

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年10月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）内国投資信託受益証券の金額】	分散投資コア戦略ファンドA 10兆円を上限とします。 分散投資コア戦略ファンドS 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（以下、上記を総称して「分散投資コア戦略ファンド」又は「分散投資コアラップ」ということ、あるいは総称して又は個別に「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）愛称として、分散投資コア戦略ファンドAは「コアラップA」、分散投資コア戦略ファンドSは「コアラップS」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（ 7 ） 【 申込期間 】

平成26年10月11日から平成27年 4月10日までとします。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信... 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいう。
- (2) 追加型投信... 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来からの信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

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

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

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

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

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

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他... 上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1) グローバル... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2) 日本... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

<ファンドの特色>

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

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

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
- 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド^{※1}等に投資し、オルタナティブ運用^{※2}を行います。

※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、MLP、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性（相関性）が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

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

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

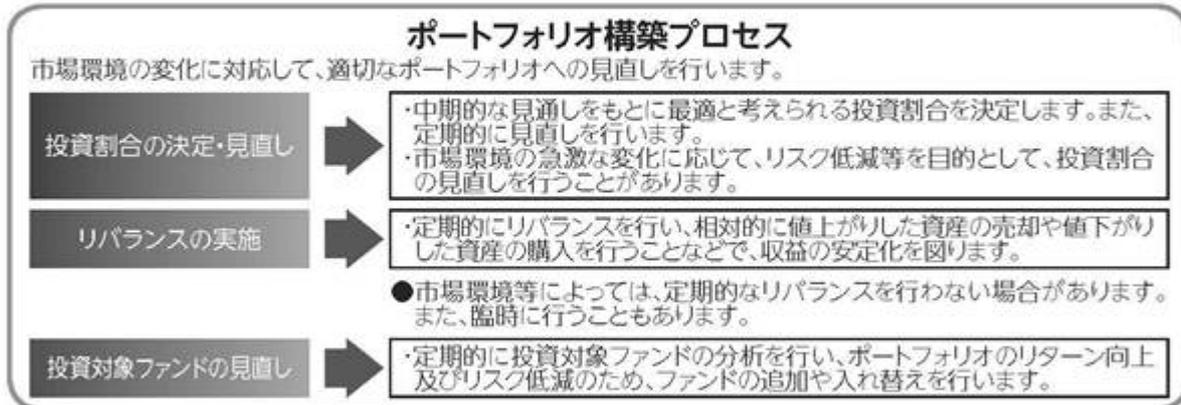
従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更する運用を行います。

4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への 投資割合の合計 ^{※3}	運用の特徴
分散投資コア戦略ファンドA 愛称:コアラップA	原則50%未満	安定性を重視
分散投資コア戦略ファンドS 愛称:コアラップS	原則75%未満	安定性と収益性の バランスを重視

※3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「投資リスク」の「ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

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



ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

〈ご参考情報〉

MLP

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

バンクローン

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

コモディティ

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

ヘッジファンド

裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド[※]などがあります。

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

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

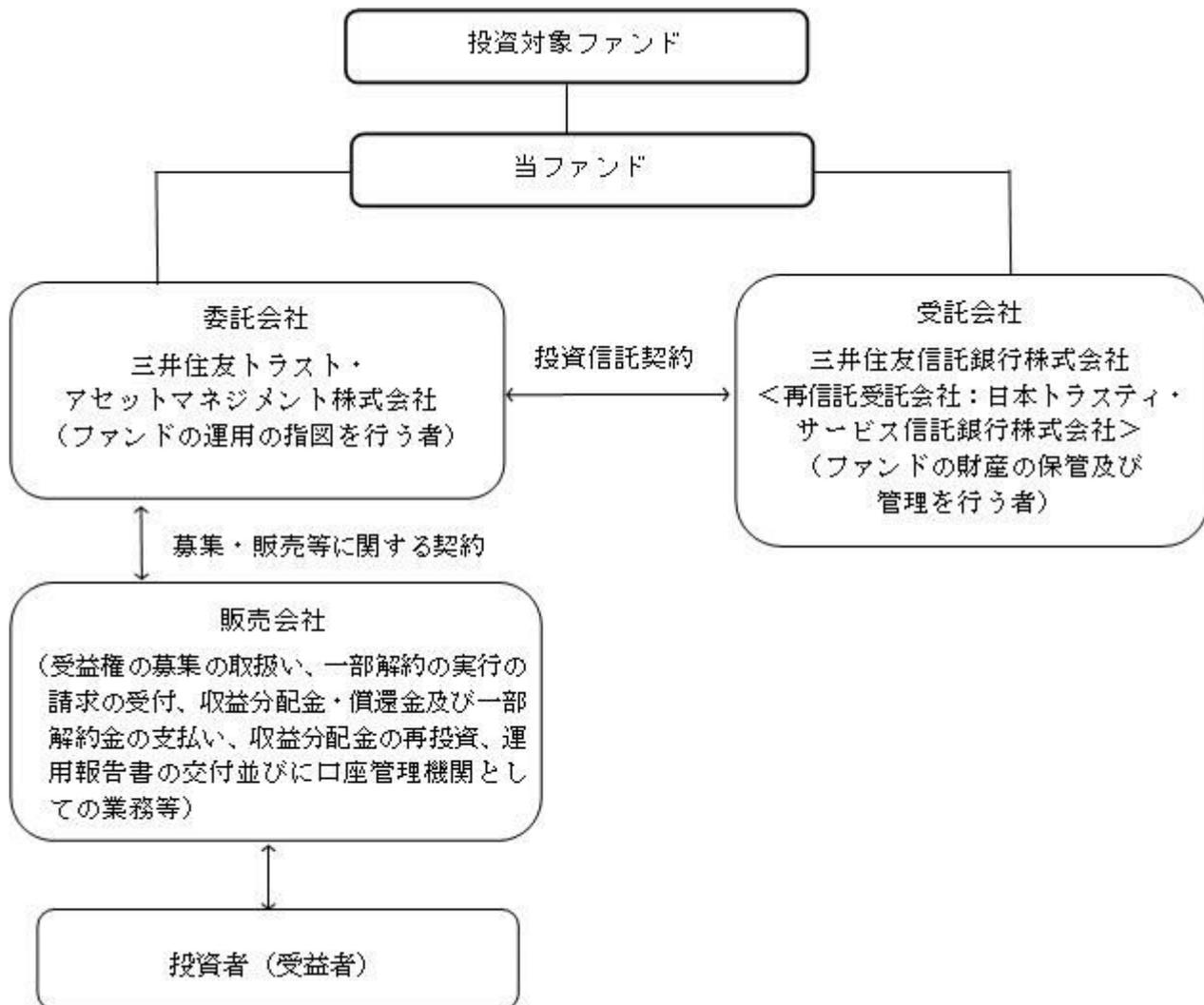
(2)【ファンドの沿革】

平成25年3月29日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成26年 7月31日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

投資対象

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

投資態度

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

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

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

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

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

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

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
50%未満	75%未満

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

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

ホ．投資対象ファンドの選定、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合について、三井住友信託銀行株式会社の投資助言を受けます。

ヘ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

- ト．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。
- チ．ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1.の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

- ・ 全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、平成26年10月10日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

1.ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてわが国の株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式
投資態度	<p>主として、日経平均株価に採用されている株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。</p> <p>株式の売買の判断は、複数の投資判断モデルを組み合わせる機動的に行います。その結果、株式の組入比率は、投資信託財産の純資産総額に対して大きく変動し、ゼロとなる場合もあります。</p> <p>株式以外の資産への投資は、わが国の円建短期公社債等を中心に行います。運用にあたっては、三井住友信託銀行株式会社の投資助言を受けます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の一部解約又は追加信託の処理を行う前の投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を一部解約又は追加信託の処理を行う前の受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成23年11月28日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

2.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資するJPX日経インデックス400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>
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0.0756%（税抜 年0.07%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年2月3日
信託期間	原則として平成26年2月3日から平成35年10月20日
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

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

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

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

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

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

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

3. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（以下「NOMURA-BPI総合（ ）」）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

4.FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

5. 外国株式インデックス マザーファンド

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

主要投資対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式
投資態度	<p>原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>
ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限

助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

6. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

7. 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）

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	外国債券インデックス 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
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）（ ）に採用されている国・地域）の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）をベンチマークとし、その動きと連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>なお、世界の主要国の公社債（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）に採用されている国・地域の公社債）に直接投資する場合があります。</p> <p>実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行います。が、資産規模によっては全ての通貨に対してヘッジができない場合があります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに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、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.4104%（税抜 年0.38%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月8日
信託期間	原則として、平成24年8月8日から平成34年6月27日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「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。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

8. 新興国株式インデックス マザーファンド

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

運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）
投資態度	<p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券））を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成20年12月12日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

9.FOFs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資する新興国株式セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の株式に直接投資することもあります。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式に投資します。 ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、個別銘柄の収益性、収益の安定性、財務の健全性等を勘案し、各銘柄への実質投資割合を決定します。 新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。 実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 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、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、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

10. 新興国債券インデックス マザーファンド

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

主な投資制限	株式への投資は行いません。 同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成20年12月11日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

10. 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「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	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
ベンチマーク	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（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	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成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（円ヘッジ・円ベース）」とは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーおよび関連会社（以下「バークレイズ」）が開発、算出、公表をおこな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およびその他の一切の権利はバークレイズに帰属します。

