

【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5月2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・レポートイング部長 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の名称】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【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 分散投資コア戦略ファンドA 100万円 分散投資コア戦略ファンドS 100万円 継続募集額 分散投資コア戦略ファンドA 上限10兆円 分散投資コア戦略ファンドS 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】

平成25年3月12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

(1) ファンドの目的及び基本的性格

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」「(1) ファンドの目的及び基本的性格」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。

ファンドの特色

<訂正前>

（前略）

2. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- ファンドに組み入れる資産及び投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 資産・投資対象ファンドの投資割合の決定及び投資対象ファンドの選定は、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行います。

（後略）

<訂正後>

（前略）

2. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- ファンドに組み入れる資産及び投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 資産・投資対象ファンドの投資割合の決定及び投資対象ファンドの選定は、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

（後略）

(3) ファンドの仕組み

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」「(3) ファンドの仕組み」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 >

（前略）

委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年1月31日現在）

ロ．（省略）

ハ．大株主の状況（平成25年1月31日現在）

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年2月28日現在）

ロ．（省略）

ハ．大株主の状況（平成25年2月28日現在）

（後略）

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訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

(1) 投資方針

< 訂正前 >

（前略）

投資態度

（中略）

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

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

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

投資態度

（中略）

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

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

（後略）

(2) 投資対象

<訂正前>

（前略）

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

- 投資対象ファンドの概要 -

当初設定時に投資対象ファンドとして予定しているファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

各投資対象ファンドのうち、「1」から「13」は、国内籍の契約型株式投資信託です。「14」は、外国籍円建投資信託証券です。「1」から「4」、「6」から「10」及び「12」は、委託会社が設定・運用を行う親投資信託です。

「5」及び「11」は、委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託です。「13」は、他の委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託です。「14」は、他の投資顧問会社が設定・運用を行う外国籍円建投資信託証券です。以下の内容は、平成25年3月12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。

（中略）

8. J-REITインデックス マザーファンド

（中略）

9. グローバルREITインデックス マザーファンド

（中略）

10. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

（中略）

11. TCAファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

12. FRM シグマ リンク マザーファンド

（中略）

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

（中略）

14. Global Absolute Return Strategies Fund- Class D^{A, H, JPY}

（後略）

<訂正後>

（前略）

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

- 投資対象ファンドの概要 -

投資対象ファンドとして予定しているファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

各投資対象ファンドのうち、「1」から「14」は、国内籍の契約型株式投資信託です。「15」は、外国籍円建投資信託証券です。「1」から「4」、「6」から「7」、「9」から「11」及び「13」は、委託会社が設定・運用を行う親投資信託です。「5」、「8」及び「12」は、委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託です。「14」は、他の委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託です。「15」は、他の投資顧問会社が設定・運用を行う外国籍円建投資信託証券です。以下の内容は、平成25年5月2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。

（中略）

8. FOFs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「米ドル建新興国債券インデックス マザーファンド」（以下本概要中において「マザーファンド」といいます。）の受益証券
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建の新興国債券に投資し、パークレイズ・US・エマージング・ソブリン・マキシマム・レイティング・インベストメント・グレイド・インデックス（円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果を目指します。 債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り、とし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 有価証券先物取引等は、投資信託約款第25条の範囲で行います。 スワップ取引は、投資信託約款第26条の範囲で行います。 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引は、投資信託約款第27条の範囲で行います。
ベンチマーク	パークレイズ・US・エマージング・ソブリン・マキシマム・レイティング・インベストメント・グレイド・インデックス（円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1)分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 (2)分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 (3)留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.063%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	平成25年5月2日
信託期間	原則として無期限
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「バークレイズ・US・エマージング・ソブリン・マキシマム・レイティング・インベストメント・グレイド・インデックス」とは、バークレイズ・バンク・ピーエルシー及び関連会社（以下「バークレイズ」）が開発、算出、公表を行うインデックスであり、新興国が発行する米ドル建ての国債のうち、バークレイズが定める基準により投資適格格付が付与されていることなどの一定の要件を満たす国債から構成されます。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。当該インデックスに関する知的財産権及びその他一切の権利はバークレイズに帰属します。

9. J-REITインデックス マザーファンド

（中略）

10. グローバルREITインデックス マザーファンド

（中略）

11. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

（中略）

12. TCAファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

13. FRM シグマ リンク マザーファンド

（中略）

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

（中略）

15. Global Absolute Return Strategies Fund- Class D^{A, H, JPY}

（後略）

(3) 運用体制

< 訂正前 >

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3月12日現在のものであり、今後変更されることがあります。

（後略）

< 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5月2日現在のものであり、今後変更されることがあります。

（後略）

(4) 分配方針

< 訂正前 >

分配方針

（中略）

収益の分配

（中略）

八．収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

<訂正後>

分配方針

（中略）

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

収益の分配

（中略）

八．収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。

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。

(3) 信託報酬等

<訂正前>

（前略）

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、換金（解約）手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
（中略）	（中略）
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
（中略）	（中略）

（後略）

<訂正後>

（前略）

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、換金（解約）手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
-------	------

（中略）	（中略）
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
<u>FOFs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり</u> <u>（適格機関投資家専用）</u>	<u>年率 0.063%</u> <u>（税抜 0.06%）</u>
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
（中略）	（中略）

（後略）

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の運用段階における課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

（中略）

上記は、平成25年1月31日現在のものですので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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>

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

（中略）

上記は、平成25年2月28日現在のものですので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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>

(1) 投資状況

当ファンドは、作成基準日（平成25年2月28日）現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

(2) 投資資産

当ファンドは、作成基準日（平成25年2月28日）現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

(3) 運用実績

当ファンドは、作成基準日（平成25年2月28日）現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

(4) 設定及び解約の実績

当ファンドは、作成基準日（平成25年2月28日）現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

(参考情報)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

(1) 投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	12,956,621,850	76.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,947,566,719	23.35
合計(純資産総額)		16,904,188,569	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

