0.04%
		カナダ合計	14,722,421	0.44%
ケイマン諸島				
700,000	USD	Shelf Drilling Holdings Ltd 8.625% 01 November 2018	545,637	0.02%
		ケイマン諸島合計	545,637	0.02%
欧州連合				
25,000,000	EUR	Abbey 0.070% 11 February 2013	24,999,980	0.76%
25,000,000	EUR	Abbey 0.100% 11 January 2013	25,000,498	0.76%
25,000,000	EUR	Abbey 0.100% 16 January 2013	25,000,681	0.76%
60,000,000	EUR	Barclays 0.000% 09 January 2013	59,999,656	1.83%
40,000,000	EUR	Barclays 0.190% 12 April 2013	40,005,634	1.22%
30,000,000	EUR	Barclays 0.200% 16 May 2013	30,002,923	0.91%
30,000,000	EUR	Barclays 0.380% 25 February 2013	30,013,175	0.91%
30,000,000	EUR	BNP Paribas 0.430% 06 March 2013	30,017,399	0.91%
25,000,000	EUR	Caylon 0.435% 04 March 2013	25,014,347	0.76%
15,000,000	EUR	Caylon 0.440% 27 March 2013	15,011,163	0.46%
40,000,000	EUR	Caylon 0.850% 07 January 2013	40,005,511	1.22%
25,000,000	EUR	Danske Bank 0.150% 12 February 2013	25,002,267	0.76%
35,000,000	EUR	Deutsche Bank 0.0170% 02 April 2013	34,988,465	1.06%
50,000,000	EUR	Deutsche Bank 0.0175% 06 June 2013	49,957,399	1.52%
10,100,000	EUR	ICAP 0.200% 28 February 2013	10,101,675	0.31%
61,000,000	EUR	ICAP 0.300% 17 January 2013	61,007,162	1.86%
45,000,000	EUR	ING Bank 0.320% 02 May 2013	45,024,383	1.37%
25,000,000	EUR	ING Bank 0.770% 04 September 2013	25,079,633	0.76%
20,000,000	EUR	ING Bank 0.920% 02 August 2013	20,077,833	0.61%
50,000,000	EUR	KBC Bank NV 0.160% 28 February 2013	50,005,071	1.52%
10,000,000	EUR	SLIF 0.620% 24 September 2013	10,021,741	0.30%
50,000,000	EUR	Societe Generale 0.090% 31 January 2013	50,001,513	1.52%
40,000,000	EUR	Societe Generale 0.740% 01 January 2013	40,023,579	1.22%
50,000,000	EUR	Sumi 0.090% 06 Feb 2013	50,001,351	1.52%
25,000,000	EUR	Svenska 0.170% 20 May 2013	24,999,192	0.76%
40,000,000	EUR	Svenska 0.200% 15 February 2013	40,006,151	1.22%
		欧州連合合計	881,368,382	26.81%
アイルランド				
1,095,000	USD	Ardagh Packaging Finance Plc 9.125% 15 October 2020	907,394	0.03%
		アイルランド合計	907,394	0.03%
日本				
13,000,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.100% 10 June 2014	116,194	0.00%
97,700,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 0.800% 10 September 2015	887,412	0.03%
30,100,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.100% 10 December 2016	282,096	0.01%
126,800,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.400% 10 March 2018	1,210,620	0.04%
328,600,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.400% 10 June 2018	3,147,141	0.10%
		日本合計	5,643,463	0.18%
ルクセンブルグ				
100,000	EUR	Boardriders SA 8.875% 15 December 2017	105,500	0.00%
1,033,000	USD	Expro Finance Luxembourg SCA 8.500% 15 December 2016	820,839	0.03%
1,068,325	USD	Wind Acquisition Holdings Finance SA 12.250% 15 July 2017	953,219	0.03%
989,000	USD	Wind Acquisition Finance SA 11.750% 15 July 2017	946,206	0.03%
		ルクセンブルグ合計	2,825,764	0.09%
オランダ				
581,026	EUR	Boats Investments Netherlands BV 11.000% 31 March 2017	320,662	0.01%
106,000	USD	NXP BV / NXP Funding LLC 9.750% 01 August 2018	93,354	0.00%
		オランダ合計	414,016	0.01%
ニュージーランド				

訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

2,260,000	NZD	New Zealand Government Bond 2.000% 20 September 2025 ニュージーランド合計	1,516,352 1,516,352	0.05% 0.05%
1,235,000	USD	スペイン Cemex Espana Luxembourg 9.250% 12 May 2020 スペイン合計	1,021,073 1,021,073	0.03% 0.03%
108,000	GBP	英国 Bg Energy Capital Plc 6.500% 30 November 2072	143,045	0.00%
46,106	GBP	Prestbury Investments Limited	-	-
300,000	USD	Standard Chartered Plc 3.200% 12 May 2016 英国合計	238,936 381,981	0.01% 0.01%
1,150,000	USD	米国 313 Group Inc 6.375% 01 December 2019	867,031	0.03%
790,000	USD	313 Group Inc 8.750% 01 December 2020	590,381	0.02%
115,000	USD	Aleris International Inc 7.875% 01 November 2020	87,356	0.00%
556,000	USD	Ashland Inc 4.750% 15 August 2022	437,599	0.01%
1,450,000	USD	Atlas Pipeline Partners LP / Atlas Pipeline Finance Corp 6.625% 01 October 2020	1,146,707	0.04%
1,985,000	USD	BOE Merger Corp 9.500% 01 November 2017	1,509,714	0.05%
2,466,000	USD	Calpine Corp 7.875% 31 July 2020	2,104,156	0.06%
3,635,000	USD	Casella Waste Systems Inc 7.750% 15 February 2019	2,627,097	0.08%
930,000	USD	Cequel Communications Holdings I LLC / Cequel Capital Corp 6.375% 15 September 2020	733,715	0.02%
176,000	USD	Chesapeake Oilfield Operating LLC / Chesapeake Oilfield Finance Inc 6.625% 15 November 2019	126,200	0.00%
1,095,000	USD	EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance Inc 7.750% 01 September 2022	882,535	0.03%
800,000	USD	First Data Corp 8.250% 15 January 2021	608,449	0.02%
1,130,000	USD	First Data Corp 8.750% 15 January 2022	878,676	0.03%
250,000	USD	Halcon Resources Corp 8.875% 15 May 2021	201,965	0.01%
1,405,000	USD	Halcon Resources Corp 9.750% 15 July 2020	1,153,651	0.04%
780,000	USD	Hiland Partners LP / Hiland Partners Finance Corp 7.250% 01 October 2020	634,558	0.02%
1,425,000	EUR	Infor US Inc 10.000% 01 April 2019	1,596,000	0.05%
350,000	USD	Level 3 Communications Inc 8.875% 01 June 2019	283,744	0.01%
1,300,000	USD	Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp 6.250% 01 November 2019	993,649	0.03%
330,000	USD	Longview Fibre Paper & Packaging Inc 8.000% 01 June 2016	263,784	0.01%
1,118,000	USD	Midstates Petroleum Co Inc / Midstates Petroleum Co LLC 10.750% 01 October 2020	903,188	0.03%
97,000	EUR	Millipore Corp 5.875% 30 June 2016	112,911	0.00%
890,000	USD	NRG Energy Inc 6.625% 15 March 2023	724,047	0.02%
1,000,000	USD	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp 8.250% 15 January 2021	777,589	0.02%
815,000	EUR	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp 8.500% 15 January 2021	846,581	0.03%
510,000	USD	Sealed Air Corp 6.500% 01 December 2020	418,763	0.01%
1,010,000	USD	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 10.500% 31 January 2020	829,315	0.03%
250,000	USD	Taminco Global Chemical Corp 9.750% 31 March 2020	207,641	0.01%
730,000	USD	Tekni-Piex Inc 9.750% 01 June 2019	606,311	0.02%
1,415,000	USD	Tronox Finance LLC 6.375% 15 August 2020	1,085,564	0.03%
2,546,000	USD	Univision Communications Inc 7.875% 01 November 2020	2,095,347	0.06%
1,021,000	GBP	Wells Fargo & Co 4.625% 02 November 2035 米国合計	1,366,272 27,700,496	0.04% 0.86%

取引所上場を認められたもの以外の譲渡可能証券及び短期金融商品合計

942,194,542 28.68%

投資有価証券合計

2,663,509,855 81.03%

現金及び現金同等物

607,116,540 18.47%

当座貸越及びその他の純資産

16,488,291 0.50%

純資産総額

3,287,114,686 100.00%

純資産に占める割合(%)による投資有価証券の分析

取引所上場を認められた譲渡可能証券及び短期金融商品 49.50%

取引所上場を認められたもの以外の譲渡可能証券及び短期金融商品 27.10%

その他の資産 23.40%

純資産総額 100.00%

[次へ](#)

2 ファンドの現況

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「2 ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

純資産額計算書(平成25年6月28日現在)

