

【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26年2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】	各ファンドについて上限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9月25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。

(3)ファンドの仕組み

<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7月31日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年7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11月29日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年11月29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)

各投資対象ファンドのうち、「1」から「10」、「12」から「15」及び「17」は、国内籍の契約型株式投資信託です。「11」及び「16」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「10」、「12」及び「14」は、委託会社が設定・運用を行う親投資信託です。「5」、「8」、「13」及び「17」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。「15」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。「11」及び「16」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9月25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場合があります。

1. ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

(中略)

2. 国内債券インデックス マザーファンド

(中略)

3. 外国株式インデックス マザーファンド

(中略)

4. 外国債券インデックス マザーファンド

(中略)

5. FOFs用外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）

(中略)

6. 新興国株式インデックス マザーファンド

(中略)

7. 新興国債券インデックス マザーファンド

(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）

(中略)

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. HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

(中略)	(中略)
設定日	平成25年9月（予定）
(中略)	(中略)

12. 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)

13. TCAファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

14. FRM シグマ リンク マザーファンド

(中略)

15. 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)

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

(中略)

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

(中略)	(中略)
設定日	平成25年10月16日(予定)
(中略)	(中略)

<訂正後>

(前略)

- 投資対象ファンドの概要 -

(中略)

各投資対象ファンドのうち、「1」から「11」、「13」から「16」及び「18」は、国内籍の契約型株式投資信託です。「12」及び「17」は、外国籍円建投資信託証券です。「1」、「3」から「5」、「7」から「8」、「10」から「11」、「13」及び「15」は、委託会社が設定・運用を行う親投資信託です。「2」、「6」、「9」、「14」及び「18」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。「16」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。「12」及び「17」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26年2月3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。

1.ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

(中略)

2.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資するJPX日経インデックス400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）に連動する投資成果を目指します。 株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。 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	株式への実質投資割合には制限を設けません。 新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）

決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含み ます。）等の全額とします。 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。た だし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同 一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0735%（ ）（税抜 年0.07%） 消費税率が8%になった場合は、0.0756%となります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年2月3日
信託期間	原則として平成26年2月3日から平成35年10月20日
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

「JPX日経インデックス400（配当込み）」とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。採用される400銘柄は、企業の健全性や流動性の観点から1,000銘柄に絞り込まれた上で、ROE（自己資本利益率）、営業利益、時価総額の定量評価に定性評価を加味し、選定されます。「（配当込み）」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

「JPX日経インデックス400」は、JPX グループ並びに日経によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX グループ及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

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

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

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

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

3. 国内債券インデックス マザーファンド

（中略）

4. 外国株式インデックス マザーファンド

（中略）

5. 外国債券インデックス マザーファンド

（中略）

6. FOFs用外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）

（中略）

7. 新興国株式インデックス マザーファンド

（中略）

8. 新興国債券インデックス マザーファンド

（中略）

9. 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）

（中略）

10. J-REITインデックス マザーファンド

（中略）

11. グローバルREITインデックス マザーファンド

（中略）

12. HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

(中略)	(中略)
設定日	平成25年10月2日
(中略)	(中略)

13. 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)

14. TCAファンド(適格機関投資家専用)

(中略)

15. FRM シグマ リンク マザーファンド

(中略)

16. 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)

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

(中略)

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

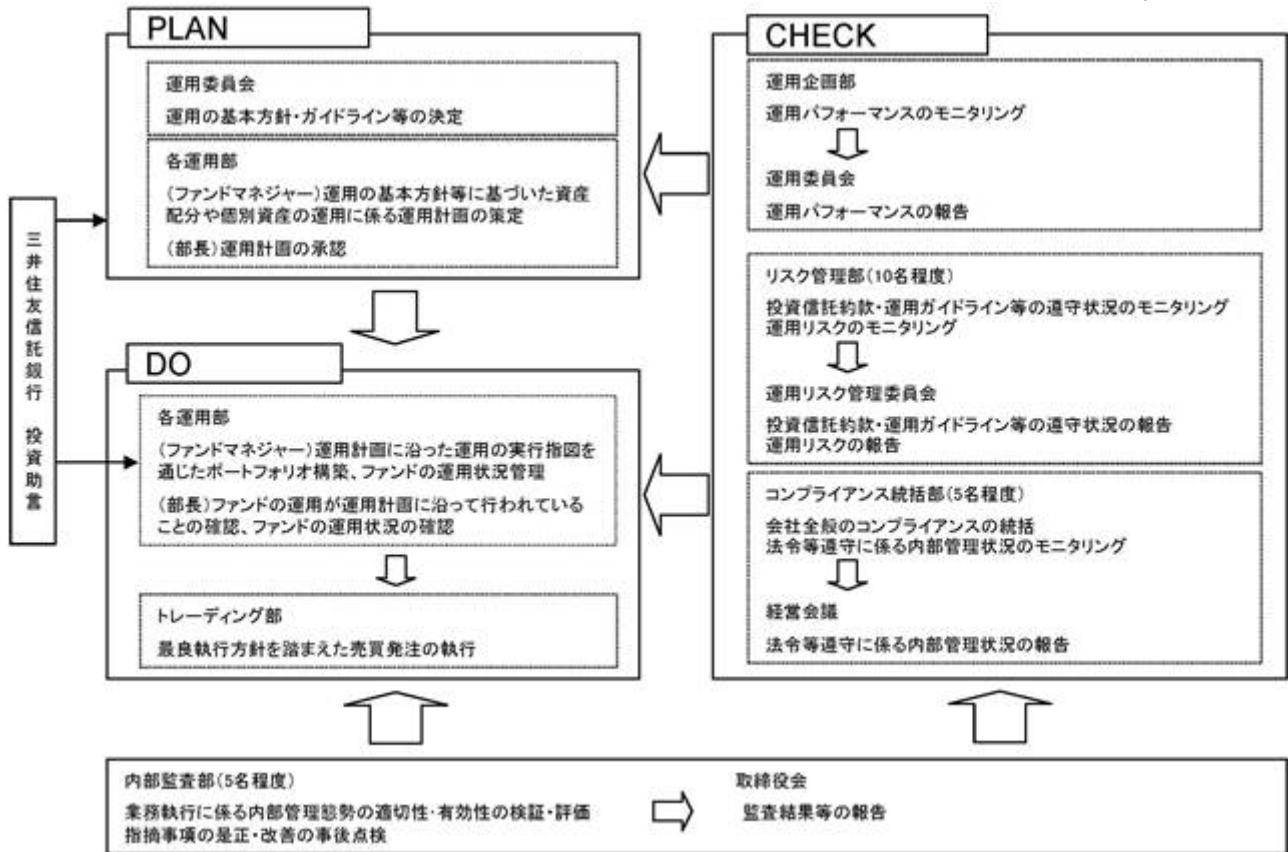
(中略)	(中略)
設定日	平成25年10月16日
信託期間	原則として、平成25年10月16日から平成35年10月10日
(中略)	(中略)

(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26年2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。

3 投資リスク

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「3 投資リスク」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。

(2) リスクの管理体制

< 訂正前 >

委託会社におけるリスク管理体制（平成25年10月1日現在（予定））

（後略）

< 訂正後 >

委託会社におけるリスク管理体制

（後略）

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）

（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
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用外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）	年率 0.399%（ <u>2</u> ）（税抜 0.38%）
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用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）	年率 0.063%（ <u>3</u> ）（税抜 0.06%）
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 0.65%
グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	ありません。
TCAファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.84%（ <u>4</u> ）（税抜 0.8%）
FRMシグマ リンク マザーファンド	ありません。
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド ・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.84%（ <u>5</u> ）（税抜 0.8%）
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D ^A , H, JPY	年率 0.85%
FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド（適格機関 投資家専用）	年率 0.063%（ <u>6</u> ）（税抜 0.06%）

2：消費税率が8%になった場合は、0.4104%となります。

3：消費税率が8%になった場合は、0.0648%となります。

4：消費税率が8%になった場合は、0.864%となります。

5：消費税率が8%になった場合は、0.864%となります。

6：消費税率が8%になった場合は、0.0648%となります。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の入組状況により実質的な信託報酬率は変動します。