(平成25年2月28日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	東洋紡	繊維製品	1,935,000	136.67	264,457,864	167.00	323,145,000	1.91
日本	株式	日本電気	電気機器	1,257,000	208.20	261,715,552	229.00	287,853,000	1.70
日本	株式	パナソニック	電気機器	411,400	664.71	273,465,484	668.00	274,815,200	1.63
日本	株式	東海カーボン	ガラス・土石製品	606,000	340.57	206,385,540	321.00	194,526,000	1.15
日本	株式	富士電機	電気機器	621,000	211.90	131,590,927	265.00	164,565,000	0.97

日本	株式	昭和シェル石油	石油・石炭製品	239,100	589.09	140,852,833	671.00	160,436,100	0.95
日本	株式	東ソー	化学	612,000	208.28	127,467,775	252.00	154,224,000	0.91
日本	株式	花王	化学	51,900	2,505.83	130,052,709	2,964.00	153,831,600	0.91
日本	株式	富士通	電気機器	361,000	357.22	128,959,748	426.00	153,786,000	0.91
日本	株式	サッポロホールディングス	食料品	475,000	278.12	132,110,880	323.00	153,425,000	0.91
日本	株式	東京建物	不動産業	295,000	450.78	132,981,610	517.00	152,515,000	0.90
日本	株式	アサヒグループホールディングス	食料品	65,100	2,092.40	136,215,299	2,340.00	152,334,000	0.90
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	510,000	253.92	129,501,360	295.00	150,450,000	0.89
日本	株式	大日本住友製薬	医薬品	111,700	1,164.52	130,076,884	1,339.00	149,566,300	0.88
日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	36,200	3,574.96	129,413,887	4,095.00	148,239,000	0.88
日本	株式	高島屋	小売業	204,000	633.03	129,138,846	726.00	148,104,000	0.88
日本	株式	オークマ	機械	220,000	633.40	139,349,126	672.00	147,840,000	0.87
日本	株式	東急不動産	不動産業	210,000	629.05	132,100,730	700.00	147,000,000	0.87
日本	株式	東洋製罐	金属製品	108,700	1,208.56	131,371,454	1,347.00	146,418,900	0.87
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	496	265,098.92	131,489,069	294,300.00	145,972,800	0.86
日本	株式	クラレ	化学	115,700	1,131.27	130,888,005	1,260.00	145,782,000	0.86
日本	株式	マツダ	輸送用機器	514,000	258.27	132,753,757	279.00	143,406,000	0.85
日本	株式	小田急電鉄	陸運業	146,000	920.89	134,450,843	978.00	142,788,000	0.84
日本	株式	ソニー	電気機器	106,500	1,054.53	112,307,445	1,338.00	142,497,000	0.84
日本	株式	古河電気工業	非鉄金属	678,000	192.29	130,378,021	210.00	142,380,000	0.84
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	48,600	2,769.24	134,585,236	2,925.00	142,155,000	0.84
日本	株式	KDDI	情報・通信業	20,100	6,713.64	134,944,201	6,960.00	139,896,000	0.83
日本	株式	松井証券	証券・商品先物取引業	159,100	853.30	135,760,179	872.00	138,735,200	0.82
日本	株式	ジェイテクト	機械	146,300	790.54	115,656,002	924.00	135,181,200	0.80
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	253,500	529.77	134,298,386	532.00	134,862,000	0.80

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	76.65
合計	76.65

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.57
		鉱業	0.73
		建設業	0.44
		食料品	5.24
		繊維製品	2.34
		パルプ・紙	1.23
		化学	6.25

医薬品	2.61
石油・石炭製品	1.38
ゴム製品	0.47
ガラス・土石製品	3.12
鉄鋼	2.58
非鉄金属	3.19
金属製品	0.87
機械	5.99
電気機器	9.62
輸送用機器	5.43
精密機器	0.83
その他製品	0.83
電気・ガス業	0.39
陸運業	3.82
海運業	0.39
空運業	0.42
情報・通信業	3.75
卸売業	1.18
小売業	2.95
銀行業	2.06
証券、商品先物取引業	2.02
保険業	2.06
不動産業	3.07
サービス業	0.84
合計	76.65

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	181,638,662,800	76.82
	ポーランド	102,662,000	0.04
	小計	181,741,324,800	76.86
地方債証券	日本	15,442,293,419	6.53
特殊債券	日本	21,571,642,831	9.12
	アメリカ	209,096,000	0.09

	韓国	101,403,000	0.04
	スウェーデン	99,527,000	0.04
	小計	21,981,668,831	9.30
社債券	日本	14,679,848,450	6.21
	オーストラリア	408,384,000	0.17
	オランダ	405,560,000	0.17
	アメリカ	208,067,000	0.09
	イギリス	101,394,000	0.04
	スウェーデン	101,153,000	0.04
	韓国	100,070,000	0.04
	小計	16,004,476,450	6.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,284,464,342	0.54
合計(純資産総額)		236,454,227,842	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

(平成25年2月28日現在)