資産総額	13,908,982,269 円
負債総額	221,225,698 円
純資産総額(-)	13,687,756,571 円
発行済口数	13,325,945,768 口
1口当たり純資産額(/)	1.0272 円
1万口当たり純資産額	10,272 円

(参考情報)

短期金融資産 マザーファンド

資産総額	3,698,873,346 円
負債総額	101,147,000 円
純資産総額(-)	3,597,726,346 円
発行済口数	3,550,948,209 口
1口当たり純資産額(/)	1.0132 円
1万口当たり純資産額	10,132 円

第3【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

(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1期中間計算期間(平成24年12月4日から平成25年6月3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。

SLI GARSファンド(SMA専用) 中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

項目	第1期中間計算期間 (平成25年 6月 3日現在) 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	372,798,599
投資証券	12,588,376,362
親投資信託受益証券	10,004
未収利息	537
流動資産合計	12,961,185,502
資産合計	12,961,185,502
負債の部	
流動負債	
未払金	294,000,000
未払解約金	24,653,050
未払受託者報酬	1,642,721
未払委託者報酬	11,498,953
その他未払費用	164,215
流動負債合計	331,958,939
負債合計	331,958,939
純資産の部	
元本等	
元本	11,978,259,165
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	650,967,398
元本等合計	12,629,226,563
純資産合計	12,629,226,563
負債純資産合計	12,961,185,502

(2)中間損益及び剰余金計算書

項目	第1期中間計算期間	
	自 平成24年12月 4日 至 平成25年 6月 3日 金額(円)	
営業収益		
受取利息		125,993
有価証券売買等損益		289,396,366
営業収益合計		289,522,359
営業費用		
受託者報酬		1,642,721
委託者報酬		11,498,953
その他費用		164,215
営業費用合計		13,305,889
営業利益又は営業損失（ ）		276,216,470
経常利益又は経常損失（ ）		276,216,470
中間純利益又は中間純損失（ ）		276,216,470
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（ ）		25,513,200
剰余金増加額又は欠損金減少額		417,537,267
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		417,537,267
剰余金減少額又は欠損金増加額		17,273,139
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		17,273,139
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		650,967,398

(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>(2)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. その他	<p>ファンドの計算期間 第1期中間計算期間(自 平成24年12月 4日 至 平成25年 6月 3日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月11日から翌年10月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は設定日(平成24年12月 4日)から平成25年10月10日までとなっており、第1期中間計算期間は設定日(平成24年12月 4日)から平成25年 6月 3日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期中間計算期間 (平成25年 6月 3日現在)	
1. 期首元本額		1,000,000円

期中追加設定元本額	13,123,256,032円
期中一部解約元本額	1,145,996,867円
2. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	11,978,259,165口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0543円 (10,543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

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	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)投資証券及び親投資信託受益証券 「(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。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

<参考>

「SLI GARSファンド(SMA専用)」は、「短期金融資産 マザーファンド」の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」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成25年6月3日現在(以下、「計算日」といいます。)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。

「短期金融資産 マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 6月 3日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	

コール・ローン	9,747,264
国債証券	3,120,616,300
特殊債券	346,541,450
未収利息	8,498,677
前払費用	2,491,196
流動資産合計	3,487,894,887
資産合計	3,487,894,887
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,000
流動負債合計	20,000
負債合計	20,000
純資産の部	
元本等	
元本	3,442,470,238
剰余金	
剰余金又は欠損金()	45,404,649
元本等合計	3,487,874,887
純資産合計	3,487,874,887
負債純資産合計	3,487,894,887

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 6月 3日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券 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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 6月 3日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	2,409,308,694円
中間計算期間中の追加設定元本額	1,051,850,795円
中間計算期間中の一部解約元本額	18,689,251円
計算日の元本額	3,442,470,238円
計算日の元本額の内訳	
TCAグローバル・キャピタルファンド(毎月決算型)	98,805円
グローバルCBファンド・ブラジルリアルコース(毎月分配型)	11,097,935円
グローバルCBファンド・豪ドルコース(毎月分配型)	2,037,530円
グローバルCBファンド・南アフリカランドコース(毎月分配型)	622,592円
グローバルCBファンド・資源国通貨コース(毎月分配型)	1,590,189円
グローバルCBファンド・米ドルコース(毎月分配型)	128,472円
グローバルCBファンド・円コース(毎月分配型)	1,136,037円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	205,751,057円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	30,863,087円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	22,178,169円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	7,835,665円