実質的な信託報酬率：年率1.26%～1.74135%（7）（税抜 1.2%～1.6645%）程度

7：消費税率が8%になった場合は、1.296%～1.78746%となります。

<訂正後>

（前略）

（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
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	ありません。
FOFs用JPX日経インデックス400・オープン （適格機関投資家専用）	年率 0.0735%（ <u>2</u> ）（税抜 0.07%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用外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）	年率 0.399%（ <u>3</u> ）（税抜 0.38%）
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用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）	年率 0.063%（ <u>4</u> ）（税抜 0.06%）
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 0.65%
グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	ありません。
TCAファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.84%（ <u>5</u> ）（税抜 0.8%）
FRMシグマ リンク マザーファンド	ありません。
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド ・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.84%（ <u>6</u> ）（税抜 0.8%）
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D ^A , H, JPY	年率 0.85%
FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド（適格機関 投資家専用）	年率 0.063%（ <u>7</u> ）（税抜 0.06%）

2：消費税率が8%になった場合は、0.0756%となります。

3：消費税率が8%になった場合は、0.4104%となります。

4：消費税率が8%になった場合は、0.0648%となります。

5：消費税率が8%になった場合は、0.864%となります。

6：消費税率が8%になった場合は、0.864%となります。

7：消費税率が8%になった場合は、0.0648%となります。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の入組状況により実質的な信託報酬率は変動します。

実質的な信託報酬率：年率1.26%～1.74135%程度（8）（税抜 1.2%～1.6645%程度）

8：消費税率が8%になった場合は、1.296%～1.78746%程度となります。

(5)課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

	税 率（内 訳）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%、住民税3%）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

（中略）

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

（中略）

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。（平成26年1月1日以降）

（中略）

上記は、平成25年7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。

（後略）

<訂正後>

（前略）

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

	税 率（内 訳）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成26年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

（中略）

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成26年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

（中略）

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

（中略）

上記は、平成26年1月1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。

（後略）

[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、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11月29日現在の状況について記載してあります。

分散投資コア戦略ファンドA

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	467,439,868	40.52
	ケイマン	25,286,206	2.19
	小計	492,726,074	42.71
投資証券	ルクセンブルク	104,805,209	9.08
親投資信託受益証券	日本	544,171,971	47.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,005,671	1.04
合計(純資産総額)		1,153,708,925	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	
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	109,563,897	1.2637	138,465,197	1.2819	140,449,959	12.17
日本	親投資信託受益証券	FRM シグマ リンク マザーファンド	120,209,347	0.8775	105,488,058	0.8878	106,721,858	9.25
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	59,582.268	1,725.32	102,798,651	1,759.00	104,805,209	9.08
日本	投資信託受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	105,697,735	0.9593	101,406,153	0.9740	102,949,593	8.92
日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	98,000,184	1.0146	99,437,148	1.0485	102,753,192	8.91
日本	投資信託受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	95,994,422	1.0000	95,994,909	1.0014	96,128,814	8.33
日本	投資信託受益証券	FOFs用外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)	81,988,293	1.0038	82,304,142	1.0117	82,947,556	7.19

日本	投資信託 受益証券	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)	91,651,750	0.8995	82,443,125	0.9019	82,660,713	7.16
日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	27,284,368	2.2946	62,609,045	2.4332	66,388,324	5.75
日本	親投資信託 受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	39,759,608	1.5874	63,115,952	1.6182	64,338,997	5.58
日本	親投資信託 受益証券	ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	37,360,903	1.3860	51,784,062	1.4145	52,846,997	4.58
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	25,962,914	1.4246	36,988,880	1.5944	41,395,270	3.59
ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	25,041.5357	1,003.56	25,130,797	1,009.77	25,286,206	2.19
日本	親投資信託 受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	18,916,345	1.1286	21,350,771	1.1436	21,632,732	1.88
日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	18,665,825	1.0835	20,224,504	1.1578	21,611,292	1.87
日本	親投資信託 受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	7,705,541	2.0202	15,567,063	2.2278	17,166,404	1.49
日本	親投資信託 受益証券	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	26,248,336	0.4446	11,671,822	0.4427	11,620,138	1.01

(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 (%)
投資信託受益証券	42.71
投資証券	9.08
親投資信託受益証券	47.17
合計	98.96

(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)
第1期計算期間末 (平成25年 7月10日)	258,830,299	258,830,299	9,811	9,811
平成25年 3月末日	1,000,001		10,000	

4月末日	1,018,901		10,189	
5月末日	2,748,794		10,084	
6月末日	2,690,244		9,726	
7月末日	568,692,731		9,773	
8月末日	880,692,007		9,640	
9月末日	921,901,099		9,818	
10月末日	1,075,993,337		9,951	
11月末日	1,153,708,925		10,004	

分配の推移

期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間(平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	0

収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	1.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	263,825,167		263,825,167

(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。

分散投資コア戦略ファンドS

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	454,851,112	26.21
	ケイマン	15,280,819	0.88
	小計	470,131,931	27.09
投資証券	ルクセンブルク	121,335,730	6.99
親投資信託受益証券	日本	1,098,435,822	63.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		45,778,820	2.64
合計(純資産総額)		1,735,682,303	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	
日本	親投資信託 受益証券	ART テクニカル運用日本株式 マザー ファンド	136,421,824	1.3901	189,646,566	1.4145	192,968,670	11.12
日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	67,206,694	2.3203	155,945,135	2.4332	163,527,327	9.42
日本	親投資信託 受益証券	新興国債券インデックス マザーファン ド	98,235,255	1.5735	154,580,880	1.6182	158,964,289	9.16
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	83,813,775	1.4676	123,010,524	1.5944	133,632,682	7.70
日本	親投資信託 受益証券	FRM シグマ リンク マザーファンド	139,625,096	0.8629	120,494,261	0.8878	123,959,160	7.14
ルクセン ブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	68,979.949	1,725.31	119,011,795	1,759.00	121,335,730	6.99
日本	投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	122,804,142	0.9629	118,251,183	0.9740	119,611,234	6.89
日本	投資信託 受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲッ トファンド・為替ヘッジあり(適格機 関投資家専用)	113,936,678	1.0298	117,332,308	1.0485	119,462,606	6.88
日本	親投資信託 受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	81,614,621	1.2738	103,964,864	1.2819	104,621,782	6.03
日本	投資信託 受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイド リンク ファンド(適格機関投資家専用)	90,311,137	0.9999	90,309,962	1.0014	90,437,572	5.21
日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	57,005,265	1.1211	63,911,112	1.1578	66,000,695	3.80
日本	親投資信託 受益証券	グローバルREITインデックス マザー ファンド	57,544,530	1.1176	64,313,327	1.1436	65,807,924	3.79
日本	投資信託 受益証券	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)	69,852,673	0.9002	62,885,407	0.9019	63,000,125	3.63
日本	投資信託 受益証券	FOFs用外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)	61,618,637	1.0058	61,981,304	1.0117	62,339,575	3.59
日本	親投資信託 受益証券	新興国株式インデックス マザーファン ド	24,369,917	2.0820	50,738,903	2.2278	54,291,301	3.13
日本	親投資信託 受益証券	グローバル・コモディティ(米ドル建 て) マザーファンド	78,296,797	0.4421	34,621,480	0.4427	34,661,992	2.00
ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	15,132.9617	1,003.77	15,190,012	1,009.77	15,280,819	0.88

(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(%)
投資信託受益証券	27.09
投資証券	6.99
親投資信託受益証券	63.29
合計	97.36

(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)
第1期計算期間末 (平成25年 7月10日)	54,287,050	54,287,050	9,915	9,915
平成25年 3月末日	1,000,002		10,000	
4月末日	1,032,728		10,327	
5月末日	1,563,823		10,214	
6月末日	1,494,732		9,763	
7月末日	136,033,072		9,824	
8月末日	542,407,364		9,676	
9月末日	575,862,860		9,896	
10月末日	1,344,614,073		10,065	
11月末日	1,735,682,303		10,168	

分配の推移

期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間(平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	0

収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	0.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	54,750,331		54,750,331

(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)