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325回利付国債(10年)	3,670,000,000	100.36	3,683,505,600	101.48	3,724,499,500	0.8	2022/09/20	1.58
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	2,940,000,000	100.05	2,941,540,300	100.42	2,952,553,800	0.2	2017/06/20	1.25
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	2,820,000,000	100.96	2,847,122,800	100.81	2,843,039,400	0.5	2014/12/20	1.20
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	2,570,000,000	101.04	2,596,931,800	100.92	2,593,875,300	0.5	2015/03/20	1.10
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	2,390,000,000	107.05	2,558,495,000	106.48	2,545,015,400	1.7	2017/03/20	1.08
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	2,440,000,000	100.11	2,442,737,400	100.40	2,449,930,800	0.2	2017/09/20	1.04
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,230,000,000	106.97	2,385,557,000	107.42	2,395,622,100	1.5	2018/09/20	1.01
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	2,300,000,000	100.95	2,322,062,400	101.13	2,326,036,000	0.4	2016/09/20	0.98
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	107.45	2,245,861,100	107.21	2,240,877,100	1.7	2017/09/20	0.95
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,010,000,000	105.76	2,125,933,500	106.76	2,146,036,800	1.3	2019/12/20	0.91
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	1,980,000,000	101.64	2,012,472,000	103.86	2,056,487,400	1.0	2021/12/20	0.87
日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	1,960,000,000	100.80	1,975,838,400	101.28	1,985,244,800	0.8	2022/12/20	0.84
日本	国債証券	第96回利付国債(5年)	1,910,000,000	101.34	1,935,720,000	101.35	1,935,823,200	0.5	2016/03/20	0.82
日本	国債証券	第101回利付国債(5年)	1,820,000,000	100.90	1,836,434,600	101.17	1,841,348,600	0.4	2016/12/20	0.78
日本	国債証券	第85回利付国債(5年)	1,780,000,000	101.30	1,803,260,000	101.01	1,798,031,400	0.7	2014/09/20	0.76
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	1,750,000,000	103.22	1,806,350,000	102.25	1,789,375,000	1.5	2014/09/20	0.76
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	1,680,000,000	106.81	1,794,522,000	106.05	1,781,673,600	1.9	2016/06/20	0.75
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1,610,000,000	104.38	1,680,624,000	105.92	1,705,440,800	1.2	2020/12/20	0.72
日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	1,650,000,000	100.05	1,650,914,800	101.71	1,678,314,000	0.8	2022/06/20	0.71
日本	国債証券	第84回利付国債(5年)	1,650,000,000	101.23	1,670,295,000	100.84	1,663,992,000	0.7	2014/06/20	0.70
日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	1,590,000,000	104.44	1,660,717,300	103.70	1,648,877,700	1.5	2015/09/20	0.70

日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1,530,000,000	106.60	1,631,067,000	106.63	1,631,484,900	1.5	2017/12/20	0.69
日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	1,620,000,000	100.17	1,622,872,200	100.40	1,626,561,000	0.2	2017/12/20	0.69
日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	1,610,000,000	100.89	1,624,388,300	100.81	1,623,105,400	0.4	2015/06/20	0.69
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	1,600,000,000	100.39	1,606,356,000	100.82	1,613,200,000	0.3	2017/03/20	0.68
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	1,590,000,000	101.31	1,610,904,400	101.27	1,610,208,900	0.5	2015/12/20	0.68
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	1,480,000,000	105.99	1,568,761,900	106.60	1,577,680,000	1.3	2019/03/20	0.67
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	1,490,000,000	101.24	1,508,602,000	102.83	1,532,286,200	0.9	2022/03/20	0.65
日本	国債証券	第318回利付国債(10年)	1,450,000,000	101.86	1,476,970,000	104.01	1,508,188,500	1.0	2021/09/20	0.64
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1,410,000,000	105.81	1,491,921,000	106.48	1,501,452,600	1.3	2018/12/20	0.63

(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	76.86
地方債証券	6.53
特殊債券	9.30
社債券	6.77
合計	99.46

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	77,611,456,202	52.31
	イギリス	13,893,469,618	9.36
	カナダ	7,270,934,503	4.90
	スイス	6,522,380,125	4.40
	フランス	5,697,205,982	3.84
	ドイツ	5,610,505,699	3.78
	オーストラリア	5,574,540,695	3.76
	スウェーデン	2,177,731,910	1.47
	オランダ	1,983,694,639	1.34
	スペイン	1,922,307,332	1.30

	香港	1,745,643,290	1.18
	イタリア	1,309,798,829	0.88
	アイルランド	1,080,248,827	0.73
	シンガポール	1,075,648,314	0.73
	デンマーク	794,605,209	0.54
	ベルギー	778,359,221	0.52
	バミューダ	616,125,924	0.42
	アンティル	595,504,317	0.40
	ジャージー	573,925,066	0.39
	フィンランド	545,895,869	0.37
	ノルウェー	494,860,172	0.33
	イスラエル	353,171,939	0.24
	ルクセンブルク	273,328,185	0.18
	オーストリア	196,500,774	0.13
	ケイマン	145,084,332	0.10
	ポルトガル	105,539,272	0.07
	ニュージーランド	94,752,172	0.06
	パナマ	94,554,290	0.06
	マン島	44,917,845	0.03
	ギリシャ	43,890,462	0.03
	ガーンジー	32,357,254	0.02
	リベリア	31,021,215	0.02
	モーリシャス	21,100,389	0.01
	小計	139,311,059,872	93.90
投資信託受益証券	オーストラリア	68,959,958	0.05
	シンガポール	24,947,634	0.02
	香港	13,986,254	0.01
	小計	107,893,846	0.07
投資証券	アメリカ	2,189,057,687	1.48
	オーストラリア	437,302,737	0.29
	フランス	186,948,802	0.13
	イギリス	164,700,315	0.11
	香港	72,007,094	0.05
	シンガポール	57,326,691	0.04
	カナダ	35,964,341	0.02
	オランダ	19,345,521	0.01
	小計	3,162,653,188	2.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,778,845,560	3.90
合計(純資産総額)		148,360,452,466	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

(平成25年2月28日現在)

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	58,945	52,201.54	3,077,019,940	41,127.17	2,424,241,076	1.63
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	285,657	7,591.37	2,168,528,151	8,282.42	2,365,931,335	1.59
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	654,956	1,777.11	1,163,933,507	2,161.95	1,415,987,822	0.95
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	122,250	9,159.41	1,119,738,495	10,791.29	1,319,235,385	0.89
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	201,436	5,471.67	1,102,193,251	6,416.17	1,292,448,022	0.87
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	67,002	17,964.51	1,203,658,561	18,717.54	1,254,113,171	0.85
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	173,398	5,795.75	1,004,971,718	7,060.36	1,224,252,858	0.83
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,516	54,744.64	904,162,518	73,987.64	1,221,979,991	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	171,352	5,783.72	991,052,880	7,100.14	1,216,623,617	0.82
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	472,491	2,689.26	1,270,653,839	2,572.70	1,215,579,060	0.82
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	358,719	3,119.43	1,119,001,392	3,316.48	1,189,685,644	0.80
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,159,024	715.88	829,730,214	1,017.68	1,179,518,441	0.80
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	461,647	2,050.02	946,386,321	2,535.69	1,170,597,882	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	238,350	3,099.08	738,666,909	4,558.89	1,086,612,098	0.73
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	313,556	2,950.14	925,035,320	3,249.87	1,019,018,213	0.69
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	43,755	15,222.46	666,059,074	21,111.59	923,737,926	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	252,336	3,481.15	878,419,794	3,557.00	897,561,549	0.60
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	143,257	4,992.45	715,204,741	6,221.89	891,329,797	0.60
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	104,534	7,902.20	826,049,013	8,458.18	884,168,360	0.60
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	240,124	2,426.53	582,669,842	3,208.24	770,377,054	0.52
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	179,001	3,840.09	687,379,967	4,287.83	767,527,379	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	190,183	3,485.77	662,935,489	3,975.15	756,006,846	0.51
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,185,348	561.47	665,549,195	627.38	743,668,030	0.50
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	183,378	2,443.18	448,027,130	3,900.22	715,214,836	0.48
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,063,071	241.43	739,536,835	231.75	709,869,368	0.48
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	233,656	2,827.05	660,557,615	3,027.07	707,295,182	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	674,679	661.44	446,264,063	1,045.36	705,284,463	0.48
オースト ラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	199,860	3,037.41	607,058,201	3,480.41	695,595,422	0.47

アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	104,542	6,059.40	633,462,317	6,629.26	693,036,788	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	96,829	6,348.03	614,673,997	6,982.65	676,123,481	0.46

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	93.90
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.13
合計	96.10

(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

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	10.59
		素材	6.35
		資本財	7.22
		商業・専門サービス	0.93
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.38
		耐久消費財・アパレル	1.38
		消費者サービス	1.60
		メディア	2.63
		小売	2.88
		食品・生活必需品小売り	2.20
		食品・飲料・タバコ	6.67
		家庭用品・パーソナル用品	1.88
		ヘルスケア機器・サービス	2.82
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.85
		銀行	7.68
		各種金融	4.93
		保険	4.30
		不動産	0.76
		ソフトウェア・サービス	5.97
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.89		
電気通信サービス	3.52		
公益事業	3.31		
半導体・半導体製造装置	1.39		
合計			93.90

(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業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	97	36,363,261.50	36,758,150	3,400,496,456	2.29
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	25	3,652,752.50	3,660,000	331,047,000	0.22
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ ドイツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	47	3,460,799	3,507,610	349,463,184	0.24
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	202	5,345,429	5,276,240	641,854,596	0.43
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ドル	36	4,384,602	4,518,000	428,577,480	0.29
	FTSE 100	ロンドン国際金融 先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	80	4,980,365	5,054,000	709,429,980	0.48

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

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	93,602,150,780	40.88
	フランス	21,980,704,038	9.60
	イタリア	20,857,994,035	9.11
	ドイツ	19,937,617,423	8.71
	イギリス	16,919,498,853	7.39
	スペイン	10,474,465,214	4.58
	カナダ	6,261,242,184	2.73
	ベルギー	6,096,236,681	2.66
	オランダ	5,899,021,926	2.58
	オーストリア	3,950,656,154	1.73
	オーストラリア	3,460,507,710	1.51
	メキシコ	2,307,352,136	1.01
	デンマーク	1,819,262,195	0.79
	ポーランド	1,691,854,400	0.74
	アイルランド	1,685,262,032	0.74
	スウェーデン	1,422,789,340	0.62
	南アフリカ	1,410,847,797	0.62
	フィンランド	1,377,991,587	0.60
マレーシア	1,245,065,228	0.54	
シンガポール	896,728,082	0.39	

	スイス	880,870,422	0.38
	ノルウェー	696,693,318	0.30
	小計	224,874,811,535	98.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,072,319,347	1.78
合計(純資産総額)		228,947,130,882	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

(平成25年2月28日現在)

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			
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	37,400,000	9,711.74	3,632,193,024	9,568.09	3,578,469,276	2.625	2014/07/31	1.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	29,100,000	9,522.14	2,770,944,721	9,514.79	2,768,806,244	1.375	2015/11/30	1.21
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	22,900,000	9,318.21	2,133,871,868	9,365.55	2,144,711,722	0.875	2017/02/28	0.94
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/14	22,000,000	9,498.89	2,089,757,790	9,407.65	2,069,683,581	1.750	2014/03/31	0.90
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	20,700,000	9,769.70	2,022,328,546	9,683.91	2,004,571,012	2.500	2015/03/31	0.88
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	9,747.15	1,871,454,505	9,642.18	1,851,298,562	2.375	2015/02/28	0.81
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	9,322.88	1,808,638,772	9,295.99	1,803,422,099	0.750	2017/06/30	0.79
アメリカ	国債証券	T 1.5% 07/31/16	18,800,000	9,635.84	1,811,538,220	9,583.99	1,801,791,967	1.500	2016/07/31	0.79
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	14,500,000	10,853.27	1,573,724,614	10,755.55	1,559,555,083	3.625	2021/02/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	16,000,000	9,692.93	1,550,869,211	9,549.12	1,527,860,465	2.625	2014/06/30	0.67
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	9,625.66	1,443,849,825	9,575.32	1,436,299,052	1.750	2015/07/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.875% 04/30/14	15,100,000	9,528.53	1,438,808,030	9,432.40	1,424,293,361	1.875	2014/04/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	10,092.26	1,412,917,441	10,019.26	1,402,697,336	2.750	2016/11/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	13,500,000	10,110.40	1,364,904,751	10,085.39	1,361,528,569	2.625	2020/08/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	10,522.36	1,346,862,248	10,419.48	1,333,693,537	3.125	2019/05/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	9,242.21	1,293,909,617	9,241.96	1,293,875,218	0.250	2015/07/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,365.81	1,295,727,438	10,145.02	1,268,127,808	4.250	2015/08/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	9,655.26	1,264,840,199	9,595.92	1,257,066,176	1.875	2015/06/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	9,662.39	1,217,461,388	9,558.70	1,204,396,725	2.125	2014/11/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	9,672.35	1,209,044,412	9,550.93	1,193,866,851	2.375	2014/08/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	10,047.81	1,205,737,965	9,796.84	1,175,621,420	4.250	2014/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,500,000	10,098.39	1,161,315,034	10,068.23	1,157,846,663	2.625	2020/11/15	0.51
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000	12,173.51	1,119,963,426	12,555.37	1,155,094,486	4.250	2014/08/01	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	12,500,000	9,366.30	1,170,788,557	9,234.73	1,154,342,311	1.750	2022/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	11,500,000	9,398.66	1,080,845,948	9,423.73	1,083,729,359	1.000	2016/09/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	9,243.77	1,063,033,908	9,272.68	1,066,358,433	0.375	2015/04/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	10,918.55	1,070,018,441	10,751.57	1,053,654,568	4.500	2017/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 03/31/19	11,000,000	9,524.54	1,047,699,610	9,505.58	1,045,614,147	1.500	2019/03/31	0.46
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	13,167.15	1,040,205,063	13,003.22	1,027,255,116	3.500	2015/04/25	0.45

アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	9,768.13	1,006,117,482	9,692.22	998,299,618	2.000	2016/01/31	0.44
------	------	---------------	------------	----------	---------------	----------	-------------	-------	------------	------

(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	98.22
合計	98.22

(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

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	15	1,857,974.07	1,858,828.20	171,960,196	0.08
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	8	1,051,063.28	1,051,500	97,274,265	0.04
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	6	862,867.77	861,937.50	79,737,838	0.03
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	10	1,104,925	1,107,050	134,672,632	0.06
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	9	1,138,016	1,147,860	139,637,169	0.06
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	14	2,005,286	2,031,260	247,102,779	0.11

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

新興国株式インデックス マザーファンド

(1) 投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	韓国	2,761,171,955	14.98
	ブラジル	2,249,451,408	12.20
	台湾	1,899,818,935	10.31
	中国	1,867,576,612	10.13
	南アフリカ	1,280,810,730	6.95
	インド	1,216,147,934	6.60
	ロシア	1,087,157,729	5.90
	メキシコ	948,778,245	5.15

	香港	779,473,335	4.23
	マレーシア	610,193,420	3.31
	ケイマン	580,942,838	3.15
	インドネシア	534,572,689	2.90
	タイ	488,426,425	2.65
	チリ	359,076,049	1.95
	トルコ	352,256,931	1.91
	ポーランド	267,838,904	1.45
	フィリピン	185,032,920	1.00
	コロンビア	184,856,785	1.00
	バミューダ	145,085,207	0.79
	チェコ	55,283,535	0.30
	エジプト	47,638,545	0.26
	ハンガリー	39,170,002	0.21
	ペルー	32,688,504	0.18
	アメリカ	22,515,287	0.12
	モロッコ	14,255,472	0.08
	ルクセンブルク	6,107,242	0.03
	小計	18,016,327,638	97.73
投資信託受益証券	南アフリカ	40,004,639	0.22
	ブラジル	30,347,899	0.16
	メキシコ	6,137,386	0.03
	小計	76,489,924	0.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		341,719,979	1.85
合計(純資産総額)		18,434,537,541	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

(平成25年2月28日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	5,552	115,955.37	643,784,259	131,016.59	727,404,163	3.95
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,242,389	286.00	355,331,239	326.03	405,068,509	2.20
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	303,000	1,028.87	311,750,512	1,013.45	307,076,410	1.67
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,623,620	68.63	248,721,653	73.72	267,160,081	1.45
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	274,050	844.77	231,511,130	827.03	226,650,147	1.23
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,266,515	60.50	197,632,734	64.42	210,435,429	1.14

メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,966,340	113.69	223,566,313	97.21	191,150,664	1.04
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	114,900	1,408.58	161,846,259	1,622.08	186,377,911	1.01
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	146,151	1,024.78	149,773,644	1,258.13	183,877,834	1.00
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	102,415	1,694.40	173,532,282	1,659.05	169,912,629	0.92
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	212,540	958.64	203,750,892	786.70	167,206,918	0.91
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	51,400	3,176.01	163,246,974	3,151.90	162,007,968	0.88
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	26,964	5,526.21	149,008,882	5,966.89	160,891,356	0.87
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	898,000	190.29	170,888,671	178.71	160,482,837	0.87
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,788,200	37.75	143,010,665	42.35	160,435,952	0.87
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	97,000	1,519.98	147,438,779	1,638.00	158,886,000	0.86
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	85,719	1,763.45	151,161,506	1,840.18	157,738,663	0.86
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	37,200	3,798.23	141,294,473	4,042.58	150,384,124	0.82
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	7,842	18,478.10	144,905,319	18,447.00	144,661,374	0.78
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,068,000	122.46	130,791,339	125.98	134,547,494	0.73
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	510,048	284.45	145,088,177	254.90	130,013,275	0.71
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	19,911	5,725.10	113,992,590	6,073.15	120,922,688	0.66
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	22,156	4,124.55	91,383,748	5,035.25	111,561,032	0.61
ブラジル	株式	VALE SA	素材	62,900	1,744.23	109,712,444	1,731.60	108,917,640	0.59
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	26,349	3,865.44	101,850,562	3,981.87	104,918,450	0.57
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	385,000	274.97	105,865,235	271.40	104,491,887	0.57
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	151,500	981.95	148,765,966	689.36	104,438,646	0.57
コロンビア	株式	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	エネルギー	19,507	5,261.40	102,634,182	5,334.12	104,052,807	0.56
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	998,000	97.82	97,633,909	104.14	103,940,602	0.56
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	75,895	1,377.74	104,564,298	1,348.27	102,327,369	0.56

(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 (%)
株式	97.73
投資信託受益証券	0.41
合計	98.15

(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

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	11.90
		素材	10.77
		資本財	4.70
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.71
		自動車・自動車部品	3.41
		耐久消費財・アパレル	0.90
		消費者サービス	0.54
		メディア	1.28
		小売	1.75
		食品・生活必需品小売り	2.20
		食品・飲料・タバコ	5.23
		家庭用品・パーソナル用品	1.09
		ヘルスケア機器・サービス	0.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.76
		銀行	19.06
		各種金融	2.57
		保険	2.93
		不動産	1.82
		ソフトウェア・サービス	2.71
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.08		
電気通信サービス	7.35		
公益事業	3.36		
半導体・半導体製造装置	8.00		
合計			97.73