12.FOFs用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用）

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

主要投資対象	主として新興国の現地通貨建債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する新興国債券セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の現地通貨建債券に直接投資することもあります。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の現地通貨建債券に投資します。 ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、債券の時価総額や流動性等を勘案し、各国への実質投資割合を決定します。 新興国の現地通貨建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の現地通貨建債券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。 実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 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ます。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	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0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等）をいいます。以下同じ。）に投資する世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を含む世界各国の債券に直接投資することもあります。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国の債券に投資します。 ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への実質投資割合を決定します。 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、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。 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ます。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

14. J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	<p>わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が30%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成20年1月9日
信託期間	原則として無期限
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

15. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成20年1月9日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's^(R) およびS&P^(R) はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R) はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

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

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、別に定めるMLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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

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

17.HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

投資顧問会社	Credit Suisse Asset Management, LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

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

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

18. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

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

主な投資制限	<p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p>
ベンチマーク	ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成20年7月1日
信託期間	原則として無期限
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）および「ブルームバーグ（Bloomberg^R）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

19. TCAファンド（適格機関投資家専用）

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

運用の基本方針	この投資信託は、主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数を対象とした先物取引（以下「株価指数先物取引」といいます。）及び債券先物取引を積極的に活用し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の円建短期公社債等並びに日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引（以下「先物取引等」といいます。）を行います。</p> <p>運用にあたっては、三井住友信託銀行株式会社から助言を受けます。</p> <p>先物取引等は、原則として定量的手法に基づき行います。</p> <p>先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の75の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の500の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>ここでいう投資額とは、投資信託財産における先物取引等の種類ごとに買建玉の時価総額と売建玉の時価総額の差額の絶対値を合計した額をいいます。</p> <p>先物取引等にかかる損益等の為替リスクに対しては、原則として為替予約を行い、為替リスクの低減をはかります。</p> <p>大量の追加設定又は解約が発生したとき、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき、投資信託財産の規模その他の要因等によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	6月・12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲 経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配対象額についての分配方針 委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用方針 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成22年2月25日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

20.FRM シグマ リンク マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として積極的な運用を行います。
主要投資対象	ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設定された海外籍特別目的会社の発行する円建債券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、円建債券への投資を通じて、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託「FRM Sigma MA Fund Limited（以下「FRM シグマファンド」といいます。）」の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM シグマファンドは、金利、債券、株式、商品、為替等の先物取引等を用いる複数のCTAのファンドを組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して積極的な運用を行います。</p> <p>原則として、円建債券の組入比率は高位を保ちます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月7日
信託期間	原則として無期限
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

運用会社	B N P パリバ インベストメント・パートナーズ株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ファミリーファンド方式により、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主として、ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を投資対象とします。</p> <p><マザーファンドの投資対象></p> <p>主として、海外の上場先物、為替取引等を投資対象とします。</p>

投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。</p> <p>当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、その主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに抛り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI総合指数（HFRI Weighted Composite Index）（ ）を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。</p> <p>マザーファンドの組入れ比率は高位に保つことを原則とします。</p> <p>当ファンドは、原則として対円で為替ヘッジを行います。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに抛り、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。</p> <p>当ファンドの運用に関しては三井住友信託銀行株式会社より投資助言を受けます。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時（原則として毎年8月15日）に分配対象収益の中から、収益分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。ただし、信託財産の状況によっては、分配を行わないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月8日
信託期間	原則として平成24年8月8日から平成34年6月27日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「HFRI総合指数^(R)（HFRI Weighted Composite Index^(R)）」（以下「HFR指数」）は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク（HFR）の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」に関する使用のみ、BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR及びHFR指数（当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている）は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFRは、当該投資信託を發起、支持、販売又は推奨していません。HFRは、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日における当該投資信託の運用成績がHFR指数の運用成績あるいはHFR指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFRは当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR指数の過誤について通知する義務を負いません。HFRは、HFR指数の計算に使用される方法を含むHFR指数をいつでも修正、変更

し、HFR指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。

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

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

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

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

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

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

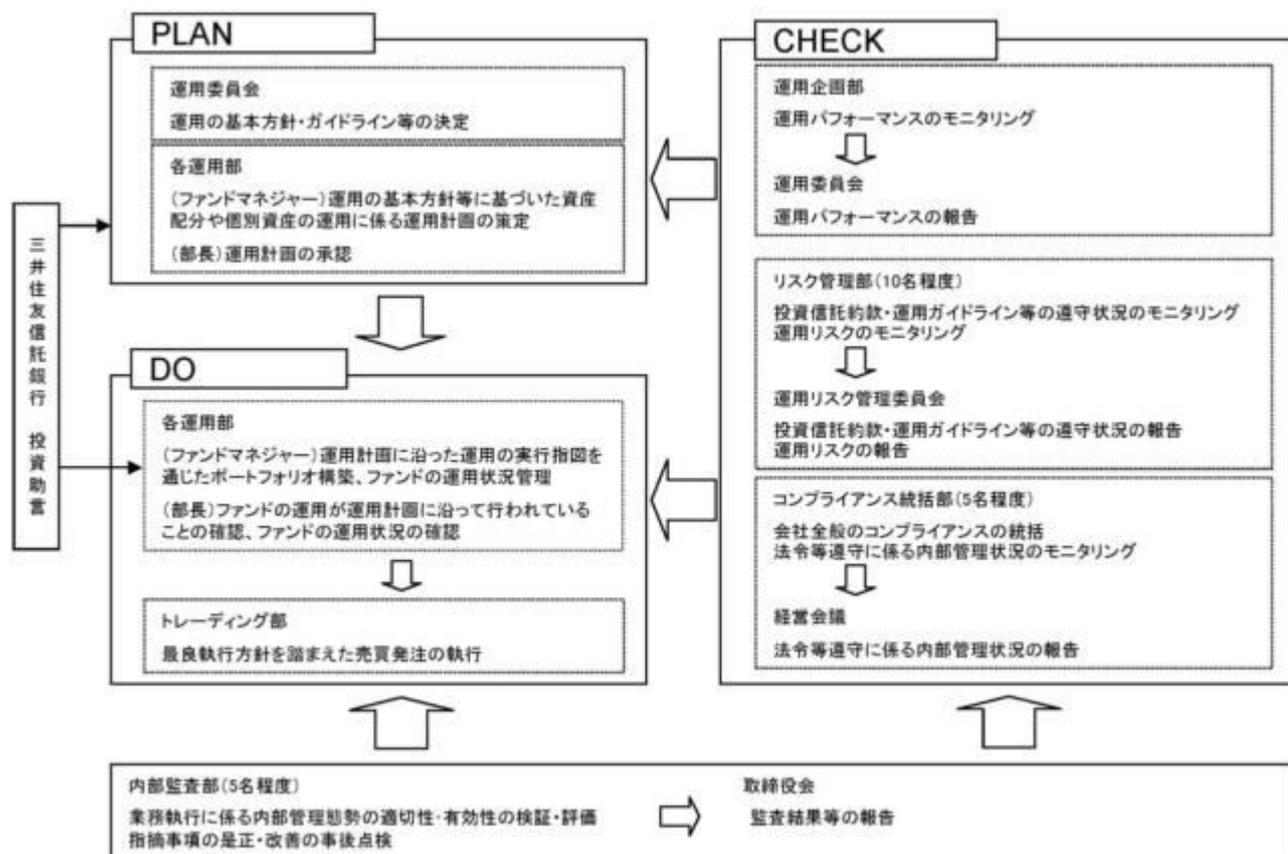
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託証券「FRM Diversified MA Fund Limited」（以下「FRM ダイバーシファイド ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM ダイバーシファイド ファンドは、様々なヘッジファンドに分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年10月16日
信託期間	原則として、平成25年10月16日から平成35年10月10日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

八．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

二．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ．外国為替予約取引の指図

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

リ．資金の借入れ

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

MLPの価格変動リスク

MLPの価格は、事業を取り巻く環境やエネルギー市況の変化、金利変動、関係法令・各種規制の変更等の要因により変動し、基準価額の変動要因となります。

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

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

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

ブローカーの信用リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 1.296%（税抜 1.2%）（ ）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.756% （税抜 0.7%）
------	---------------------

販売会社	年率 0.486% (税抜 0.45%)
受託会社	年率 0.054% (税抜 0.05%)

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

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

(参考)各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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 0.0756% (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。
FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
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 0.4104% (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。
FOFs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
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 0.0648% (税抜 0.06%)
FOFs用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり （適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.1512% (税抜 0.14%)
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 0.65%
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 0.864% (税抜 0.8%)
FRMシグマ リンク マザーファンド	ありません。
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド ・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.864% (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 0.0648%（税抜 0.06%）
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%

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組入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1.296%～1.78746%程度（税抜 1.2%～1.6645%程度）

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

二．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。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
 - ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
 - ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- 二．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。

なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されません。

上記は、平成26年 7月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下の記載は、平成26年7月31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	7,149,799,035	42.25
	ケイマン	1,244,460,714	7.35
	小計	8,394,259,749	49.61
投資証券	ルクセンブルク	2,277,665,284	13.46
親投資信託受益証券	日本	6,107,975,395	36.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		141,442,675	0.84
合計(純資産総額)		16,921,343,103	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	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)	2,201,068,144	1.0203	2,245,789,882	1.0247	2,255,434,527	13.33
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	835,445.838	1,800.28	1,504,039,316	1,824.00	1,523,853,208	9.01
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)	1,421,134,066	1.0561	1,500,890,069	1.0503	1,492,617,109	8.82
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	1,205,121.1028	1,032.75	1,244,599,442	1,032.64	1,244,460,714	7.35
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	953,074,166	1.2955	1,234,730,983	1.2971	1,236,232,500	7.31
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)	1,173,164,903	1.0460	1,227,242,397	1.0508	1,232,761,680	7.29