ART テクニカル運用日本株式 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(%)
株式	日本	8,423,864,600	28.16
国債証券	日本	12,996,737,000	43.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,493,349,868	28.39
合計(純資産総額)		29,913,951,468	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	業種	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375回国庫 短期証券		13,000,000,000	99.97	12,996,568,000	99.97	12,996,737,000	0.0	2014/06/20	43.45
日本	株式	アルプス電気	電気機 器	268,400	1,127.00	302,486,800	1,107.00	297,118,800			0.99
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	110,900	2,322.02	257,512,110	2,252.00	249,746,800			0.83
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	124,000	1,982.00	245,768,000	1,990.00	246,760,000			0.82
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	48,700	4,921.54	239,679,311	4,975.00	242,282,500			0.81
日本	株式	日本碍子	ガラ ス・土 石製品	84,000	1,809.00	151,956,000	1,875.00	157,500,000			0.53
日本	株式	パイオニア	電気機 器	702,000	224.00	157,248,000	216.00	151,632,000			0.51
日本	株式	ダイキン工業	機械	22,700	6,540.00	148,458,000	6,500.00	147,550,000			0.49
日本	株式	カシオ計算機	電気機 器	125,900	1,100.00	138,490,000	1,161.00	146,169,900			0.49
日本	株式	本田技研工業	輸送用 機器	33,100	4,365.00	144,481,500	4,330.00	143,323,000			0.48
日本	株式	シチズンホール ディングス	精密機 器	181,900	773.00	140,608,700	787.00	143,155,300			0.48
日本	株式	ソフトバンク	情報・ 通信業	17,200	8,590.00	147,748,000	8,290.00	142,588,000			0.48
日本	株式	ヤマハ	その他 製品	87,900	1,573.00	138,266,700	1,613.00	141,782,700			0.47

日本	株式	ミネベア	電気機器	189,000	711.00	134,379,000	723.00	136,647,000		0.46
日本	株式	日産化学工業	化学	84,800	1,608.00	136,358,400	1,607.00	136,273,600		0.46
日本	株式	マツダ	輸送用機器	288,000	475.00	136,800,000	471.00	135,648,000		0.45
日本	株式	宇部興産	化学	631,000	215.00	135,665,000	214.00	135,034,000		0.45
日本	株式	大日本住友製薬	医薬品	90,900	1,485.00	134,986,500	1,475.00	134,077,500		0.45
日本	株式	協和発酵キリン	医薬品	112,000	1,179.00	132,048,000	1,193.00	133,616,000		0.45
日本	株式	電通	サービス業	31,300	4,240.00	132,712,000	4,260.00	133,338,000		0.45
日本	株式	昭和電工	化学	838,000	162.00	135,756,000	159.00	133,242,000		0.45
日本	株式	明治ホールディングス	食料品	23,100	5,820.00	134,442,000	5,720.00	132,132,000		0.44
日本	株式	宝ホールディングス	食料品	131,000	1,026.00	134,406,000	1,002.00	131,262,000		0.44
日本	株式	KDDI	情報・通信業	20,300	6,460.00	131,138,000	6,430.00	130,529,000		0.44
日本	株式	横浜ゴム	ゴム製品	123,000	1,017.00	125,091,000	1,060.00	130,380,000		0.44
日本	株式	大平洋金属	鉄鋼	330,000	398.00	131,340,000	395.00	130,350,000		0.44
日本	株式	日立製作所	電気機器	172,000	731.00	125,732,000	755.00	129,860,000		0.43
日本	株式	東邦亜鉛	非鉄金属	403,000	322.00	129,766,000	322.00	129,766,000		0.43
日本	株式	キヤノン	電気機器	38,000	3,325.00	126,350,000	3,410.00	129,580,000		0.43
日本	株式	キリンホールディングス	食料品	82,000	1,588.00	130,216,000	1,578.00	129,396,000		0.43

(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	28.16
国債証券	43.45
合計	71.61

(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	建設業	1.21
		食料品	1.31
		繊維製品	0.41
		化学	1.76
		医薬品	3.79
		ゴム製品	0.44

	ガラス・土石製品	2.21
	鉄鋼	0.44
	非鉄金属	0.86
	金属製品	0.43
	機械	2.34
	電気機器	5.29
	輸送用機器	0.93
	精密機器	0.48
	その他製品	0.47
	電気・ガス業	0.40
	陸運業	1.60
	情報・通信業	1.74
	卸売業	0.80
	銀行業	0.42
	不動産業	0.40
	サービス業	0.45
合計		28.16

(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

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	196,181,790,900	77.83
	ポーランド	200,048,000	0.08
	小計	196,381,838,900	77.91
地方債証券	日本	16,002,721,745	6.35
特殊債券	日本	22,101,456,353	8.77
	アメリカ	208,692,000	0.08
	韓国	201,150,000	0.08
	スウェーデン	101,183,000	0.04
	小計	22,612,481,353	8.97
社債券	日本	14,428,989,260	5.72
	オーストラリア	407,267,000	0.16
	オランダ	406,256,000	0.16
	アメリカ	207,741,000	0.08
	スウェーデン	102,582,000	0.04
	イギリス	100,981,000	0.04
	小計	15,653,816,260	6.21

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1,426,245,846	0.57
合計(純資産総額)	252,077,104,104	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97回利付国債(5年)	3,630,000,000	100.67	3,654,364,800	100.77	3,658,096,200	0.4	2016/06/20	1.45
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	3,430,000,000	100.36	3,442,590,800	100.58	3,450,099,800	0.3	2018/06/20	1.37
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,060,000,000	99.70	3,050,869,800	100.26	3,068,078,400	0.2	2017/06/20	1.22
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,890,000,000	101.48	2,932,865,700	101.85	2,943,465,000	0.8	2023/09/20	1.17
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,640,000,000	97.67	2,578,603,100	100.30	2,648,157,600	0.6	2023/03/20	1.05
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	2,570,000,000	100.65	2,586,859,200	100.54	2,583,929,400	0.5	2015/03/20	1.03
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	2,430,000,000	105.16	2,555,462,700	105.45	2,562,459,300	1.5	2017/12/20	1.02
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,490,000,000	100.61	2,505,224,000	101.98	2,539,526,100	0.8	2023/06/20	1.01
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	2,390,000,000	105.26	2,515,717,000	105.21	2,514,686,300	1.7	2017/03/20	1.00
日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	2,260,000,000	98.94	2,236,044,000	102.24	2,310,669,200	0.8	2022/12/20	0.92
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	105.41	2,213,684,000	106.32	2,232,888,000	1.5	2018/09/20	0.89
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,170,000,000	99.33	2,155,537,000	102.35	2,221,103,500	0.8	2022/09/20	0.88
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	105.68	2,208,774,700	105.93	2,213,978,800	1.7	2017/09/20	0.88
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1,960,000,000	105.19	2,061,812,700	106.28	2,083,205,600	1.3	2019/12/20	0.83
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1,930,000,000	106.13	2,048,448,500	106.78	2,060,950,500	1.4	2019/09/20	0.82
日本	国債証券	第270回利付国債(10年)	2,000,000,000	102.26	2,045,245,400	101.88	2,037,640,000	1.3	2015/06/20	0.81
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	1,980,000,000	100.12	1,982,507,000	100.59	1,991,721,600	0.3	2016/12/20	0.79
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	1,880,000,000	99.27	1,866,276,000	100.24	1,884,606,000	0.2	2017/09/20	0.75
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	1,840,000,000	100.24	1,844,493,000	100.60	1,851,150,400	0.3	2017/03/20	0.73

日本	国債証券	第99回利付国債（5年）	1,800,000,000	100.49	1,808,820,000	100.82	1,814,796,000	0.4	2016/09/20	0.72
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	1,710,000,000	104.03	1,779,024,500	105.80	1,809,333,900	1.2	2020/12/20	0.72
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	1,710,000,000	102.57	1,753,962,000	104.48	1,786,744,800	1.0	2020/09/20	0.71
日本	国債証券	第298回利付国債（10年）	1,660,000,000	104.48	1,734,368,000	105.62	1,753,408,200	1.3	2018/12/20	0.70
日本	国債証券	第319回利付国債（10年）	1,650,000,000	102.98	1,699,275,000	105.00	1,732,599,000	1.1	2021/12/20	0.69
日本	国債証券	第333回利付国債（2年）	1,700,000,000	100.00	1,700,167,200	100.03	1,700,629,000	0.1	2015/10/15	0.67
日本	国債証券	第322回利付国債（10年）	1,630,000,000	101.34	1,651,942,000	103.39	1,685,273,300	0.9	2022/03/20	0.67
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	1,580,000,000	101.03	1,596,274,000	104.23	1,646,834,000	1.0	2021/12/20	0.65
日本	国債証券	第273回利付国債（10年）	1,590,000,000	103.09	1,639,146,900	102.54	1,630,513,200	1.5	2015/09/20	0.65
日本	国債証券	第89回利付国債（5年）	1,610,000,000	100.53	1,618,565,200	100.49	1,617,937,300	0.4	2015/06/20	0.64
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	1,510,000,000	104.67	1,580,627,800	106.52	1,608,572,800	1.3	2021/03/20	0.64