(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業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数 先物取引	MSCI EMERG M	ニューヨーク証券取引所	買建	アメリカドル	63	3,357,941	3,315,375	306,705,341	1.66

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

新興国債券インデックス マザーファンド

(1) 投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	1,900,880,605	9.93
	マレーシア	1,875,301,136	9.80
	ブラジル	1,865,884,371	9.75
	ポーランド	1,838,320,732	9.61
	インドネシア	1,814,896,980	9.48
	トルコ	1,813,888,331	9.48
	南アフリカ	1,811,698,069	9.47
	タイ	1,354,360,384	7.08
	ロシア	1,115,729,856	5.83
	ハンガリー	954,167,851	4.99
	コロンビア	695,359,126	3.63
	ペルー	375,896,816	1.96
	ナイジェリア	268,770,425	1.40
	フィリピン	115,524,385	0.60
小計	17,800,679,067	93.02	
特殊債券	ドイツ	382,468,996	2.00
	国際機関	330,780,939	1.73
	小計	713,249,935	3.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		622,008,419	3.25
合計(純資産総額)		19,135,937,421	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

(平成25年2月28日現在)

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			
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	22,950,000	5,876.80	1,348,725,924	5,524.22	1,267,809,683	12.500	2016/01/05	6.63
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	340,000,000	326.37	1,109,690,592	328.15	1,115,729,856	7.850	2018/03/10	5.83
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	6,870,000,000	6.30	433,241,409	6.14	422,223,879	12.000	2015/10/22	2.21
トルコ	国債証券	TURKGB 8% 06/04/14	7,750,000	5,255.22	407,279,849	5,303.10	410,990,991	8.000	2014/06/04	2.15
ドイツ	特殊債券	KFW 7% 06/14/16	121,000,000	313.79	379,691,804	316.09	382,468,996	7.000	2016/06/14	2.00
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	26,400,000	1,308.02	345,319,856	1,339.50	353,629,700	10.500	2026/12/21	1.85
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	11,500,000	3,047.05	350,411,270	3,047.20	350,428,747	5.500	2015/04/25	1.83

インド ネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 06/15/32	29,700,000,000	1.16	345,508,416	1.16	347,311,800	8.250	2032/06/15	1.81
トルコ	国債証券	TURKGB 9.5% 01/12/22	4,550,000	5,916.11	269,183,180	6,074.66	276,397,097	9.500	2022/01/12	1.44
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,034.62	268,564,666	3,042.27	269,241,591	4.750	2016/10/25	1.41
ナイジェ リア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	550,000,000	48.49	266,741,900	48.86	268,770,425	7.000	2019/10/23	1.40
マレーシア	国債証券	MGS 3.741% 02/27/15	8,600,000	3,039.33	261,382,406	3,036.19	261,112,498	3.741	2015/02/27	1.36
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	22,500,000	1,095.99	246,598,631	1,105.15	248,660,532	7.250	2020/01/15	1.30
マレーシア	国債証券	MGS 5.094% 04/30/14	8,100,000	3,083.43	249,758,277	3,068.40	248,540,458	5.094	2014/04/30	1.30
インド ネシア	国債証券	INDOGB 7% 05/15/27	22,900,000,000	1.04	240,447,187	1.05	240,450,000	7.000	2027/05/15	1.26
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	20,000,000	1,152.68	230,536,944	1,152.65	230,530,656	8.250	2017/09/15	1.20
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	7,650,000	3,009.07	230,194,052	3,005.22	229,899,684	3.314	2017/10/31	1.20
トルコ	国債証券	TURKGB 10% 06/17/15	4,070,000	5,556.74	226,159,696	5,617.19	228,619,981	10.000	2015/06/17	1.19
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 01/27/16	3,950,000	5,502.89	217,364,185	5,576.44	220,269,547	9.000	2016/01/27	1.15
インド ネシア	国債証券	INDOGB 7.375% 09/15/16	21,000,000,000	1.03	217,318,752	1.04	220,248,000	7.375	2016/09/15	1.15
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/14	4,600,000	4,803.11	220,943,268	4,754.68	218,715,658	10.000	2014/01/01	1.14
ハンガリー	国債証券	HGB 8% 02/12/15	501,000,000	43.09	215,905,109	43.56	218,261,632	8.000	2015/02/12	1.14
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	6,350,000	3,332.36	211,605,468	3,339.53	212,060,218	5.750	2022/09/23	1.11
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	18,100,000	1,146.20	207,463,662	1,149.00	207,970,129	8.000	2018/12/21	1.09
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.75% 03/31/21	19,100,000	1,057.23	201,931,480	1,072.07	204,766,859	6.750	2021/03/31	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 9.5% 12/18/14	25,200,000	794.12	200,118,386	792.31	199,662,835	9.500	2014/12/18	1.04
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	15,800,000	1,266.78	200,151,470	1,250.90	197,643,546	13.500	2015/09/15	1.03
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	62,900,000	313.32	197,084,192	312.45	196,537,245	3.250	2017/06/16	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	23,500,000	788.61	185,324,383	801.32	188,312,493	6.500	2021/06/10	0.98
マレーシア	国債証券	MGS 3.58% 09/28/18	6,200,000	3,032.06	187,987,898	3,028.69	187,779,206	3.580	2018/09/28	0.98

(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	93.02
特殊債券	3.73
合計	96.75

(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。

J-REITインデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	11,234,021,950	97.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		286,602,760	2.49
合計(純資産総額)		11,520,624,710	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

(平成25年2月28日現在)