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	549,120,079	1.6956	931,139,200	1.6973	932,021,510	5.51
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	365,786,240	2.5229	922,843,876	2.5400	929,097,049	5.49
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)	788,760,273	0.9710	765,928,640	0.9741	768,331,381	4.54
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	833,628,176	0.8936	744,948,496	0.9128	760,935,799	4.50
日本	投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	768,390,381	0.9841	756,222,651	0.9897	760,475,960	4.49
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	75,496,264	9,983.01	753,680,000	9,984.76	753,812,076	4.45
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	439,380,364	1.3885	610,091,358	1.3993	614,824,943	3.63
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	313,043,290	1.7316	542,084,114	1.7472	546,949,236	3.23
日本	投資信託 受益証券	FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格 機関投資家専用)	471,370,631	1.0182	479,967,754	1.0216	481,552,236	2.85
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	256,266,535	1.3111	336,011,352	1.3425	344,037,823	2.03
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	261,516,112	1.2832	335,584,377	1.3082	342,115,377	2.02
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	100,300,416	2.3567	236,382,178	2.4290	243,629,710	1.44
日本	投資信託 受益証券	FOFs用JPX日経インデックス400・オー プン(適格機関投資家専用)	144,599,948	1.0771	155,751,675	1.0970	158,626,142	0.94
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	344,437,919	0.4648	160,127,239	0.4591	158,131,448	0.93

(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	49.61
投資証券	13.46
親投資信託受益証券	36.10
合計	99.16

(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
第2期計算期間末 (平成26年 7月10日)	16,628,969,770	16,628,969,770	10,208	10,208
平成25年 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	
12月末日	1,189,574,192		10,054	
平成26年 1月末日	1,419,314,042		9,932	
2月末日	1,481,412,426		10,013	
3月末日	3,253,615,884		10,001	
4月末日	3,280,664,110		10,033	
5月末日	4,056,125,082		10,142	
6月末日	4,486,966,816		10,192	
7月末日	16,921,343,103		10,258	

【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
第2期計算期間(平成25年 7月11日～平成26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
第2期計算期間(平成25年 7月11日～平成26年 7月10日)	4.0

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	263,825,167		263,825,167
第2期計算期間 (平成25年 7月11日～平成26年 7月10日)	16,300,810,769	274,885,382	16,289,750,554

(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	3,166,488,818	29.45

	ケイマン	398,469,645	3.71
	小計	3,564,958,463	33.15
投資証券	ルクセンブルク	1,123,751,617	10.45
親投資信託受益証券	日本	5,876,110,269	54.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		188,768,975	1.76
合計(純資産総額)		10,753,589,324	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	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)	991,385,384	1.0203	1,011,557,875	1.0247	1,015,872,602	9.45
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	387,610,406	2.5237	978,247,581	2.5400	984,530,431	9.16
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	579,323,795	1.6957	982,383,537	1.6973	983,286,277	9.14
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	681,547,462	1.3894	947,009,439	1.3993	953,689,363	8.87
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	442,218,782	1.7322	766,020,204	1.7472	772,644,655	7.18
ルクセン ブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	411,140.185	1,802.44	741,056,180	1,824.00	749,919,697	6.97
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)	702,736,425	1.0555	741,798,278	1.0503	738,084,067	6.86
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	324,931,423	1.3133	426,761,345	1.3425	436,220,435	4.06
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	329,332,386	1.2851	423,225,642	1.3082	430,832,627	4.01
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)	383,030,561	1.0468	400,972,280	1.0508	402,488,513	3.74
ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	385,873.3127	1,032.75	398,512,985	1,032.64	398,469,645	3.71
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	306,653,057	1.2957	397,336,895	1.2971	397,759,680	3.70
日本	投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	380,796,540	0.9846	374,958,815	0.9897	376,874,335	3.50
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	412,012,617	0.8953	368,899,755	0.9128	376,085,116	3.50
ルクセン ブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	37,440.251	9,983.10	373,770,000	9,984.76	373,831,920	3.48
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	140,202,901	2.3618	331,142,464	2.4290	340,552,846	3.17
日本	投資信託 受益証券	FOFs用JPX日経インデックス400・オープン (適格機関投資家専用)	224,314,408	1.0788	242,000,121	1.0970	246,072,905	2.29
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)	240,242,162	0.9715	233,397,634	0.9741	234,019,890	2.18

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	436,743,280	0.4641	202,711,599	0.4591	200,508,839	1.86
日本	投資信託 受益証券	FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格機 関投資家専用)	149,839,963	1.0185	152,620,958	1.0216	153,076,506	1.42

(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	33.15
投資証券	10.45
親投資信託受益証券	54.64
合計	98.24

(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
第2期計算期間末 (平成26年 7月10日)	9,560,643,872	9,560,643,872	10,451	10,451
平成25年 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	
12月末日	1,770,934,410		10,285	
平成26年 1月末日	2,550,279,589		10,071	
2月末日	2,621,095,911		10,185	
3月末日	4,506,638,343		10,201	
4月末日	4,600,597,284		10,252	
5月末日	6,817,183,141		10,363	
6月末日	8,343,714,869		10,430	
7月末日	10,753,589,324		10,519	

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

第2期計算期間(平成25年 7月11日～平成26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
第2期計算期間(平成25年 7月11日～平成26年 7月10日)	5.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	54,750,331		54,750,331
第2期計算期間 (平成25年 7月11日～平成26年 7月10日)	9,258,266,615	164,756,557	9,148,260,389

(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	14,185,431,750	36.48
国債証券	日本	10,998,189,000	28.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,704,112,808	35.24
合計(純資産総額)		38,887,733,558	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460回国庫短期証券		7,000,000,000	99.96	6,997,697,000	99.98	6,998,635,000	0.0	2015/06/22	18.00
日本	国債証券	第419回国庫短期証券		2,000,000,000	99.97	1,999,494,000	99.99	1,999,830,000	0.0	2014/12/22	5.14
日本	国債証券	第438回国庫短期証券		2,000,000,000	99.96	1,999,266,000	99.98	1,999,724,000	0.0	2015/03/20	5.14
日本	株式	日立造船	機械	1,356,000	536.27	727,191,882	543.00	736,308,000			1.89
日本	株式	トクヤマ	化学	1,518,000	347.11	526,922,927	358.00	543,444,000			1.40
日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	106,100	4,778.27	506,974,630	4,698.00	498,457,800			1.28
日本	株式	アマダ	機械	491,000	1,078.86	529,720,260	1,008.00	494,928,000			1.27
日本	株式	昭和シェル石油	石油・石炭製品	415,400	1,167.83	485,120,658	1,169.00	485,602,600			1.25

日本	株式	東急不動産ホールディングス	不動産業	614,400	809.91	497,609,623	790.00	485,376,000		1.25
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,388,900	204.99	489,721,072	201.50	481,363,350		1.24
日本	株式	日立製作所	電気機器	477,000	786.23	375,036,146	808.70	385,749,900		0.99
日本	株式	パナソニック	電気機器	304,900	1,233.48	376,088,722	1,257.50	383,411,750		0.99
日本	株式	京セラ	電気機器	75,200	5,052.75	379,967,281	5,047.00	379,534,400		0.98
日本	株式	富士電機	電気機器	708,000	506.33	358,488,466	536.00	379,488,000		0.98
日本	株式	日本通運	陸運業	750,000	504.59	378,446,550	502.00	376,500,000		0.97
日本	株式	帝人	繊維製品	1,464,000	255.00	373,320,000	257.00	376,248,000		0.97
日本	株式	大林組	建設業	495,000	752.19	372,336,723	760.00	376,200,000		0.97
日本	株式	三井物産	卸売業	225,500	1,674.30	377,555,951	1,666.00	375,683,000		0.97
日本	株式	富士通	電気機器	468,000	773.93	362,203,002	801.00	374,868,000		0.96
日本	株式	旭硝子	ガラス・土石製品	607,000	618.11	375,194,013	614.60	373,062,200		0.96
日本	株式	三菱商事	卸売業	170,200	2,135.43	363,451,495	2,186.00	372,057,200		0.96
日本	株式	住友商事	卸売業	270,400	1,364.00	368,825,600	1,370.50	370,583,200		0.95
日本	株式	安川電機	電気機器	266,900	1,367.00	364,852,300	1,354.00	361,382,600		0.93
日本	株式	三井不動産	不動産業	104,000	3,449.88	358,788,440	3,444.50	358,228,000		0.92
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	95,600	3,728.22	356,418,440	3,742.00	357,735,200		0.92
日本	株式	東洋製罐グループホールディングス	金属製品	217,300	1,609.23	349,687,560	1,623.00	352,677,900		0.91
日本	株式	日本製鋼所	機械	433,000	454.41	196,761,453	447.00	193,551,000		0.50
日本	株式	宝ホールディングス	食料品	166,000	766.90	127,305,910	955.00	158,530,000		0.41
日本	株式	東邦亜鉛	非鉄金属	306,000	445.18	136,228,012	492.00	150,552,000		0.39
日本	株式	日産化学工業	化学	77,800	1,765.18	137,331,478	1,906.00	148,286,800		0.38