TCAファンド(SMA専用)	4,985,175円
バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	3,110,989,655円
FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	10,161,266円
ブラジル国債ファンド(毎月分配型)	20,843,273円
ブラジル国債ファンド(年2回決算型)	1,540,321円
SLI GARSファンド(SMA専用)	9,874円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
新興国社債ファンド(為替ヘッジなし)(毎月決算型)	9,874円
新興国社債ファンド(為替ヘッジあり)(毎月決算型)	9,874円
ヨーロッパ高配当株オープン(毎月決算型)	9,871円
アメリカ高配当株オープン(毎月決算型)	493,535円
アメリカ高配当株オープン(年2回決算型)	197,414円
2. 計算日における受益権総数	3,442,470,238口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0132円 (10,132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25年 6月 3日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)国債証券及び特殊債券 「(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。

(有価証券に関する注記)

平成25年 6月 3日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成25年 6月 3日現在
当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

[次へ](#)

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

原届出書の「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」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 資本金の額（平成24年9月28日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

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。

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は平成24年11月16日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1) 資本金の額（平成25年6月28日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

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、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。

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は平成25年9月3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

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

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24年9月28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	<u>299</u>	<u>3,593,841</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>5</u>	<u>622</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>304</u>	<u>3,594,462</u>

<訂正後>

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25年6月28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	<u>317</u>	<u>4,352,908</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>2</u>	<u>180</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>319</u>	<u>4,353,089</u>

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

(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。）第2条に基づき、同規則及び「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。

(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、当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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。

[次へ](#)

(1)貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)		当事業年度 (平成25年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		4,826,115		8,192,444
前払費用		30,184		81,751
未収委託者報酬		944,716		2,210,605
未収運用受託報酬		26,998		31,051
未収入金		75,514		676
一年以内返還予定保証金		187,128		-
繰延税金資産		69,857		61,743
その他		31,325		19,263
流動資産合計		6,191,840		10,597,535
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	3,525	1	79,281
器具備品	1	14,970	1	103,209
建設仮勘定		62,454		-
有形固定資産合計		80,949		182,491
無形固定資産				
ソフトウェア		60,130		168,561
ソフトウェア仮勘定		12,151		-
その他無形固定資産		928		1,770
無形固定資産合計		73,209		170,332
投資その他の資産				
投資有価証券		43,194		47,112
長期前払費用		357		-
長期貸付金		-		31,838
会員権		-		25,000
その他の投資		165		633
貸倒引当金		-		31,838
投資その他の資産合計		43,717		72,746
固定資産合計		197,876		425,570
資産合計		6,389,717		11,023,105

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)		当事業年度 (平成25年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				

預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	-
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	-
その他流動負債	-	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	-	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	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	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	9,859	4,998
評価・換算差額等合計	9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410
負債・純資産合計	6,389,717	11,023,105

(2)損益計算書

(単位：千円)

前事業年度	当事業年度
(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

営業収益			
委託者報酬	7,821,113	19,128,296	
運用受託報酬	98,179	94,659	
営業収益合計	7,919,292	19,222,955	
営業費用			
支払手数料	3,715,816	9,030,246	
広告宣伝費	61,165	73,287	
公告費	2,451	2,244	
調査費	1,023,870	4,132,154	
調査費	86,225	207,030	
委託調査費	936,024	3,922,394	
図書費	1,620	2,729	
営業雑経費	610,455	1,294,879	
通信費	10,764	21,905	
印刷費	121,287	330,735	
協会費	10,136	21,939	
諸会費	803	757	
情報機器関連費	436,328	874,151	
その他営業雑経費	31,135	45,391	
営業費用合計	5,413,759	14,532,812	
一般管理費			
給料	1,276,685	2,259,238	
役員報酬	35,160	78,205	
給料・手当	1,048,061	1,967,177	
賞与	193,464	213,855	
退職給付費用	66,790	64,787	
福利費	152,149	190,716	
交際費	1,012	879	
旅費交通費	25,687	45,160	
租税公課	16,148	25,420	
不動産賃借料	238,033	129,096	
寄付金	2,832	-	
減価償却費	55,540	129,966	
敷金償却	2,804	-	
諸経費	81,858	1	257,947
一般管理費合計	1,919,541	3,103,213	
営業利益	585,991	1,586,929	

(単位：千円)

前事業年度

(自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日)

当事業年度

(自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日)

営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	-	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	-
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

(3)株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	3,019,410	-
その他利益剰余金より振替	3,019,410	-
合併による増加	-	350,000
当期変動額合計	-	350,000
当期末残高	-	350,000