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	
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,408	863,977.89	1,216,480,869	1,037,000.00	1,460,096,000	12.67
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,209	800,917.61	968,309,398	1,017,000.00	1,229,553,000	10.67
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	4,232	146,474.80	619,881,353	181,200.00	766,838,400	6.66
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,281	96,997.46	415,246,126	121,800.00	521,425,800	4.53
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,514	167,817.57	421,893,389	196,900.00	495,006,600	4.30
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,679	235,535.05	395,463,362	272,900.00	458,199,100	3.98
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	493	714,331.64	352,165,500	887,000.00	437,291,000	3.80
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	463	695,408.53	321,974,154	892,000.00	412,996,000	3.58
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	621	478,228.19	296,979,706	569,000.00	353,349,000	3.07
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	806	260,622.49	210,061,728	393,500.00	317,161,000	2.75
日本	投資証券	G L P投資法人	3,740	78,351.44	293,034,385	84,600.00	316,404,000	2.75
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,895	78,214.40	226,430,710	109,100.00	315,844,500	2.74
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	418	533,148.44	222,856,050	704,000.00	294,272,000	2.55

日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	396	557,143.64	220,628,885	680,000.00	269,280,000	2.34
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	301	719,632.74	216,609,456	881,000.00	265,181,000	2.30
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	318	636,941.75	202,547,479	832,000.00	264,576,000	2.30
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	654	308,039.41	201,457,779	389,500.00	254,733,000	2.21
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	451	450,831.22	203,324,881	561,000.00	253,011,000	2.20
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	471	390,939.21	184,132,369	530,000.00	249,630,000	2.17
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	583	274,532.93	160,052,701	382,000.00	222,706,000	1.93
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	2,709	48,837.28	132,300,195	77,000.00	208,593,000	1.81
日本	投資証券	福岡リート投資法人	250	596,164.96	149,041,241	768,000.00	192,000,000	1.67
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	345	415,135.12	143,221,619	522,000.00	180,090,000	1.56
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	249	582,715.25	145,096,098	670,000.00	166,830,000	1.45
日本	投資証券	プレミア投資法人	400	292,187.02	116,874,811	416,000.00	166,400,000	1.44
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	307	474,169.96	145,570,178	502,000.00	154,114,000	1.34
日本	投資証券	トップリート投資法人	315	361,350.65	113,825,454	433,500.00	136,552,500	1.19
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,297	23,013.44	98,888,751	31,150.00	133,851,550	1.16
日本	投資証券	積水ハウス・S I投資法人	279	368,066.84	102,690,650	472,000.00	131,688,000	1.14
日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	197	472,530.11	93,088,432	632,000.00	124,504,000	1.08

(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(%)
投資証券	97.51
合計	97.51

(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

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数 先物取引	東証REIT指数先物	東京証券取引所	買建	円	216	269,609,400	285,552,000	285,552,000	2.48

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	10,352,834,760	65.42
	オーストラリア	1,851,966,205	11.70
	イギリス	850,358,055	5.37
	フランス	780,301,201	4.93
	シンガポール	639,664,787	4.04
	カナダ	513,660,768	3.25
	香港	337,493,017	2.13
	オランダ	181,860,624	1.15
	ベルギー	87,921,807	0.56
	ニュージーランド	50,078,193	0.32
	ドイツ	23,742,803	0.15
	イタリア	14,404,070	0.09
	イスラエル	3,245,843	0.02
	小計	15,687,532,133	99.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		138,594,368	0.88
合計(純資産総額)		15,826,126,501	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

(平成25年2月28日現在)

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	
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	71,981	14,115.24	1,016,029,159	14,727.59	1,060,106,799	6.70
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	485,386	994.98	482,951,394	1,056.74	512,926,995	3.24
アメリカ	投資証券	HCP INC	106,180	4,105.38	435,910,132	4,510.78	478,955,427	3.03
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	33,860	13,510.94	457,480,595	14,046.71	475,621,885	3.01
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	21,267	20,649.31	439,148,890	21,167.09	450,160,715	2.84
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	68,582	5,910.25	405,336,869	6,503.45	446,019,813	2.82
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	75,206	5,232.47	393,513,702	5,179.63	389,539,622	2.46
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	107,761	3,129.82	337,272,604	3,575.51	385,300,694	2.43
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	61,100	5,457.57	333,457,747	5,921.56	361,807,627	2.29
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	34,974	9,560.94	334,384,381	9,611.78	336,162,708	2.12
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,537	12,235.92	324,704,617	11,650.70	309,174,875	1.95
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	39,676	7,192.04	285,351,643	7,648.72	303,470,884	1.92
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	171,080	1,337.16	228,761,799	1,544.91	264,304,400	1.67
香港	投資証券	LINK REIT	532,000	474.58	252,477,938	491.51	261,486,512	1.65
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	181,246	1,108.81	200,967,474	1,144.71	207,475,440	1.31
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	652,433	292.51	190,845,770	302.60	197,428,444	1.25
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	94,081	1,759.90	165,574,039	2,013.01	189,386,708	1.20

アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	103,940	1,750.76	181,974,864	1,787.29	185,771,255	1.17
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	525,349	325.25	170,873,485	350.98	184,388,042	1.17
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	31,573	5,206.17	164,374,430	5,579.27	176,154,547	1.11
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	28,509	5,718.54	163,029,864	6,117.68	174,409,118	1.10
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	41,378	3,706.53	153,368,916	4,198.10	173,709,139	1.10
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	206,869	735.35	152,122,163	786.07	162,613,928	1.03
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	21,109	6,837.08	144,323,970	7,521.98	158,781,646	1.00
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	351,888	419.96	147,780,529	441.09	155,217,444	0.98
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,122	9,605.25	145,250,707	9,902.27	149,742,132	0.95
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	378,568	331.34	125,438,239	368.05	139,334,526	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	58,621	2,174.41	127,466,159	2,244.29	131,562,676	0.83
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	19,736	6,089.82	120,188,880	6,503.45	128,352,148	0.81
オーストラリア	投資証券	MIRVAC GROUP	795,563	138.10	109,872,618	153.19	121,879,376	0.77

(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(%)
投資証券	99.12
合計	99.12

(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。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	イギリス	3,840,431,461	77.98
	ジャージー	732,005,264	14.86
	アメリカ	275,920,696	5.60
	小計	4,848,357,421	98.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		76,625,938	1.56
合計(純資産総額)		4,924,983,359	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

(平成25年2月28日現在)