(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	36.48
国債証券	28.28
合計	64.76

(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	0.97
		食料品	0.76
		繊維製品	0.97
		化学	2.87
		医薬品	0.34
		石油・石炭製品	1.25
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	1.30
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.91

	機械	4.02
	電気機器	6.88
	輸送用機器	0.72
	精密機器	0.36
	陸運業	2.25
	海運業	0.36
	情報・通信業	0.36
	卸売業	2.88
	小売業	0.64
	銀行業	2.66
	証券、商品先物取引業	0.34
	保険業	0.36
	不動産業	2.87
合計		36.48

(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	210,405,602,250	78.92
	ポーランド	201,340,000	0.08
	メキシコ	99,917,000	0.04
	小計	210,706,859,250	79.04
地方債証券	日本	16,648,753,133	6.24
特殊債券	日本	22,505,475,796	8.44
	アメリカ	209,724,000	0.08
	スウェーデン	100,920,000	0.04
	韓国	100,273,000	0.04
	小計	22,916,392,796	8.60
社債券	日本	13,491,716,670	5.06
	アメリカ	507,699,000	0.19
	オランダ	405,482,000	0.15
	オーストラリア	304,495,000	0.11
	スウェーデン	102,582,000	0.04
	イギリス	101,081,000	0.04
	小計	14,913,055,670	5.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,414,367,865	0.53
合計(純資産総額)		266,599,428,714	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113回利付国債(5年)	3,980,000,000	100.62	4,004,911,400	100.73	4,009,173,400	0.3	2018/06/20	1.50
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,460,000,000	100.11	3,463,955,900	100.27	3,469,515,000	0.2	2019/03/20	1.30
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,260,000,000	100.29	3,269,546,300	100.33	3,270,758,000	0.2	2017/06/20	1.23
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,120,000,000	100.15	3,124,909,600	100.30	3,129,484,800	0.2	2018/12/20	1.17
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,000,000,000	100.49	3,014,970,000	100.98	3,029,580,000	0.6	2023/12/20	1.14
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	100.30	2,758,288,400	100.82	2,772,687,500	0.6	2024/03/20	1.04
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	2,700,000,000	100.64	2,717,388,000	100.61	2,716,686,000	0.4	2016/06/20	1.02
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	100.70	2,618,458,000	100.69	2,617,940,000	0.4	2016/09/20	0.98
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	2,430,000,000	104.89	2,548,997,100	104.78	2,546,226,900	1.5	2017/12/20	0.96
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,440,000,000	102.89	2,510,684,400	103.35	2,521,788,800	0.8	2022/09/20	0.95
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	102.48	2,295,641,600	102.93	2,305,699,200	0.8	2023/09/20	0.86
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	100.52	2,291,878,800	100.53	2,292,175,200	0.3	2016/12/20	0.86
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	2,280,000,000	100.27	2,286,361,200	100.34	2,287,820,400	0.2	2017/09/20	0.86
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,210,000,000	100.92	2,230,336,900	101.45	2,242,155,500	0.6	2023/03/20	0.84
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	105.76	2,221,149,000	105.69	2,219,511,000	1.5	2018/09/20	0.83
日本	国債証券	第318回利付国債(10年)	2,110,000,000	104.66	2,208,442,400	105.03	2,216,175,200	1.0	2021/09/20	0.83
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	105.23	2,199,307,000	105.03	2,195,315,100	1.7	2017/09/20	0.82
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,060,000,000	106.04	2,184,463,800	106.07	2,185,206,800	1.3	2019/12/20	0.82
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,090,000,000	100.57	2,101,933,900	100.57	2,102,038,400	0.3	2017/03/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,040,000,000	102.55	2,092,020,000	103.03	2,101,832,400	0.8	2023/06/20	0.79
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1,990,000,000	104.47	2,079,092,300	104.24	2,074,435,700	1.7	2017/03/20	0.78
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	1,960,000,000	100.19	1,963,763,200	100.32	1,966,428,800	0.2	2018/09/20	0.74
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	1,720,000,000	104.68	1,800,573,200	105.01	1,806,240,800	1.0	2021/12/20	0.68
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	1,800,000,000	100.20	1,803,719,600	100.24	1,804,356,000	0.2	2019/06/20	0.68
日本	国債証券	第96回利付国債(5年)	1,770,000,000	100.75	1,783,328,100	100.71	1,782,637,800	0.5	2016/03/20	0.67
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	105.12	1,745,091,600	105.11	1,744,925,600	1.3	2018/12/20	0.65
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1,590,000,000	104.65	1,663,966,800	104.87	1,667,512,500	1.0	2020/09/20	0.63
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,540,000,000	104.57	1,610,495,000	104.98	1,616,738,200	1.0	2022/03/20	0.61
日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	1,540,000,000	102.75	1,582,350,000	103.24	1,589,926,800	0.8	2022/12/20	0.60

日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	1,550,000,000	100.48	1,557,476,900	100.65	1,560,168,000	0.6	2024/06/20	0.59
----	------	----------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	-----	------------	------

(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	79.04
地方債証券	6.24
特殊債券	8.60
社債券	5.59
合計	99.47

(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

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	大阪取引所	買建	円	3	438,090,972	437,760,000	437,760,000	0.16

(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	96,222,392,084	54.22
	イギリス	15,531,832,709	8.75
	カナダ	8,186,326,483	4.61
	スイス	7,256,597,677	4.09
	フランス	6,830,786,259	3.85
	ドイツ	6,778,194,751	3.82
	オーストラリア	5,578,852,728	3.14
	オランダ	2,742,213,969	1.55
	スペイン	2,712,550,976	1.53
	スウェーデン	2,284,882,313	1.29
	香港	1,886,110,608	1.06
	アイルランド	1,835,930,642	1.03
	イタリア	1,765,087,256	0.99
	デンマーク	1,145,638,197	0.65
シンガポール	1,093,892,465	0.62	

	ジャージー	1,069,123,781	0.60
	ベルギー	897,074,556	0.51
	キュラソー	805,218,793	0.45
	フィンランド	668,656,045	0.38
	バミューダ	617,302,528	0.35
	ノルウェー	549,598,130	0.31
	イスラエル	405,220,425	0.23
	ルクセンブルク	310,284,465	0.17
	ケイマン	197,180,859	0.11
	オーストリア	177,856,079	0.10
	ポルトガル	155,308,617	0.09
	ニュージーランド	107,509,572	0.06
	英ヴァージン諸島	92,534,630	0.05
	パナマ	83,792,207	0.05
	リベリア	55,361,892	0.03
	ガンジー	43,096,100	0.02
	マン島	34,398,042	0.02
	モーリシャス	12,672,136	0.01
	小計	168,133,477,974	94.73
投資信託受益証券	オーストラリア	91,164,515	0.05
	シンガポール	19,692,175	0.01
	香港	15,215,382	0.01
	小計	126,072,072	0.07
投資証券	アメリカ	2,611,073,617	1.47
	オーストラリア	404,741,881	0.23
	フランス	238,016,158	0.13
	イギリス	236,278,398	0.13
	香港	72,487,375	0.04
	シンガポール	54,519,272	0.03
	カナダ	36,102,838	0.02
	オランダ	18,803,391	0.01
	小計	3,672,022,930	2.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,548,552,720	3.13
合計(純資産総額)		177,480,125,696	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	339,951	9,187.62	3,123,342,456	10,092.67	3,431,013,429	1.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	234,956	10,402.82	2,444,207,099	10,619.26	2,495,059,439	1.41
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	429,238	4,133.05	1,774,062,977	4,482.20	1,923,931,851	1.08
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	153,810	10,323.56	1,587,866,769	10,521.55	1,618,320,374	0.91

アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	272,607	5,191.25	1,415,173,549	5,358.48	1,460,760,520	0.82
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	543,957	2,739.92	1,490,403,031	2,637.07	1,434,454,861	0.81
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	103,748	12,637.10	1,311,074,209	13,630.71	1,414,158,952	0.80
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	175,591	7,919.68	1,390,626,088	7,734.97	1,358,191,995	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	206,627	5,715.59	1,180,995,502	6,058.89	1,251,930,987	0.71
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	225,137	5,118.19	1,152,295,932	5,323.51	1,198,520,421	0.68
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	147,341	8,238.29	1,213,838,797	8,038.75	1,184,438,347	0.67
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,045,293	1,093.57	1,143,101,115	1,116.20	1,166,766,498	0.66
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	38,114	30,047.96	1,145,248,168	30,203.77	1,151,186,680	0.65
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	125,120	9,149.59	1,144,797,307	9,099.63	1,138,546,644	0.64
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	53,861	18,869.16	1,016,311,979	19,952.89	1,074,683,146	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	283,099	3,635.89	1,029,318,542	3,739.62	1,058,684,380	0.60
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	347,043	3,048.51	1,057,964,737	3,009.39	1,044,388,080	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	270,701	2,792.97	756,060,746	3,532.89	956,358,886	0.54
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	159,883	5,807.94	928,591,655	5,973.52	955,065,577	0.54
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	15,635	57,898.71	905,246,392	60,416.14	944,606,458	0.53
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,291	58,789.38	898,948,456	61,241.00	936,436,192	0.53
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	577,501	1,558.66	900,128,940	1,602.40	925,389,334	0.52
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	211,937	4,081.15	864,948,402	4,145.54	878,595,429	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	215,596	4,175.82	900,290,423	4,074.91	878,535,805	0.50
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	166,007	4,876.20	809,483,366	5,142.49	853,690,997	0.48
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,004,078	880.29	883,885,896	838.24	841,663,362	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	195,019	4,272.41	833,201,522	4,212.73	821,563,561	0.46
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	90,574	8,607.51	779,617,436	8,969.54	812,407,885	0.46
キュラソー	株式	SCHLUMBERGER	エネルギー	70,999	10,519.13	746,848,305	11,341.26	805,218,793	0.45
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	83,333	8,443.11	703,590,283	9,646.30	803,855,242	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 (%)
株式	94.73
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.07
合計	96.87