(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	77.91
地方債証券	6.35
特殊債券	8.97
社債券	6.21
合計	99.43

(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	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	2	290,160,630	290,200,000	290,200,000	0.12

(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。

外国株式インデックス 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(%)
株式	アメリカ	89,662,482,129	53.59
	イギリス	15,434,120,427	9.23
	カナダ	7,242,759,685	4.33
	スイス	7,228,447,113	4.32
	ドイツ	6,844,838,938	4.09
	フランス	6,775,059,543	4.05
	オーストラリア	5,211,155,900	3.11
	オランダ	2,706,030,023	1.62
	スペイン	2,424,305,013	1.45
	スウェーデン	2,322,135,369	1.39
	香港	1,738,304,710	1.04
	イタリア	1,539,826,136	0.92
	アイルランド	1,380,137,002	0.82
	シンガポール	1,052,260,808	0.63
	ジャージー	857,611,821	0.51
	ベルギー	854,283,816	0.51
	デンマーク	851,175,042	0.51
	フィンランド	684,726,593	0.41
	アンティル	655,653,577	0.39
	バミューダ	643,500,569	0.38
	ノルウェー	486,685,479	0.29
	イスラエル	334,303,943	0.20
	ルクセンブルク	304,187,327	0.18
	オーストリア	210,556,022	0.13
	ケイマン	204,615,161	0.12
	ポルトガル	135,424,308	0.08
	ニュージーランド	91,177,821	0.05
	英ヴァージン諸島	87,776,856	0.05
	パナマ	80,844,212	0.05
	ガーンジー	48,460,447	0.03
	マン島	43,986,888	0.03
	リベリア	40,675,588	0.02
モーリシャス	20,832,480	0.01	
小計	158,198,340,746	94.56	
投資信託受益証券	オーストラリア	68,452,577	0.04
	シンガポール	15,715,324	0.01
	香港	11,213,969	0.01
	小計	95,381,870	0.06
投資証券	アメリカ	2,082,501,252	1.24

	オーストラリア	375,001,515	0.22
	フランス	221,553,961	0.13
	イギリス	205,614,349	0.12
	香港	62,417,250	0.04
	シンガポール	57,144,888	0.03
	カナダ	33,717,283	0.02
	オランダ	15,431,532	0.01
	小計	3,053,382,030	1.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,958,629,821	3.56
合計(純資産総額)		167,305,734,467	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	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	50,094	45,212.28	2,264,864,194	55,917.22	2,801,117,378	1.67
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	242,460	9,461.55	2,294,049,740	9,606.99	2,329,312,250	1.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	436,215	3,585.72	1,564,146,681	3,850.99	1,679,860,475	1.00
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・ サービス	15,100	90,259.67	1,362,921,068	108,883.72	1,644,144,265	0.98
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	560,803	2,417.11	1,355,523,660	2,747.92	1,541,046,602	0.92
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	155,181	8,973.01	1,392,441,626	9,727.85	1,509,577,739	0.90
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	106,376	12,948.96	1,377,458,632	12,538.25	1,333,769,562	0.80
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバ コ	177,248	7,411.32	1,313,642,533	7,490.52	1,327,681,461	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	150,771	8,281.68	1,248,637,356	8,631.95	1,301,448,879	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	277,718	4,150.05	1,152,545,918	4,534.13	1,259,210,459	0.75
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	207,231	5,592.13	1,158,863,106	5,887.10	1,219,989,951	0.73
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	364,473	2,966.08	1,081,057,242	3,265.14	1,190,058,870	0.71
イギリ ス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,040,801	1,243.93	1,294,684,212	1,141.80	1,188,391,161	0.71

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	38,692	28,581.68	1,105,882,749	28,536.42	1,104,131,549	0.66
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	295,418	3,705.55	1,094,687,824	3,626.69	1,071,390,156	0.64
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	57,340	21,280.82	1,220,242,654	18,330.10	1,051,048,358	0.63
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	126,673	8,078.90	1,023,379,766	8,056.27	1,020,513,156	0.61
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	2,666,388	329.81	879,421,157	382.63	1,020,262,464	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	591,240	1,367.30	808,406,590	1,621.30	958,582,496	0.57
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	167,352	5,304.33	887,690,535	5,433.38	909,287,177	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	219,578	4,357.97	956,914,556	4,116.25	903,840,094	0.54
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,036,994	806.96	836,817,241	806.12	835,949,173	0.50
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	161,018	4,877.24	785,323,494	5,103.58	821,769,629	0.49
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	159,137	5,204.98	828,305,602	5,113.83	813,799,660	0.49
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	20,110	27,375.84	550,528,178	39,606.83	796,493,516	0.48
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	89,065	9,561.93	851,633,402	8,756.90	779,934,189	0.47
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品 小売り	90,134	7,919.11	713,781,457	8,288.85	747,107,259	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	84,849	8,442.48	716,336,036	8,646.29	733,629,603	0.44
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	117,581	5,588.16	657,061,699	6,214.33	730,688,029	0.44
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	269,422	2,983.42	803,800,168	2,697.97	726,893,362	0.43

(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	94.56
投資信託受益証券	0.06
投資証券	1.83
合計	96.44

(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

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	9.81
		素材	5.40
		資本財	7.51
		商業・専門サービス	0.91
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	1.71
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.69
		メディア	2.90
		小売	3.11
		食品・生活必需品小売り	2.21
		食品・飲料・タバコ	6.00
		家庭用品・パーソナル用品	1.84
		ヘルスケア機器・サービス	2.91
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.58
		銀行	7.71
		各種金融	5.83
		保険	4.25
		不動産	0.68
		ソフトウェア・サービス	6.26
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.84		
電気通信サービス	3.46		
公益事業	3.08		
半導体・半導体製造装置	1.41		
合計			94.56

(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	76	34,086,342	34,281,700	3,511,131,714	2.10
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	20	3,108,970	3,079,200	298,004,976	0.18
	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	34	2,813,248	2,806,360	317,539,634	0.19
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	146	4,446,357	4,512,860	629,363,455	0.38

SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	27	3,580,014	3,612,600	336,260,808	0.20
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	61	4,080,928.75	4,058,940	679,547,734	0.41