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			
イギリス	社債券	UBS USD COM 001 08/14/13	10,000,000	9,383.11	938,311,353	8,749.59	874,959,580	0.0	2013/08/14	17.77
イギリス	社債券	CS USD COM 003 08/30/13	10,000,000	9,253.49	925,349,777	8,582.15	858,215,270	0.0	2013/08/30	17.43
イギリス	社債券	BAR USD COM 020 09/27/13	10,000,000	9,079.30	907,930,144	8,527.84	852,784,933	0.0	2013/09/27	17.32
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	55,450,000	1,280.31	709,936,856	1,320.11	732,005,264	0.0		14.86
イギリス	社債券	BAR USD COM 019 06/28/13	5,000,000	9,266.89	463,344,660	8,759.40	437,970,093	0.0	2013/06/28	8.89
イギリス	社債券	BAR USD COM 018 04/26/13	3,000,000	9,701.27	291,038,310	9,704.94	291,148,397	0.0	2013/04/26	5.91
イギリス	社債券	UBS USD COM 002 11/07/13	3,300,000	9,185.03	303,106,239	8,810.65	290,751,529	0.0	2013/11/07	5.90
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	7,390,000	3,635.64	268,674,017	3,733.70	275,920,696	0.0	2036/06/12	5.60
イギリス	社債券	CS USD COM 004 10/25/13	1,900,000	9,248.66	175,724,595	8,949.41	170,038,930	0.0	2013/10/25	3.45
イギリス	社債券	CS USD COM 002 06/28/13	700,000	10,001.25	70,008,792	9,223.24	64,562,729	0.0	2013/06/28	1.31

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3)償還期限は、償還期限の定めがない場合「 」と記載しております。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	98.44
合計	98.44

(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。

FRMシグマ リンク マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ケイマン	1,790,003,850	95.14

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	91,417,528	4.86
合計(純資産総額)	1,881,421,378	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

(平成25年2月28日現在)

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			
ケイマン	社債券	QUART X 0% 03/31/22	2,005,000,000	88.20	1,768,480,100	89.27	1,790,003,850	0.0	2022/03/31	95.14

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	95.14
合計	95.14

(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: 2013年3月29日

作成基準日: 2013年2月28日

基準価額・純資産の推移

ファンドは、作成基準日現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

分配の推移

ファンドは、作成基準日現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

主要な資産の状況

ファンドは、作成基準日現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

年間収益率の推移(暦年ベース)

ファンドは、作成基準日現在においては運用を開始しておらず、該当する記載事項はありません。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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。

<更新・訂正後>

(1)当ファンドの第1計算期末（平成25年7月10日）は到来しておらず、該当事項はありません。

当ファンドの会計監査は、有限責任監査法人トーマツが行います。

(2)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づいて作成され、監査証明を受けた当ファンドの財務諸表は有価証券報告書に記載されます。

(3)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）」に基づいて作成され、監査証明を受けた当ファンドの中間財務諸表は半期報告書に記載されます。

(4)法令の定めるところにより、当ファンドの有価証券報告書の提出は、計算期間の終了毎に行われ、半期報告書の提出は、計算期間開始6ヶ月経過毎に行われます。

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、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

純資産額計算書

当ファンドは、作成基準日（平成25年2月28日）現在においては運用を開始しておらず、該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドの投資対象ファンドの平成25年2月28日現在の状況は次の通りです。

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

資産総額	17,483,894,996	円
負債総額	579,706,427	円
純資産総額(-)	16,904,188,569	円
発行済口数	12,898,055,129	口
1口当たり純資産額(/)	1.3106	円
1万口当たり純資産額	13,106	円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	243,270,745,819 円
負債総額	6,816,517,977 円
純資産総額(-)	236,454,227,842 円
発行済口数	186,999,191,663 口
1口当たり純資産額(/)	1.2645 円
1万口当たり純資産額	12,645 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	148,551,166,156 円
負債総額	190,713,690 円
純資産総額(-)	148,360,452,466 円
発行済口数	121,855,409,861 口
1口当たり純資産額(/)	1.2175 円
1万口当たり純資産額	12,175 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	229,043,646,797 円
負債総額	96,515,915 円
純資産総額(-)	228,947,130,882 円
発行済口数	106,522,009,310 口
1口当たり純資産額(/)	2.1493 円
1万口当たり純資産額	21,493 円

新興国株式インデックス マザーファンド

資産総額	19,145,802,098 円
負債総額	711,264,557 円
純資産総額(-)	18,434,537,541 円
発行済口数	9,049,619,935 口
1口当たり純資産額(/)	2.0371 円
1万口当たり純資産額	20,371 円

新興国債券インデックス マザーファンド

資産総額	19,344,728,702 円
負債総額	208,791,281 円
純資産総額(-)	19,135,937,421 円

発行済口数	11,843,124,124 口
1口当たり純資産額(/)	1.6158 円
1万口当たり純資産額	16,158 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	11,619,356,446 円
負債総額	98,731,736 円
純資産総額(-)	11,520,624,710 円
発行済口数	11,332,168,527 口
1口当たり純資産額(/)	1.0166 円
1万口当たり純資産額	10,166 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	15,914,138,469 円
負債総額	88,011,968 円
純資産総額(-)	15,826,126,501 円
発行済口数	15,163,682,782 口
1口当たり純資産額(/)	1.0437 円
1万口当たり純資産額	10,437 円

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

資産総額	4,981,765,004 円
負債総額	56,781,645 円
純資産総額(-)	4,924,983,359 円
発行済口数	11,070,276,583 口
1口当たり純資産額(/)	0.4449 円
1万口当たり純資産額	4,449 円

FRMシグマ リンク マザーファンド

資産総額	1,881,421,378 円
負債総額	円
純資産総額(-)	1,881,421,378 円
発行済口数	2,092,805,194 口
1口当たり純資産額(/)	0.8990 円
1万口当たり純資産額	8,990 円

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25年1月31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25年3月12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2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5月2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25年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	302	4,020,793
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	755
単位型公社債投資信託	0	0
合計	307	4,021,548

<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2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	299	4,042,545
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	778
単位型公社債投資信託	0	0
合計	304	4,043,323

[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25年3月12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5月2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。