(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	10.34
		素材	5.58
		資本財	6.96
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	1.72
		耐久消費財・アパレル	1.48
		消費者サービス	1.61
		メディア	2.94
		小売	2.84
		食品・生活必需品小売り	2.03
		食品・飲料・タバコ	5.82
		家庭用品・パーソナル用品	1.65
		ヘルスケア機器・サービス	2.97
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.92
		銀行	9.55
		各種金融	3.93
		保険	4.08
		不動産	0.65
		ソフトウェア・サービス	6.70
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.13		
電気通信サービス	3.25		
公益事業	3.17		
半導体・半導体製造装置	1.60		
合計			94.73

(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	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	67	32,705,914	32,915,425	3,385,351,461	1.91
	S&P/TSE 60	モントリオール取引 所	買建	カナダドル	16	2,764,126	2,865,280	270,138,598	0.15
	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	32	2,748,674	2,715,840	307,568,880	0.17
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイ ツ金融先物取引所	買建	ユーロ	159	5,132,125.50	5,043,480	694,991,544	0.39
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	21	2,837,347	2,928,450	280,896,924	0.16
	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	55	3,695,111.25	3,700,950	643,965,300	0.36

(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	86,572,351,241	36.97
	フランス	24,297,113,631	10.38
	イタリア	24,140,930,189	10.31
	ドイツ	19,863,835,684	8.48
	イギリス	18,663,429,223	7.97
	スペイン	13,026,080,337	5.56
	オランダ	6,464,457,608	2.76
	ベルギー	6,435,889,840	2.75
	カナダ	5,191,455,828	2.22
	オーストリア	4,103,907,709	1.75
	オーストラリア	3,870,195,572	1.65
	メキシコ	2,490,241,407	1.06
	アイルランド	1,970,988,603	0.84
	デンマーク	1,862,226,819	0.80
	フィンランド	1,606,580,154	0.69
	ポーランド	1,598,172,351	0.68
	スウェーデン	1,308,765,118	0.56
	マレーシア	1,272,521,287	0.54
	南アフリカ	1,151,820,718	0.49
	シンガポール	876,796,179	0.37
スイス	822,448,649	0.35	
ノルウェー	668,668,961	0.29	
小計		228,258,877,108	97.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,915,364,920	2.53
合計(純資産総額)		234,174,242,028	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 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,466.19	2,909,601,597	10,438.87	2,902,006,768	1.375	2015/11/30	1.24
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/30/15	22,000,000	10,314.73	2,269,240,628	10,309.30	2,268,047,393	0.375	2015/06/30	0.97
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,271.94	1,848,949,719	10,255.06	1,845,912,420	0.250	2016/04/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/15/17	16,000,000	10,332.80	1,653,249,472	10,274.15	1,643,864,402	0.875	2017/04/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,296.04	1,637,071,687	10,292.43	1,636,496,776	0.250	2015/10/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/18	15,600,000	10,239.43	1,597,352,242	10,139.76	1,581,803,275	1.250	2018/10/31	0.68
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,480.85	1,572,128,541	10,450.12	1,567,518,372	1.750	2015/07/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,299.66	1,441,952,980	10,296.85	1,441,559,254	0.250	2015/07/15	0.62

アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,332.20	1,374,183,464	10,299.66	1,369,855,331	0.625	2016/07/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,798.64	1,349,830,924	10,723.31	1,340,414,724	4.250	2015/08/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	10,038.32	1,254,790,093	9,942.90	1,242,862,901	2.000	2023/02/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	10,322.56	1,238,707,718	10,268.72	1,232,247,458	0.750	2017/01/15	0.53
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 08/01/18	7,500,000	15,526.41	1,164,480,829	15,651.18	1,173,838,965	4.500	2018/08/01	0.50
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	7,150,000	15,897.77	1,136,691,219	16,025.31	1,145,809,893	3.500	2020/04/25	0.49
フランス	国債証券	BTNS 2.25% 02/25/16	8,000,000	14,289.79	1,143,183,288	14,253.27	1,140,261,928	2.250	2016/02/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/16	11,000,000	10,300.99	1,133,109,763	10,285.40	1,131,394,189	0.375	2016/03/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,416.75	1,118,841,668	11,295.62	1,106,970,934	4.500	2017/05/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	10,016.82	1,101,850,931	9,913.77	1,090,515,335	1.250	2020/02/29	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,586.31	1,090,390,795	10,545.53	1,086,190,611	2.000	2016/01/31	0.46
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	16,222.98	1,070,717,161	16,256.54	1,072,931,745	4.250	2019/04/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/44	9,900,000	10,362.80	1,025,917,642	10,416.17	1,031,201,221	3.375	2044/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	10,941.67	1,039,458,952	10,854.29	1,031,157,625	3.000	2017/02/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	10,351.69	1,035,169,184	10,296.45	1,029,645,008	0.875	2017/01/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	10,000,000	10,295.80	1,029,580,440	10,250.44	1,025,044,887	0.625	2016/12/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	10,000,000	10,327.38	1,032,738,541	10,209.67	1,020,967,039	1.500	2019/01/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/28/19	10,000,000	10,319.35	1,031,935,025	10,200.22	1,020,022,907	1.500	2019/02/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	10,155.83	1,025,739,324	10,071.66	1,017,238,324	0.750	2018/02/28	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/31/17	10,000,000	10,186.56	1,018,656,936	10,108.62	1,010,862,829	0.750	2017/12/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/18	10,000,000	10,126.66	1,012,666,885	10,054.39	1,005,439,105	0.750	2018/03/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	10,200,000	9,789.83	998,563,017	9,701.44	989,547,572	1.750	2023/05/15	0.42

(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

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	34	4,049,526.68	4,039,359.46	415,448,120	0.18
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	19	2,374,935.42	2,368,468.75	243,597,010	0.10
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	13	1,784,770.75	1,787,500	183,844,375	0.08
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	23	2,545,592	2,545,065	350,709,957	0.15
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	24	3,080,116	3,079,200	424,313,760	0.18

EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	37	5,466,628	5,479,700	755,102,660	0.32
-----------	-------------------	----	-----	----	-----------	-----------	-------------	------

(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	4,344,412,870	14.69
	台湾	3,289,815,460	11.13
	ブラジル	3,007,524,811	10.17
	中国	2,783,204,231	9.41
	南アフリカ	2,061,239,040	6.97
	インド	1,885,384,253	6.38
	メキシコ	1,373,580,776	4.65
	ロシア	1,301,084,972	4.40
	ケイマン	1,204,156,631	4.07
	香港	1,152,168,413	3.90
	マレーシア	1,065,799,103	3.60
	インドネシア	720,060,608	2.44
	タイ	623,387,436	2.11
	トルコ	503,569,419	1.70
	ポーランド	432,379,767	1.46
	チリ	399,101,202	1.35
	バミューダ	313,521,175	1.06
	フィリピン	275,092,609	0.93
	コロンビア	243,519,756	0.82
	ギリシャ	191,413,764	0.65
	アラブ首長国連邦	148,403,673	0.50
	カタール	114,483,088	0.39
	チェコ	74,182,916	0.25
	エジプト	58,339,213	0.20
ハンガリー	55,061,090	0.19	
アメリカ	32,078,077	0.11	
ペルー	20,268,155	0.07	
小計		27,673,232,508	93.59
投資信託受益証券	ブラジル	78,832,483	0.27
	南アフリカ	19,579,666	0.07
	メキシコ	9,291,352	0.03
	小計		107,703,501
投資証券	メキシコ	46,635,636	0.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,741,003,097	5.89
合計(純資産総額)		29,568,574,742	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	7,077	140,312.72	992,993,127	140,197.49	992,177,707	3.36
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,572,389	370.97	583,314,316	427.03	671,465,136	2.27
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	329,600	1,144.96	377,380,151	1,705.19	562,032,272	1.90
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	386,000	1,055.64	407,477,487	1,142.54	441,023,142	1.49
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	4,594,620	77.38	355,554,689	79.08	363,384,820	1.23
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,701,515	68.49	322,029,230	70.59	331,910,033	1.12
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	25,309	9,393.08	237,729,679	12,836.78	324,886,318	1.10
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	185,009	1,361.53	251,895,347	1,640.39	303,488,171	1.03
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	381,370	909.17	346,731,257	766.74	292,414,208	0.99
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,177,540	107.68	234,495,739	122.69	267,175,665	0.90
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	702,352	261.97	184,001,382	358.43	251,747,539	0.85
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,042,200	46.92	236,622,463	49.49	249,574,277	0.84
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	9,994	24,678.19	246,633,876	24,572.24	245,575,066	0.83
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	265,140	869.58	230,562,205	908.53	240,888,837	0.81
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	106,757	1,935.99	206,681,266	2,149.41	229,465,203	0.78
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	296,800	788.85	234,133,204	750.62	222,786,390	0.75
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	135,200	1,401.73	189,514,522	1,597.83	216,026,710	0.73
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,131,000	197.38	223,247,121	185.24	209,516,845	0.71
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	34,716	4,986.13	173,098,648	6,031.46	209,388,220	0.71
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	33,424	6,412.94	214,346,252	5,790.45	193,540,167	0.65
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,340,000	114.42	153,326,509	138.53	185,641,992	0.63
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	93,818	1,427.12	133,890,471	1,881.46	176,514,955	0.60
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	36,125	3,473.25	125,471,264	4,698.37	169,728,796	0.57
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	29,042	5,841.97	169,662,748	5,833.90	169,428,298	0.57
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,619,400	84.77	137,291,804	102.31	165,683,566	0.56
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	191,100	828.59	158,345,052	854.98	163,387,365	0.55
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	122,615	1,468.54	180,065,388	1,324.12	162,357,721	0.55
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	183,361	1,240.35	227,432,249	863.93	158,412,902	0.54