(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

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	89,229,750,660	38.90
	イタリア	23,090,500,295	10.07
	フランス	23,019,759,575	10.04
	ドイツ	20,212,441,208	8.81
	イギリス	17,711,658,127	7.72
	スペイン	12,191,333,441	5.32
	オランダ	6,391,908,768	2.79
	ベルギー	6,250,384,723	2.73
	カナダ	5,697,430,700	2.48
	オーストリア	3,824,913,699	1.67
	オーストラリア	3,267,761,021	1.42
	メキシコ	2,346,259,084	1.02
	デンマーク	1,986,536,463	0.87
	アイルランド	1,863,315,955	0.81
	ポーランド	1,858,869,860	0.81
	フィンランド	1,491,075,495	0.65
	スウェーデン	1,258,283,258	0.55
	マレーシア	1,139,811,366	0.50
	南アフリカ	1,133,641,501	0.49
	スイス	852,411,449	0.37
シンガポール	829,949,676	0.36	
ノルウェー	748,530,471	0.33	
小計		226,396,526,795	98.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,973,953,238	1.30
合計(純資産総額)		229,370,480,033	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			
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/30/15	34,400,000	10,246.09	3,524,657,299	10,265.60	3,531,367,993	0.375	2015/06/30	1.54
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,491.90	2,916,749,534	10,463.84	2,908,948,452	1.375	2015/11/30	1.27
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	10,251.00	2,070,703,270	10,266.20	2,073,773,351	0.375	2015/06/15	0.90
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	10,618.67	2,038,785,314	10,520.45	2,019,927,240	2.375	2015/02/28	0.88
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	10,217.19	1,982,135,870	10,220.59	1,982,795,596	0.750	2017/06/30	0.86
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,174.98	1,831,497,642	10,212.99	1,838,338,982	0.250	2016/04/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,223.19	1,625,488,462	10,238.79	1,627,969,100	0.250	2015/10/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,558.26	1,583,739,269	10,499.45	1,574,917,542	1.750	2015/07/31	0.69
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	14,000,000	10,302.42	1,442,339,892	10,306.61	1,442,925,761	0.875	2017/02/28	0.63
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,226.79	1,431,751,591	10,244.00	1,434,160,051	0.250	2015/07/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	11,344.81	1,452,136,362	11,108.76	1,421,922,469	3.125	2019/05/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,575.46	1,385,385,924	10,509.25	1,376,712,036	1.875	2015/06/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,253.26	1,363,684,404	10,289.60	1,368,518,039	0.625	2016/07/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	11,124.97	1,390,621,555	10,944.53	1,368,067,147	4.250	2015/08/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	10,533.05	1,327,165,162	10,443.23	1,315,848,154	2.125	2014/11/30	0.57
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000	14,839.65	1,305,890,051	14,642.60	1,288,549,037	3.250	2015/07/04	0.56
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	10,097.82	1,262,228,197	9,711.89	1,213,987,063	2.000	2023/02/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	10,258.40	1,179,716,365	10,267.00	1,180,705,565	0.375	2015/04/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/30/17	11,500,000	10,091.09	1,160,475,570	10,096.77	1,161,128,735	0.625	2017/11/30	0.51
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	14,835.54	1,172,008,103	14,597.20	1,153,179,469	3.500	2015/04/25	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,740.49	1,150,568,272	11,550.45	1,131,944,642	4.500	2017/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,668.68	1,098,874,385	10,615.67	1,093,414,320	2.000	2016/01/31	0.48
イギリス	国債証券	UKT 1% 09/07/17	6,550,000	16,825.67	1,102,081,744	16,638.28	1,089,807,556	1.000	2017/09/07	0.48

アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	10,059.06	1,106,497,675	9,874.32	1,086,176,099	1.250	2020/02/29	0.47
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	16,477.84	1,087,537,529	16,255.94	1,072,892,416	4.250	2019/04/25	0.47
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	6,300,000	16,971.64	1,069,213,462	16,993.34	1,070,580,448	6.500	2027/11/01	0.47
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000	14,908.87	1,028,712,604	15,217.87	1,050,033,388	4.500	2018/08/01	0.46
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	11,113.17	1,055,751,156	11,005.74	1,045,546,165	3.000	2017/02/28	0.46
スペイン	国債証券	SPGB 4.4% 01/31/15	7,150,000	14,593.14	1,043,410,154	14,513.88	1,037,742,500	4.400	2015/01/31	0.45
ドイツ	国債証券	DBR 3.5% 01/04/16	6,900,000	15,108.31	1,042,473,401	14,933.72	1,030,427,056	3.500	2016/01/04	0.45

(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	98.70
合計	98.70

(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	3	363,269.82	362,929.68	37,171,257	0.02
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	1	125,785.25	125,484.38	12,852,110	0.01
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	1	131,238.38	130,750	13,391,415	0.01

(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

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	韓国	3,571,203,827	15.67
	台湾	2,455,290,574	10.77

中国	2,404,574,253	10.55	
ブラジル	2,384,163,834	10.46	
南アフリカ	1,576,285,446	6.91	
インド	1,325,333,658	5.81	
ロシア	1,294,848,304	5.68	
メキシコ	1,156,360,982	5.07	
香港	995,481,177	4.37	
ケイマン	881,797,367	3.87	
マレーシア	823,915,342	3.61	
タイ	521,390,507	2.29	
インドネシア	483,634,371	2.12	
ポーランド	390,142,293	1.71	
トルコ	383,286,457	1.68	
チリ	353,913,966	1.55	
バミューダ	196,066,067	0.86	
フィリピン	195,147,855	0.86	
コロンビア	194,846,930	0.85	
ギリシャ	84,852,545	0.37	
チェコ	59,506,445	0.26	
ハンガリー	51,595,834	0.23	
エジプト	40,924,976	0.18	
ペルー	20,062,039	0.09	
アメリカ	16,471,286	0.07	
ルクセンブルク	4,381,022	0.02	
小計	21,865,477,357	95.92	
投資信託受益証券	ブラジル	46,961,505	0.21
	南アフリカ	16,243,167	0.07
	メキシコ	9,777,908	0.04
	小計	72,982,580	0.32
投資証券	メキシコ	22,732,635	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	834,001,667	3.66	
合計(純資産総額)	22,795,194,239	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	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	6,160	136,629.00	841,634,640	144,768.60	891,774,576	3.91
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造 装置	1,375,389	366.75	504,437,669	363.29	499,678,823	2.19

香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	337,000	1,063.40	358,367,485	1,091.14	367,716,202	1.61
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	57,600	5,302.49	305,423,654	5,838.82	336,316,032	1.48
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	4,010,620	77.93	312,583,712	82.56	331,126,813	1.45
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,117,515	68.95	283,928,187	73.31	301,877,670	1.32
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	333,444	921.77	307,362,010	880.29	293,530,719	1.29
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,989,240	108.05	214,945,338	119.01	236,751,387	1.04
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	8,768	24,079.64	211,130,371	24,709.50	216,652,896	0.95
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	22,211	9,216.71	204,712,567	9,738.79	216,308,486	0.95
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	163,438	1,273.08	208,069,747	1,270.00	207,567,567	0.91
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,205,200	46.76	196,649,449	49.14	206,648,574	0.91
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	990,000	201.84	199,830,312	207.39	205,323,030	0.90
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	140,190	1,420.82	199,185,989	1,438.05	201,601,491	0.88
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	233,840	867.69	202,901,845	824.39	192,777,415	0.85
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	247,200	767.28	189,672,717	771.38	190,685,828	0.84
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	94,638	1,990.93	188,417,822	1,999.96	189,272,971	0.83
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	29,415	6,472.94	190,401,647	6,329.55	186,183,889	0.82
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	619,352	255.69	158,364,590	262.61	162,650,506	0.71
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	117,700	1,359.86	160,055,569	1,356.32	159,639,570	0.70
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	108,015	1,451.75	156,811,294	1,427.01	154,138,917	0.68
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	30,367	5,080.03	154,265,550	5,070.19	153,966,763	0.68
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	25,908	5,544.08	143,636,089	5,490.86	142,257,459	0.62
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,178,000	113.73	133,983,481	120.21	141,608,558	0.62
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	423,000	270.80	114,550,515	328.92	139,136,967	0.61
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	165,600	828.37	137,178,900	783.31	129,716,367	0.57
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,415,400	82.95	117,419,885	87.97	124,524,910	0.55
韓国	株式	POSCO	素材	3,612	31,492.50	113,750,910	31,444.04	113,575,908	0.50
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	84,191	1,335.42	112,430,976	1,343.26	113,090,823	0.50
韓国	株式	HYUNDAI MOBIS	自動車・自動車部品	3,737	29,602.94	110,626,224	29,748.29	111,169,397	0.49

(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	95.92
投資信託受益証券	0.32
投資証券	0.10
合計	96.34

(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	11.11
		素材	9.04
		資本財	4.46
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.58
		自動車・自動車部品	3.74
		耐久消費財・アパレル	0.92
		消費者サービス	0.78
		メディア	1.62
		小売	1.72
		食品・生活必需品小売り	2.20
		食品・飲料・タバコ	5.14
		家庭用品・パーソナル用品	1.03
		ヘルスケア機器・サービス	0.61
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.97
		銀行	17.97
		各種金融	2.42
		保険	3.44
		不動産	1.87
		ソフトウェア・サービス	3.70
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.02		
電気通信サービス	7.08		
公益事業	3.05		
半導体・半導体製造装置	8.35		
合計			95.92

(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	160	8,049,245	8,089,600	828,536,832	3.63