利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	53,500	56,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	3,000,000	-
当期変動額合計	3,000,000	-
当期末残高	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
別途積立金より振替	3,000,000	-
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
自己株式		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	3,019,410	-
自己株式の消却	3,019,410	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
株主資本合計		
当期首残高	6,874,705	4,972,773
当期変動額		

剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
当期変動額合計	1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

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。）

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。

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

(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、当期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、当期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。

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24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
建 物	84,592	千円	23,594	千円
器具備品	127,549	"	235,212	"
計	212,142	"	258,807	"

(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23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
諸経費		千円	97,199	千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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）	6,000	-	3,000	3,000

(注) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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	-

(注) (1) 普通株式の増加は、平成24年2月21日付株主総会決議に基づく自己株式の取得による増加であります。

(2) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29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25年6月28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通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25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

(リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

(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24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	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(*)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25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	8,192,444	8,192,444	-
(2)未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
(4)未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

(*)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、及び(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

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) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24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	4,826,115	-	-	-
未収委託者報酬	944,716	-	-	-

当事業年度（平成25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	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	7,002	7,440	437
小計	7,002	7,440	437
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,511	35,754	15,756
小計	51,511	35,754	15,756
合計	58,513	43,194	15,318

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	37,315	45,159	7,843
小計	37,315	45,159	7,843
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,030	1,952	77
小計	2,030	1,952	77
合計	39,345	47,112	7,766

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23年4月1日 至 平成24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
1,483,441	1,277,954	12

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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
114,040	30,924	14,182

（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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
(1) 退職給付債務	199,976	268,531
(2) 退職給付引当金	199,976	268,531

(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。

(注) 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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
(1) 退職給付費用	66,790	64,787

(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。

(注) 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12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	4,898 千円	16,142 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	- "	11,347 "
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004 "	35,285 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271 "	95,704 "
その他有価証券評価差額金	5,459 "	- "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額	15,755 "	- "
減価償却超過額	12,745 "	1,067 "
敷金償却超過額	19,348 "	- "
その他	3,334 "	11,680 "
繰延税金資産 小計	159,817 "	171,228 "
評価性引当額	- "	11,347 "
繰延税金資産 合計	159,817 "	159,881 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	- "	2,767 "
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925 "	398,925 "
繰延税金負債 合計	398,925 "	401,693 "
繰延税金資産(負債)の純額	239,107 "	241,812 "

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

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.69 %	- %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.14 "	- "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	2.30 "	- "
その他	0.49 "	- "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.73 "	- "

当事業年度は法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（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

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

（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おります。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

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

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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)
----	----------------	-----	-----------------------	-------------------	--------------------	-------------------	-----------	--------------	----	--------------

親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	-	-
-----	----------------------	---------	---------	------	----------	-------	-----------	--------	---	---

(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りません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

投資有価証券の譲渡価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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)
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	-	-

(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りません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

(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23年4月1日 至 平成24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	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	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	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産仲介業務	-	-	投資有価証券の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジットカード業務	-	-	投資有価証券の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュータ関連業務	-	-	投資有価証券の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の取得	301,941	-	-

(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。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

投資有価証券及び自己株式の譲渡価格及び取得価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

(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。

3. 平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード(株)	三井住友トラスト・カード(株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム&サービス(株)	東京都府中市

(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24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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成25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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(企業結合等関係)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2)企業結合日

平成24年4月1日

(3)企業結合の法的形式

当社を吸収合併継続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

2.実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31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おりません。

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

[次へ](#)

5 その他

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「5 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 定款の変更

委託会社は、平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成24年11月16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。

<訂正後>

(1) 定款の変更

委託会社は、平成25年4月1日に取締役の役位としての会長を削除しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成25年9月3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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

(注) 下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1)受託会社

(中略)

資本金の額：342,037百万円（平成24年4月1日現在）

(中略)

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年4月1日現在）	事業の内容

(中略)

3 資本関係

(中略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成24年3月末日現在）

(後略)

<訂正後>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1)受託会社

(中略)

資本金の額：342,037百万円（平成25年3月末日現在）

(中略)

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年3月末日現在）	事業の内容

(中略)

3 資本関係

(中略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成25年3月末日現在）

(後略)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年8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SLI GARSファンド（SMA専用）の平成24年12月4日から平成25年6月3日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SLI GARSファンド（SMA専用）の平成25年6月3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24年12月4日から平成25年6月3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

-
- 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．中間財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7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	高波博之 印
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	伊藤浩之 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、「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24年4月1日から平成25年3月31日までの第27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25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

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。