台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	89,804	1,488.35	133,660,233	1,721.85	154,629,915	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	半導体・半導体製造装置	1,300	99,806.42	129,748,352	113,364.00	147,373,200	0.50

(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	93.59
投資信託受益証券	0.36
投資証券	0.16
合計	94.11

(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	9.77
		素材	8.22
		資本財	4.47
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	3.55
		耐久消費財・アパレル	0.90
		消費者サービス	0.96
		メディア	1.76
		小売	1.64
		食品・生活必需品小売り	1.89
		食品・飲料・タバコ	4.76
		家庭用品・パーソナル用品	1.03
		ヘルスケア機器・サービス	0.58
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.12
		銀行	17.97
		各種金融	2.42
		保険	3.18
		不動産	1.85
		ソフトウェア・サービス	4.26
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.54
電気通信サービス	6.83		
公益事業	3.18		
半導体・半導体製造装置	8.18		
合計		93.59	

(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	324	17,179,558	17,402,040	1,789,799,814	6.05

(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	マレーシア	4,349,829,685	10.09
	南アフリカ	4,276,759,490	9.92
	メキシコ	4,270,081,404	9.90
	トルコ	4,245,102,603	9.85
	ブラジル	4,203,712,178	9.75
	ポーランド	4,175,358,582	9.68
	ロシア	3,501,229,406	8.12
	インドネシア	3,257,032,697	7.55
	タイ	2,986,196,700	6.93
	コロンビア	2,247,194,325	5.21
	ハンガリー	2,234,647,078	5.18
	ナイジェリア	723,943,077	1.68
	ペルー	692,828,082	1.61
	フィリピン	183,793,964	0.43
	チリ	47,780,550	0.11
	小計	41,395,489,821	96.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,721,343,239	3.99
合計(純資産総額)		43,116,833,060	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	RUSSIA 7.85% 03/10/18	420,000,000	293.69	1,233,508,475	277.87	1,167,075,420	7.850	2018/03/10	2.71
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	305,500,000	293.18	895,682,672	267.31	816,633,272	7.600	2021/04/14	1.89
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	13,500,000,000	6.09	822,399,302	5.95	803,929,171	12.000	2015/10/22	1.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	69,500,000	1,124.48	781,519,437	1,125.96	782,544,754	10.500	2026/12/21	1.81
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	11,350,000,000	6.21	705,506,978	6.14	697,263,607	7.750	2021/04/14	1.62
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	256,500,000	296.71	761,085,541	269.26	690,664,725	8.150	2027/02/03	1.60
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	13,150,000	4,862.27	639,388,817	4,927.40	647,954,220	9.000	2017/03/08	1.50
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	180,000,000	323.61	582,503,135	326.92	588,463,299	3.250	2017/06/16	1.36

南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	59,000,000	996.07	587,684,888	993.11	585,939,516	8.250	2017/09/15	1.36
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	174,000,000	328.71	571,955,480	333.06	579,541,104	3.875	2019/06/13	1.34
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	15,400,000	3,611.29	556,139,038	3,648.52	561,873,385	0.000	2016/01/01	1.30
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	12,200,000	4,255.81	519,208,913	4,390.63	535,657,040	7.100	2023/03/08	1.24
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	7,500,000,000	7.23	542,427,508	7.09	531,952,785	9.850	2027/06/28	1.23
トルコ	国債証券	TURKGB 8.8% 11/14/18	10,300,000	4,897.99	504,493,169	4,924.39	507,212,275	8.800	2018/11/14	1.18
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/18	10,650,000	4,318.50	459,920,918	4,383.12	466,802,629	10.000	2018/01/01	1.08
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.625% 05/15/33	63,250,000,000	0.70	448,604,722	0.72	458,432,046	6.625	2033/05/15	1.06
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	4,827.65	458,627,643	4,754.40	451,668,429	12.500	2016/01/05	1.05
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	44,000,000	991.34	436,193,413	984.11	433,012,179	8.000	2018/12/21	1.00
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	45,500,000	945.62	430,260,394	946.02	430,442,341	7.250	2020/01/15	1.00
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000	4,338.29	412,137,656	4,443.13	422,097,571	10.000	2017/01/01	0.98
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.75% 03/31/21	46,100,000	910.95	419,950,960	909.90	419,466,202	6.750	2021/03/31	0.97
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	9,800,000	4,120.12	403,772,051	4,235.84	415,113,216	10.000	2021/01/01	0.96
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	10,550,000	3,726.32	393,127,085	3,914.74	413,005,634	5.750	2022/09/23	0.96
トルコ	国債証券	TURKGB 8.3% 06/20/18	8,500,000	4,523.97	384,537,647	4,837.96	411,227,434	8.300	2018/06/20	0.95
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000	3,946.33	404,499,354	3,978.97	407,844,834	0.000	2015/04/01	0.95
ロシア	国債証券	RFLB 7% 06/03/15	140,000,000	293.85	411,399,800	287.00	401,812,110	7.000	2015/06/03	0.93
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	42,000,000,000	0.89	376,305,350	0.91	383,544,966	8.375	2024/03/15	0.89
インドネシア	国債証券	INDOGB 9% 03/15/29	41,000,000,000	0.92	378,574,405	0.93	381,320,500	9.000	2029/03/15	0.88
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	713,000,000	49.32	351,657,124	53.00	377,908,452	7.000	2019/10/23	0.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	40,500,000	917.61	371,633,467	929.18	376,321,573	8.750	2048/02/28	0.87

(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	96.01
合計	96.01

(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	30,477,621,840	98.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		402,806,302	1.30
合計(純資産総額)		30,880,428,142	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	4,996	586,868.11	2,931,993,079	580,000.00	2,897,680,000	9.38
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,428	545,301.85	2,414,596,603	582,000.00	2,577,096,000	8.35
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	8,167	200,817.48	1,640,076,373	227,600.00	1,858,809,200	6.02
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	8,889	149,104.70	1,325,391,699	165,900.00	1,474,685,100	4.78
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	5,533	196,794.12	1,088,861,892	240,300.00	1,329,579,900	4.31
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	4,600	223,726.02	1,029,139,716	245,500.00	1,129,300,000	3.66
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,919	336,197.76	981,361,269	357,500.00	1,043,542,500	3.38
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,755	494,522.07	867,886,246	567,000.00	995,085,000	3.22
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	6,957	124,972.67	869,434,870	141,800.00	986,502,600	3.19
日本	投資証券	G L P 投資法人	7,422	101,101.18	750,372,984	114,800.00	852,045,600	2.76
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	4,671	169,793.19	793,104,004	176,500.00	824,431,500	2.67
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	888	810,734.16	719,931,934	918,000.00	815,184,000	2.64
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,546	445,190.27	688,264,166	519,000.00	802,374,000	2.60
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	4,900	134,193.44	657,547,885	151,100.00	740,390,000	2.40
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5,892	103,983.71	612,672,033	124,900.00	735,910,800	2.38
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	1,256	468,353.62	588,252,150	562,000.00	705,872,000	2.29
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,937	209,939.14	616,591,263	236,700.00	695,187,900	2.25
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,318	476,323.39	627,794,231	488,500.00	643,843,000	2.08
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,633	351,818.14	574,519,031	393,500.00	642,585,500	2.08
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,323	416,813.54	551,444,319	484,000.00	640,332,000	2.07
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	4,291	124,177.56	532,845,949	138,300.00	593,445,300	1.92
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	586	879,571.01	515,428,614	904,000.00	529,744,000	1.72
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,275	46,727.42	433,396,825	57,000.00	528,675,000	1.71
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	3,459	122,882.86	425,051,843	140,100.00	484,605,900	1.57
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,038	394,133.89	409,110,977	458,000.00	475,404,000	1.54
日本	投資証券	福岡リート投資法人	2,441	160,497.82	391,775,178	187,000.00	456,467,000	1.48
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,361	140,119.86	470,942,849	135,200.00	454,407,200	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,307	145,111.77	334,772,866	177,200.00	408,800,400	1.32
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	5,219	65,190.71	340,230,350	75,700.00	395,078,300	1.28
日本	投資証券	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	3,238	98,354.90	318,473,166	105,600.00	341,932,800	1.11