(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

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	ポーランド	2,632,546,412	10.25
	マレーシア	2,570,516,974	10.00
	メキシコ	2,562,852,807	9.97
	ロシア	2,560,418,601	9.97
	トルコ	2,546,812,006	9.91
	南アフリカ	2,517,659,329	9.80
	ブラジル	2,468,850,757	9.61
	タイ	1,885,049,650	7.34
	インドネシア	1,798,410,175	7.00
	ハンガリー	1,474,767,322	5.74
	コロンビア	896,493,408	3.49
	ナイジェリア	510,341,904	1.99
	ペルー	433,538,545	1.69
	フィリピン	145,489,195	0.57
	チリ	39,980,164	0.16
	小計	25,043,727,249	97.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		650,057,643	2.53
合計(純資産総額)		25,693,784,892	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			
ロシア	国債証券	RFLB 7% 06/03/15	248,100,000	314.13	779,366,081	313.06	776,704,961	7.000	2015/06/03	3.02
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	230,000,000	322.37	741,466,525	318.19	731,858,850	7.850	2018/03/10	2.85
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	202,600,000	319.74	647,806,206	312.92	633,992,026	7.600	2021/04/14	2.47

コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	8,750,000,000	6.01	526,508,403	5.99	524,617,380	12.000	2015/10/22	2.04
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	14,000,000	3,474.58	486,441,857	3,479.65	487,151,622	0.000	2016/01/01	1.90
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	41,000,000	1,181.69	484,496,163	1,175.43	481,927,530	10.500	2026/12/21	1.88
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	4,659.95	442,695,418	4,657.08	442,422,606	12.500	2016/01/05	1.72
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	9,500,000	4,550.93	432,339,163	4,426.04	420,474,140	7.100	2023/03/08	1.64
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	132,000,000	324.87	428,829,324	316.56	417,862,764	8.150	2027/02/03	1.63
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000	4,187.58	397,820,442	4,188.33	397,891,841	10.000	2017/01/01	1.55
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000	3,809.24	390,447,487	3,823.06	391,863,746	0.000	2015/04/01	1.53
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	10,100,000	3,451.03	348,554,409	3,446.79	348,126,747	5.500	2015/04/25	1.35
トルコ	国債証券	TURKGB 10.5% 01/15/20	6,200,000	5,491.57	340,477,471	5,412.64	335,583,699	10.500	2020/01/15	1.31
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000	50.01	337,567,821	49.50	334,167,233	7.000	2019/10/23	1.30
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	98,000,000	319.55	313,167,085	320.65	314,242,497	3.250	2017/06/16	1.22
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,468.43	306,956,567	3,464.83	306,637,677	4.750	2016/10/25	1.19
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	9,600,000	3,150.42	302,441,247	3,142.22	301,653,307	3.314	2017/10/31	1.17
マレーシア	国債証券	MGS 3.172% 07/15/16	9,050,000	3,172.40	287,102,804	3,173.67	287,217,521	3.172	2016/07/15	1.12
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	28,700,000	993.76	285,210,331	988.26	283,631,280	7.250	2020/01/15	1.10
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	5,500,000	5,135.11	282,431,051	5,088.23	279,852,823	9.000	2017/03/08	1.09
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000	3,672.90	277,304,687	3,633.29	274,313,412	5.750	2022/09/23	1.07
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	26,000,000	1,050.41	273,107,879	1,044.78	271,644,750	8.250	2017/09/15	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	24,000,000	1,130.72	271,375,176	1,125.80	270,192,062	13.500	2015/09/15	1.05
トルコ	国債証券	TURKGB 6.5% 01/07/15	5,000,000	4,986.58	249,329,313	4,954.48	247,724,028	6.500	2015/01/07	0.96
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	4,170,000,000	5.96	248,873,983	5.93	247,292,995	7.750	2021/04/14	0.96
マレーシア	国債証券	MGS 3.741% 02/27/15	7,700,000	3,200.13	246,410,427	3,198.56	246,289,641	3.741	2015/02/27	0.96
ハンガリー	国債証券	HGB 8% 02/12/15	500,000,000	49.05	245,288,330	49.14	245,710,499	8.000	2015/02/12	0.96

南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	23,600,000	1,040.93	245,659,985	1,034.34	244,105,632	8.000	2018/12/21	0.95
ポーランド	国債証券	POLGB 3.75% 04/25/18	7,300,000	3,352.13	244,705,809	3,331.34	243,188,178	3.750	2018/04/25	0.95
トルコ	国債証券	TURKGB 10% 06/17/15	4,670,000	5,206.55	243,146,105	5,154.98	240,737,685	10.000	2015/06/17	0.94

(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	97.47
合計	97.47

(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

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	18,269,274,400	98.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		218,134,782	1.18
合計(純資産総額)		18,487,409,182	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)		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	1,768	1,184,921.35	2,094,940,946	1,204,000.00	2,128,672,000	11.51
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,518	1,081,835.60	1,642,226,440	1,082,000.00	1,642,476,000	8.88
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	5,896	195,414.66	1,152,164,835	202,000.00	1,190,992,000	6.44
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,080	145,212.17	882,889,993	146,900.00	893,152,000	4.83
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,107	329,004.79	693,213,092	343,000.00	722,701,000	3.91
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	713	927,244.05	661,125,007	990,000.00	705,870,000	3.82
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3,167	218,990.04	693,541,456	222,100.00	703,390,700	3.80

日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	633	947,923.15	600,035,353	958,000.00	606,414,000	3.28
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	674	861,837.32	580,878,353	858,000.00	578,292,000	3.13
日本	投資証券	G L P 投資法人	5,358	98,301.62	526,700,079	102,500.00	549,195,000	2.97
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,299	120,712.91	518,944,800	127,700.00	548,982,300	2.97
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	707	659,025.11	465,930,752	700,000.00	494,900,000	2.68
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	952	484,445.63	461,192,239	485,500.00	462,196,000	2.50
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,254	99,900.73	424,977,705	100,600.00	427,952,400	2.31
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,011	417,013.75	421,600,901	422,000.00	426,642,000	2.31
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	424	1,003,896.93	425,652,298	997,000.00	422,728,000	2.29
日本	投資証券	アクティピア・プロパティーズ投資法人	524	789,965.72	413,942,037	793,000.00	415,532,000	2.25
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	589	691,981.41	407,577,050	699,000.00	411,711,000	2.23
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	844	438,542.24	370,129,650	477,000.00	402,588,000	2.18
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	955	407,016.65	388,700,900	405,500.00	387,252,500	2.09
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	400	883,996.41	353,598,564	900,000.00	360,000,000	1.95
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	575	603,965.57	347,280,202	606,000.00	348,450,000	1.88
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,695	45,157.39	302,328,726	48,200.00	322,699,000	1.75
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	499	592,040.86	295,428,389	612,000.00	305,388,000	1.65
日本	投資証券	福岡リート投資法人	352	781,105.77	274,949,231	811,000.00	285,472,000	1.54
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	3,734	65,083.10	243,020,295	64,200.00	239,722,800	1.30
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	313	743,964.36	232,860,844	749,000.00	234,437,000	1.27
日本	投資証券	プレミアム投資法人	556	399,950.07	222,372,238	399,000.00	221,844,000	1.20
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	411	559,906.52	230,121,579	539,000.00	221,529,000	1.20
日本	投資証券	積水ハウス・S I 投資法人	408	486,524.52	198,502,004	497,000.00	202,776,000	1.10

(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	98.82
合計	98.82

(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	149	213,450,000	218,434,000	218,434,000	1.18

(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

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	15,429,012,922	66.36
	オーストラリア	2,335,191,752	10.04
	イギリス	1,524,910,158	6.56
	フランス	1,298,259,222	5.58
	シンガポール	915,815,658	3.94
	カナダ	645,790,985	2.78
	香港	435,449,946	1.87
	オランダ	260,352,480	1.12
	ベルギー	139,630,618	0.60
	ニュージーランド	85,490,893	0.37
	ドイツ	45,479,982	0.20
	イタリア	22,252,121	0.10
	イスラエル	6,409,534	0.03
	ギリシャ	4,719,326	0.02
	小計	23,148,765,597	99.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		103,298,825	0.44
合計(純資産総額)		23,252,064,422	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)		投資比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	92,050	15,671.28	1,442,541,710	15,540.18	1,430,474,176	6.15
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	28,800	26,657.77	767,744,035	26,846.05	773,166,240	3.33
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	42,620	16,377.98	698,029,601	15,792.13	673,060,998	2.89
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	148,290	3,989.25	591,567,217	3,942.14	584,580,800	2.51
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	593,200	1,008.98	598,531,207	971.75	576,445,184	2.48
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	99,050	5,295.11	524,481,041	5,326.86	527,625,899	2.27