(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	98.70

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 (%)
不動産投信指数先物取引	東証REIT指数先物	大阪取引所	買建	円	250	388,842,300	402,500,000	402,500,000	1.30

(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	25,120,084,838	67.50
	オーストラリア	3,538,516,652	9.51
	イギリス	2,474,903,044	6.65
	フランス	1,866,467,416	5.02
	シンガポール	1,360,462,181	3.66
	カナダ	959,754,370	2.58
	香港	670,687,560	1.80
	オランダ	444,135,819	1.19
	ベルギー	199,017,139	0.53
	ニュージーランド	125,803,146	0.34
	アイルランド	67,152,971	0.18
	ドイツ	57,971,150	0.16
	イタリア	38,010,003	0.10
	マン島	27,797,022	0.07
	イスラエル	16,581,725	0.04
ギリシャ	13,091,000	0.04	
小計		36,980,436,036	99.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		231,919,740	0.62
合計(純資産総額)		37,212,355,776	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	123,690	15,248.77	1,886,121,214	17,500.95	2,164,693,247	5.82
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	38,750	26,569.79	1,029,579,565	28,166.32	1,091,444,900	2.93
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	57,830	16,664.96	963,735,154	18,025.49	1,042,414,144	2.80
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	134,110	5,560.17	745,675,251	6,828.21	915,731,444	2.46
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	199,560	4,047.97	807,813,237	4,261.07	850,340,226	2.29
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	120,880	6,232.54	753,390,118	6,585.48	796,053,487	2.14
アメリカ	投資証券	HCP INC	181,340	4,087.17	741,167,993	4,312.50	782,028,840	2.10
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	116,510	6,374.41	742,683,228	6,568.00	765,237,796	2.06
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	68,990	9,418.43	649,777,625	11,018.32	760,153,931	2.04
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	48,700	12,928.24	629,605,712	15,528.29	756,227,869	2.03
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	60,590	10,722.81	649,695,381	12,442.79	753,908,827	2.03
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	302,590	1,983.72	600,254,295	2,323.38	703,032,008	1.89
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,032,440	291.41	592,287,521	327.08	664,785,108	1.79
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	311,400	1,732.55	539,518,269	1,825.26	568,385,964	1.53
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	765,620	670.15	513,084,928	727.07	556,662,089	1.50
香港	投資証券	LINK REIT	919,000	508.03	466,887,867	579.89	532,927,181	1.43
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	408,630	1,109.34	453,313,125	1,234.52	504,465,993	1.36
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	206,990	2,165.13	448,161,218	2,424.17	501,779,879	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	25,060	16,690.42	418,262,113	19,880.90	498,215,479	1.34
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	358,200	1,360.97	487,502,722	1,361.73	487,773,118	1.31
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	38,310	9,771.93	374,362,750	11,248.70	430,937,869	1.16
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	88,950	4,197.73	373,388,284	4,467.80	397,411,165	1.07
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	162,490	2,193.23	356,378,009	2,354.23	382,539,888	1.03
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	55,680	6,028.32	335,657,072	6,799.41	378,591,343	1.02
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	926,710	380.75	352,850,176	392.31	363,560,194	0.98
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	53,660	5,053.88	271,191,553	6,662.62	357,516,350	0.96
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,490	11,105.03	294,172,495	12,685.51	336,039,398	0.90
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	605,000	479.66	290,196,123	512.21	309,888,744	0.83
アメリカ	投資証券	UDR INC	101,390	2,531.73	256,692,302	3,014.53	305,643,551	0.82
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	280,600	924.48	259,410,711	1,050.09	294,655,254	0.79

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.38
合計	99.38

(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	11,385,248,160	75.41
	ジャージー	2,618,134,378	17.34
	アメリカ	684,615,676	4.53
	小計	14,687,998,214	97.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		409,275,507	2.71
合計(純資産総額)		15,097,273,721	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			
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	193,140,000	1,430.17	2,762,241,424	1,355.56	2,618,134,378	0.0		17.34
イギリス	社債券	CS USD COM 006 10/24/14	15,000,000	10,913.41	1,637,012,025	10,334.36	1,550,155,200	0.0	2014/10/24	10.27
イギリス	社債券	UBS USD COM 004 08/11/14	13,000,000	11,077.97	1,440,136,555	10,490.70	1,363,791,000	0.0	2014/08/11	9.03
イギリス	社債券	BAR USD COM 026 11/28/14	10,000,000	11,083.83	1,108,383,595	10,499.44	1,049,944,225	0.0	2014/11/28	6.95
イギリス	社債券	UBS USD COM 005 11/05/14	10,000,000	10,960.72	1,096,072,450	10,380.65	1,038,065,050	0.0	2014/11/05	6.88
イギリス	社債券	BAR USD COM 029 06/26/15	10,000,000	10,259.90	1,025,990,460	10,043.40	1,004,340,535	0.0	2015/06/26	6.65
イギリス	社債券	CS USD COM 007 05/29/15	10,000,000	10,153.55	1,015,355,770	9,850.97	985,097,300	0.0	2015/05/29	6.53
イギリス	社債券	BAR USD COM 028 05/29/15	10,000,000	10,161.88	1,016,188,855	9,712.84	971,284,545	0.0	2015/05/29	6.43
イギリス	社債券	UBS USD COM 006 04/30/15	10,000,000	10,057.49	1,005,749,580	9,553.73	955,373,650	0.0	2015/04/30	6.33
イギリス	社債券	BAR USD COM 025 08/29/14	8,500,000	10,723.75	911,519,438	10,159.93	863,594,424	0.0	2014/08/29	5.72
イギリス	社債券	CS USD COM 008 07/31/15	8,000,000	10,341.56	827,325,400	10,231.51	818,521,440	0.0	2015/07/31	5.42
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	17,760,000	4,009.45	712,079,542	3,854.81	684,615,676	0.0	2036/06/12	4.53
イギリス	社債券	BAR USD COM 027 03/27/15	5,000,000	10,125.71	506,285,707	9,601.45	480,072,945	0.0	2015/03/27	3.18
イギリス	社債券	BAR USD COM 030 07/31/15	3,000,000	10,285.00	308,550,000	10,166.92	305,007,846	0.0	2015/07/31	2.02

(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	97.29
合計	97.29

(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	6,412,337,800	95.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		334,277,902	4.95
合計(純資産総額)		6,746,615,702	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% 0 3 / 3 1 / 2 2	7,090,000,000	86.48	6,132,131,650	90.44	6,412,337,800	0.0	2022/03/31	95.05

(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	95.05
合計	95.05

(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。

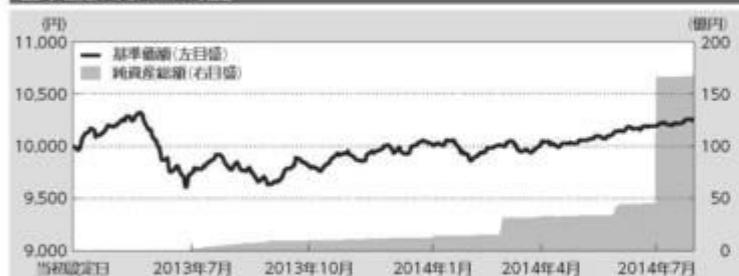
(参考情報) 交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2013年3月29日
作成基準日：2014年7月31日

分散投資コア戦略ファンドA

基準価額・純資産の推移



基準価額	10,258円
純資産総額	169.21億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

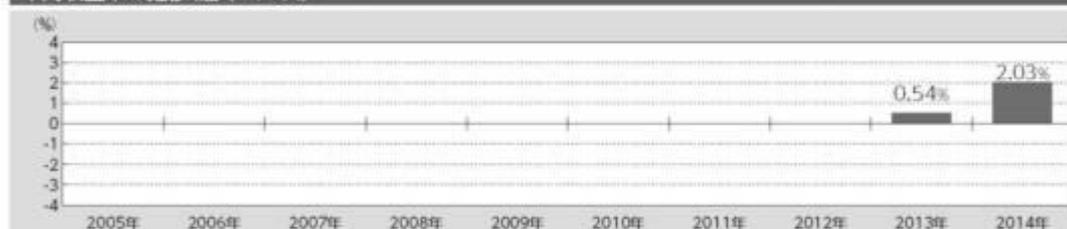
決算期	2013年7月	2014年7月			
分配金	0円	0円	-	-	-

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
FOFs用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)	13.3%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^A JPY	9.0%
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)	8.8%
HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス	7.4%
国内債券インデックス マザーファンド	7.3%
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)	7.3%
新興国債券インデックス マザーファンド	5.5%
外国債券インデックス マザーファンド	5.5%
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)	4.5%
FRM シグマリンク マザーファンド	4.5%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2014年は年初から作成基準日までの収益率です。

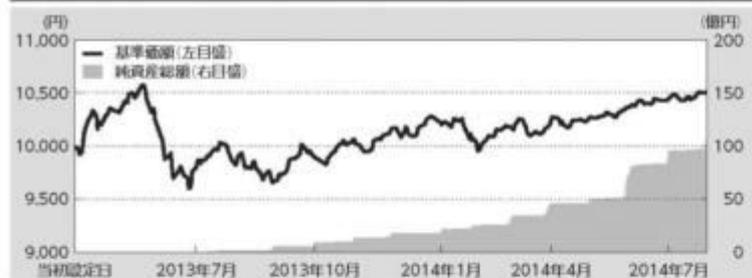
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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