アメリカ	投資証券	HCP INC	135,300	4,058.90	549,169,792	3,827.43	517,852,009	2.23
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	87,170	6,305.99	549,693,967	5,903.48	514,607,118	2.21
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	85,230	6,187.19	527,334,391	5,814.38	495,559,897	2.13
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	51,650	9,021.15	465,942,583	9,131.76	471,655,775	2.03
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	45,280	10,275.79	465,288,160	10,407.92	471,270,635	2.03
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	35,920	12,478.85	448,240,392	12,261.72	440,441,068	1.89
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	220,660	1,905.01	420,359,947	1,900.91	419,455,948	1.80
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	230,300	1,632.34	375,929,053	1,597.18	367,832,120	1.58
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	163,330	2,096.53	342,427,453	2,147.74	350,791,582	1.51
香港	投資証券	LINK REIT	686,000	501.31	343,905,177	499.33	342,545,868	1.47
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	295,800	1,029.63	304,565,441	1,022.09	302,336,913	1.30
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	27,440	9,350.94	256,589,958	9,389.86	257,657,912	1.11
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	120,420	2,150.81	259,001,744	2,138.52	257,521,734	1.11
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	881,400	282.03	248,583,357	281.10	247,762,950	1.07
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	41,290	5,792.87	239,187,817	5,896.31	243,459,028	1.05
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	681,500	376.04	256,273,440	354.63	241,683,616	1.04
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	58,510	4,102.94	240,063,323	3,925.75	229,696,135	0.99
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,270	10,757.17	207,290,716	10,744.88	207,053,879	0.89
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	454,130	470.98	213,888,327	454.23	206,279,651	0.89
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	38,000	4,691.86	178,290,687	4,837.29	183,817,270	0.79
アメリカ	投資証券	COLE REAL ESTATE INVESTMENT	123,600	1,380.62	170,644,829	1,480.99	183,050,759	0.79
アメリカ	投資証券	UDR INC	75,110	2,431.45	182,626,269	2,427.35	182,318,558	0.78
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	210,300	867.23	182,379,646	857.19	180,267,141	0.78
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	11,190	15,874.07	177,630,908	15,675.38	175,407,513	0.75

(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	99.56
合計	99.56

(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

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	イギリス	7,180,101,455	81.16
	ジャージー	1,310,163,399	14.81
	アメリカ	273,462,116	3.09
	小計	8,763,726,970	99.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		83,291,455	0.94
合計(純資産総額)		8,847,018,425	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			
イギリス	社債券	CS USD COM 005 08/11/14	15,000,000	10,471.21	1,570,682,394	10,012.57	1,501,886,880	0.0	2014/08/11	16.98
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	99,860,000	1,396.90	1,394,950,169	1,312.00	1,310,163,399	0.0		14.81
イギリス	社債券	UBS USD COM 004 08/11/14	13,000,000	10,365.29	1,347,488,730	10,028.96	1,303,765,632	0.0	2014/08/11	14.74
イギリス	社債券	BAR USD COM 024 07/25/14	10,000,000	10,268.06	1,026,806,589	9,767.69	976,769,298	0.0	2014/07/25	11.04
イギリス	社債券	UBS USD COM 003 05/16/14	9,200,000	9,899.44	910,749,366	9,449.26	869,332,766	0.0	2014/05/16	9.83
イギリス	社債券	CS USD COM 006 10/24/14	6,000,000	10,298.33	617,899,860	9,882.50	592,950,348	0.0	2014/10/24	6.70
イギリス	社債券	BAR USD COM 025 08/29/14	6,000,000	10,196.25	611,775,144	9,694.76	581,686,196	0.0	2014/08/29	6.57
イギリス	社債券	BAR USD COM 022 04/25/14	5,000,000	10,212.22	510,611,018	9,580.36	479,018,340	0.0	2014/04/25	5.41
イギリス	社債券	BAR USD COM 023 06/27/14	5,000,000	10,151.05	507,552,552	9,503.65	475,182,711	0.0	2014/06/27	5.37
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	7,390,000	3,973.89	293,670,914	3,700.43	273,462,116	0.0	2036/06/12	3.09
イギリス	社債券	BAR USD COM 021 01/31/14	2,700,000	9,880.93	266,785,152	9,284.16	250,672,540	0.0	2014/01/31	2.83
イギリス	社債券	UBS USD COM 005 11/05/14	1,500,000	10,236.87	153,553,185	9,922.44	148,836,744	0.0	2014/11/05	1.68

(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	99.06
合計	99.06

(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

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ケイマン	4,528,526,100	94.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		241,231,180	5.06
合計(純資産総額)		4,769,757,280	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			
ケイマン	社債券	QUART X 0% 03/3 1/22	5,145,000,000	86.87	4,469,878,300	88.01	4,528,526,100	0.0	2022/03/31	94.94

(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	94.94
合計	94.94

(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。

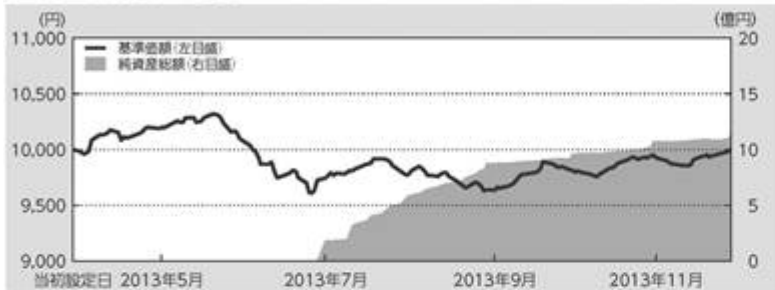
(参考情報) 交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日: 2013年3月29日
作成基準日: 2013年11月29日

分散投資コア戦略ファンドA

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額: 0円

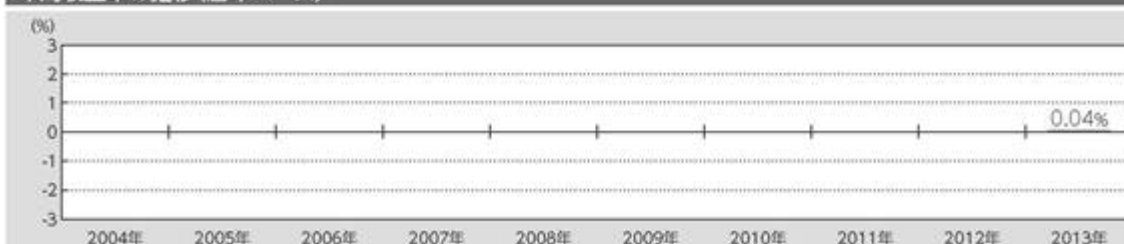
決算期	2013年7月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内債券インデックス マザーファンド	12.2%
FRM シグマリンク マザーファンド	9.3%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{A, H, JPY}	9.1%
TCAファンド(適格機関投資家専用)	8.9%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	8.9%
FOFs 用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	8.3%
FOFs 用外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)	7.2%
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)	7.2%
外国債券インデックス マザーファンド	5.8%
新興国債券インデックス マザーファンド	5.6%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。

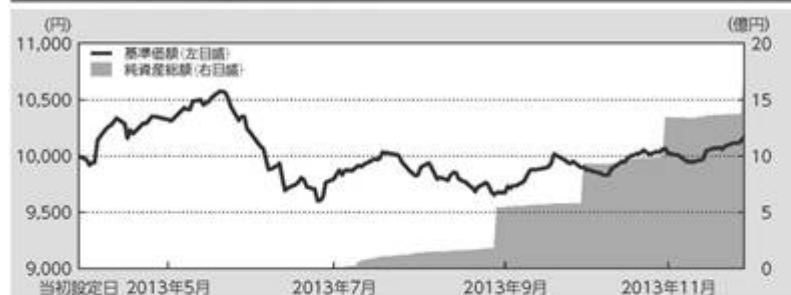
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

当初設定日: 2013年3月29日
作成基準日: 2013年11月29日

分散投資コア戦略ファンドS

基準価額・純資産の推移



基準価額	10,168円
純資産総額	17億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額: 0円

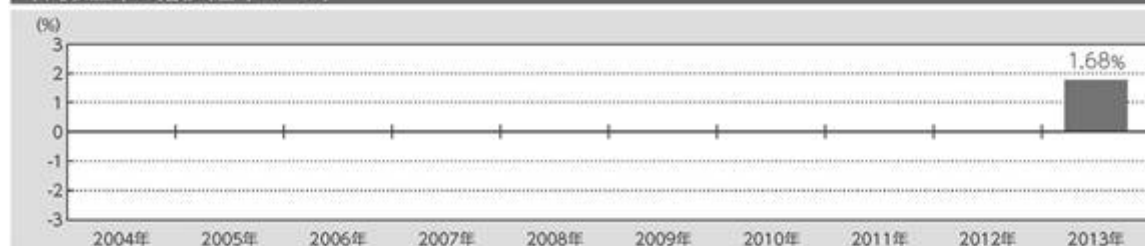
決算期	2013年7月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	11.1%
外国債券インデックス マザーファンド	9.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	9.2%
外国株式インデックス マザーファンド	7.7%
FRM シグマリンク マザーファンド	7.1%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{AG}	7.0%
TCAファンド(適格機関投資家専用)	6.9%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6.9%
国内債券インデックス マザーファンド	6.0%
FOFs 用FRM ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	5.2%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

第3【ファンドの経理状況】

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11月29日現在)

分散投資コア戦略ファンドA

資産総額	1,175,624,951 円
負債総額	21,916,026 円
純資産総額(-)	1,153,708,925 円
発行済口数	1,153,222,388 口
1口当たり純資産額(/)	1.0004 円
1万口当たり純資産額	10,004 円

分散投資コア戦略ファンドS

資産総額	1,766,090,724 円
負債総額	30,408,421 円
純資産総額(-)	1,735,682,303 円
発行済口数	1,707,011,963 口
1口当たり純資産額(/)	1.0168 円
1万口当たり純資産額	10,168 円

(参考情報)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

資産総額	30,947,207,159 円
負債総額	1,033,255,691 円
純資産総額(-)	29,913,951,468 円
発行済口数	21,147,634,346 口
1口当たり純資産額(/)	1.4145 円
1万口当たり純資産額	14,145 円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	258,469,870,288 円
------	-------------------

負債総額	6,392,766,184 円
純資産総額(-)	252,077,104,104 円
発行済口数	196,642,277,014 口
1口当たり純資産額(/)	1.2819 円
1万口当たり純資産額	12,819 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	168,061,233,767 円
負債総額	755,499,300 円
純資産総額(-)	167,305,734,467 円
発行済口数	104,932,005,859 口
1口当たり純資産額(/)	1.5944 円
1万口当たり純資産額	15,944 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	230,375,829,416 円
負債総額	1,005,349,383 円
純資産総額(-)	229,370,480,033 円
発行済口数	94,268,311,015 口
1口当たり純資産額(/)	2.4332 円
1万口当たり純資産額	24,332 円

新興国株式インデックス マザーファンド

資産総額	23,022,355,610 円
負債総額	227,161,371 円
純資産総額(-)	22,795,194,239 円
発行済口数	10,232,035,158 口
1口当たり純資産額(/)	2.2278 円
1万口当たり純資産額	22,278 円

新興国債券インデックス マザーファンド

資産総額	25,791,526,979 円
負債総額	97,742,087 円
純資産総額(-)	25,693,784,892 円
発行済口数	15,877,796,058 口
1口当たり純資産額(/)	1.6182 円
1万口当たり純資産額	16,182 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	18,710,199,139 円
負債総額	222,789,957 円
純資産総額(-)	18,487,409,182 円
発行済口数	15,967,750,147 口
1口当たり純資産額(/)	1.1578 円
1万口当たり純資産額	11,578 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	23,336,536,849 円
負債総額	84,472,427 円
純資産総額(-)	23,252,064,422 円
発行済口数	20,333,189,151 口
1口当たり純資産額(/)	1.1436 円
1万口当たり純資産額	11,436 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	8,890,493,425 円
負債総額	43,475,000 円
純資産総額(-)	8,847,018,425 円
発行済口数	19,985,691,940 口
1口当たり純資産額(/)	0.4427 円
1万口当たり純資産額	4,427 円

FRM シグマ リンク マザーファンド

資産総額	4,769,807,280 円
負債総額	50,000 円
純資産総額(-)	4,769,757,280 円
発行済口数	5,372,445,235 口
1口当たり純資産額(/)	0.8878 円
1万口当たり純資産額	8,878 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、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7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）

投資運用の意思決定機構

（中略）

[CHECK（検証・評価）]

運用部門において各運用部から独立した運用企画部は、ファンド品質の維持・向上の観点から、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスの評価・分析に係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はリスク管理部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

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

委託会社の機構は平成25年10月1日現在（予定）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11月29日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はリスク管理部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

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

委託会社の機構は平成26年2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>

（前略）

平成25年7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	<u>320</u>	<u>4,361,531</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>1</u>	<u>64</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>321</u>	<u>4,361,595</u>

<訂正後>

（前略）

平成25年11月29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>343</u>	<u>4,568,647</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>0</u>	<u>0</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>343</u>	<u>4,568,647</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。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(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。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度の中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間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 (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 (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)
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
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

（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

当社を吸収合併存続会社、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](#)

中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間末

(平成25年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		9,085,583
未収委託者報酬		2,586,632
未収運用受託報酬		14,364
繰延税金資産		93,174
その他流動資産		145,900
流動資産合計		11,925,655
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	73,320
器具備品	1	96,424
有形固定資産合計		169,745
無形固定資産		183,276
投資その他の資産		
投資有価証券		58,285
長期貸付金		30,338
会員権		25,000
その他の投資		50,103
貸倒引当金		30,338
投資その他の資産合計		133,388
固定資産合計		486,410
資産合計		12,412,066
負債の部		
流動負債		
未払金		1,586,759
未払費用		47,931
未払法人税等		584,513
賞与引当金		97,266
その他流動負債	2	120,862
流動負債合計		2,437,333
固定負債		
退職給付引当金		296,351
繰延税金負債		277,998
資産除去債務		12,386
固定負債合計		586,736
負債合計		3,024,070

(単位：千円)

第28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	6,573,745
利益剰余金合計	8,736,245
株主資本合計	9,386,245
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,751
評価・換算差額等合計	1,751
純資産合計	9,387,996
負債・純資産合計	12,412,066

中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	11,222,467
運用受託報酬	36,913
営業収益合計	11,259,380
営業費用	8,307,878
一般管理費	1 1,553,438
営業利益	1,398,063
営業外収益	2 8,577
営業外費用	9,483
経常利益	1,397,157
税引前中間純利益	1,397,157
法人税、住民税及び事業税	577,514
法人税等調整額	55,190
法人税等合計	522,324
中間純利益	874,833

中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	59,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	5,731,912
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	841,833
当中間期末残高	6,573,745
利益剰余金合計	
当期首残高	7,891,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	8,736,245
株主資本合計	
当期首残高	8,541,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	9,386,245

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
純資産合計	
当期首残高	8,546,410
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	841,585
当中間期末残高	9,387,996

重要な会計方針

第28期中間会計期間
(自 平成25年4月1日
至 平成25年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)

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。

(2) 無形固定資産

 定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 29,556千円
	器具備品 251,697千円
	計 281,253千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 23,080千円
	無形固定資産 33,012千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息 4,063千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月28日

（リ - ス取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

平成25年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	9,085,583	9,085,583	-
(2)未収委託者報酬	2,586,632	2,586,632	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,285	58,285	-
(4)未払金	(1,586,759)	(1,586,759)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

その他有価証券

（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	41,540	44,791	3,250
小計	41,540	44,791	3,250
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	14,024	13,494	529
小計	14,024	13,494	529
合計	55,564	58,285	2,720

（デリバティブ取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
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）	1,535,927千円

（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）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（ 1株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,129,332円09銭
1株当たり中間純利益	291,611円01銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
中間純利益	874,833千円
普通株式に係る中間純利益	874,833千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[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>

(前略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成25年9月25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>

(前略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成26年2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）		

（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）

<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9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9月末日現在）	事業の内容
（中略）		

（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9月末日現在）

（後略）

第3【その他】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第3 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 >

(前略)

(9) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

(10) 「平成25年10月1日現在(予定)」としている事項について、当有価証券届出書の効力発生日以降に使用開始する目論見書において「(予定)」の記載は行いません。

< 訂正後 >

(前略)

(9) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 白川 芳樹 印
業務執行社員
指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 浩之 印
業務執行社員

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25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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。