運用実績

当初設定日：2013年3月29日

作成基準日：2014年7月31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	10.519円
純資産総額	107.54億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

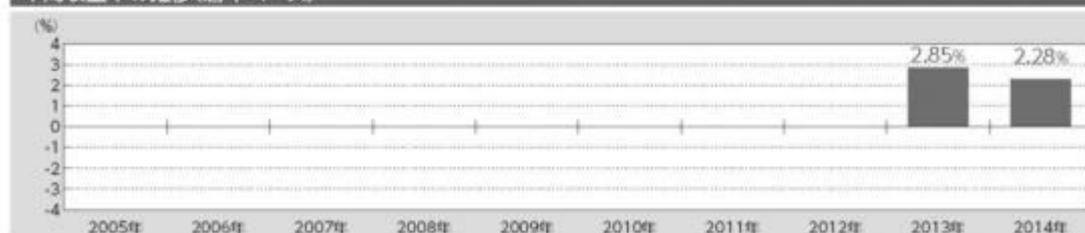
分配の推移(1万口当たり、税引前)**設定来分配金合計額:0円**

決算期	2013年7月	2014年7月	-	-	-
分配金	0円	0円	-	-	-

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
FOFs用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)	9.4%
外国債券インデックス マザーファンド	9.2%
新興国債券インデックス マザーファンド	9.1%
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	8.9%
外国株式インデックス マザーファンド	7.2%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{A, P, F}	7.0%
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%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.1%
J-REITインデックス マザーファンド	4.0%
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)	3.7%

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2014年は年初から作成基準日までまでの収益率です。

※ファンド内には、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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

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

<その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

イ．内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

ロ．外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

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

ハ．外国投資信託証券

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

ニ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ホ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等（仕組債を含みます。）

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

- a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
- c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

（ニ）信用取引

原則として当該信用取引に係る銘柄の取引所における計算日の最終相場で評価します。

ヘ．外貨建資産等の円換算

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

<基準価額の照会方法>

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（平成25年 3月29日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は平成25年3月29日から平成25年7月10日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

上記 の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示

をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

上記 の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記 から までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記 < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。

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

< 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還、重大な約款変更又はファンドの併合を行う場合には、書面決議において当該ファンドの償還、重大な約款変更又はファンドの併合に反対した受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に期中の運用経過のほか、投資信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、知っている受益者に対して交付します。

平成26年12月1日以降は交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されて

いる受益権については原則として取得申込者とします。) に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

分散投資コア戦略ファンドA

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成25年7月11日から平成26年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【分散投資コア戦略ファンドA】

(1)【貸借対照表】

項目	第1期 (平成25年 7月10日現在) 金額(円)	第2期 (平成26年 7月10日現在) 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,489,243	184,536,443
投資信託受益証券	100,639,891	8,637,205,406
投資証券	25,925,595	1,478,218,280
親投資信託受益証券	127,561,129	6,361,329,058
未収入金	-	2,710,963
未収利息	17	239
流動資産合計	265,615,875	16,664,000,389
資産合計	265,615,875	16,664,000,389
負債の部		
流動負債		
未払金	6,721,000	1,200,000
未払解約金	-	10,735,209
未払受託者報酬	2,666	958,321
未払委託者報酬	61,660	22,041,318
その他未払費用	250	95,771
流動負債合計	6,785,576	35,030,619
負債合計	6,785,576	35,030,619
純資産の部		
元本等		
元本	263,825,167	16,289,750,554
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,994,868	339,219,216

(分配準備積立金)	(1,674,990)	(114,680,242)
元本等合計	258,830,299	16,628,969,770
純資産合計	258,830,299	16,628,969,770
負債純資産合計	265,615,875	16,664,000,389

(2)【損益及び剰余金計算書】

項目	第1期	第2期
	自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日 金額(円)	自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日 金額(円)
営業収益		
受取利息	132	27,613
有価証券売買等損益	1,739,434	144,718,691
営業収益合計	1,739,566	144,746,304
営業費用		
受託者報酬	2,666	1,201,312
委託者報酬	61,660	27,630,076
その他費用	250	120,010
営業費用合計	64,576	28,951,398
営業利益又は営業損失（ ）	1,674,990	115,794,906
経常利益又は経常損失（ ）	1,674,990	115,794,906
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,674,990	115,794,906
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	2,499,335
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	4,994,868
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	230,918,513
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,140,547
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	227,777,966
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,669,858	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,669,858	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,994,868	339,219,216

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成25年 7月10日現在)	第2期 (平成26年 7月10日現在)
1. 期首元本額	1,000,000円	263,825,167円
期中追加設定元本額	262,825,167円	16,300,810,769円
期中一部解約元本額	- 円	274,885,382円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	263,825,167口	16,289,750,554口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 4,994,868円	
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9811円 (9,811円)	1.0208円 (10,208円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第1期 自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日	第2期 自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日
費用控除後の配当等収益額	A	74,758円 (77,506円)	17,125,870円 (21,475,708円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,600,232円	96,169,701円
収益調整金額	C	70,140円	224,538,974円
分配準備積立金額	D	- 円	1,384,671円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,745,130円	339,219,216円
当ファンドの期末残存口数	F	263,825,167口	16,289,750,554口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	66.14円	208.24円
1万口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円	- 円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、商品(コモディティ)の価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク、カントリーリスク、資産等の選定・配分にかかるリスク、ヘッジファンドの運用手法に係るリスク、仕組み債券に係るリスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (平成25年 7月10日現在)	第2期 (平成26年 7月10日現在)
	計算期間(自 平成25年3月29日 至 平成25年 7月10日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日)の損益に含ま れた評価差額(円)
投資信託受益証券	76,127	59,969,768
投資証券	249,595	10,593,898
親投資信託受益証券	1,413,982	67,840,884
合計	1,739,704	138,404,550

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	1,129,671,778	1,111,709,996	
	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)	1,394,604,086	1,472,980,835	
	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)	779,721,109	757,109,196	
	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)	142,912,990	153,902,998	
	FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用)	465,614,766	474,088,954	
	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)	1,159,190,802	1,212,513,578	
	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)	2,180,752,854	2,225,022,136	
	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	1,190,857.0202	1,229,877,713	

投資信託受益証券 小計		7,253,659,242.0202	8,637,205,406	
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H,} JPY	821,232.378	1,478,218,280	
投資証券 小計		821,232.378	1,478,218,280	
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	434,206,721	602,852,611	
	国内債券インデックス マザーファンド	941,722,111	1,220,000,994	
	外国株式インデックス マザーファンド	309,328,075	535,663,427	
	外国債券インデックス マザーファンド	361,417,170	911,819,378	
	新興国株式インデックス マザーファンド	99,156,054	233,631,494	
	新興国債券インデックス マザーファンド	542,595,125	920,132,812	
	J-REITインデックス マザーファンド	258,467,435	331,639,565	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	253,292,171	332,040,706	
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファン ド	340,079,302	158,170,883	
	FRM シグマ リンク マザーファンド	1,248,463,385	1,115,377,188	
親投資信託受益証券 小計		4,788,727,549	6,361,329,058	
合計		12,043,208,023.3982	16,476,752,744	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

分散投資コア戦略ファンドS

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成25年7月11日から平成26年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(1)【貸借対照表】

項目	第1期 (平成25年 7月10日現在) 金額(円)	第2期 (平成26年 7月10日現在) 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,265,710	124,206,548
投資信託受益証券	13,349,327	3,422,939,833
投資証券	4,057,451	660,126,180
親投資信託受益証券	35,783,610	5,393,695,327
未収利息	6	161
流動資産合計	57,456,104	9,600,968,049
資産合計	57,456,104	9,600,968,049
負債の部		
流動負債		
未払金	3,161,000	850,000
未払解約金	-	9,252,151
未払受託者報酬	325	1,254,037
未払委託者報酬	7,716	28,842,644
その他未払費用	13	125,345
流動負債合計	3,169,054	40,324,177
負債合計	3,169,054	40,324,177
純資産の部		
元本等		
元本	54,750,331	9,148,260,389
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	463,281	412,383,483
(分配準備積立金)	(236,214)	(205,444,005)
元本等合計	54,287,050	9,560,643,872
純資産合計	54,287,050	9,560,643,872
負債純資産合計	57,456,104	9,600,968,049

(2)【損益及び剰余金計算書】

項目	第1期	第2期
	自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日 金額(円)	自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日 金額(円)
営業収益		
受取利息	17	22,736
有価証券売買等損益	244,251	244,401,614
営業収益合計	244,268	244,424,350
営業費用		
受託者報酬	325	1,494,304
委託者報酬	7,716	34,368,599
その他費用	13	149,315
営業費用合計	8,054	36,012,218
営業利益又は営業損失（ ）	236,214	208,412,132
経常利益又は経常損失（ ）	236,214	208,412,132
当期純利益又は当期純損失（ ）	236,214	208,412,132
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	3,190,730
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	463,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	208,845,900
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	208,845,900
剰余金減少額又は欠損金増加額	699,495	1,220,538
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,220,538
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	699,495	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	463,281	412,383,483

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成25年 7月10日現在)	第2期 (平成26年 7月10日現在)
1. 期首元本額	1,000,000円	54,750,331円
期中追加設定元本額	53,750,331円	9,258,266,615円
期中一部解約元本額	- 円	164,756,557円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	54,750,331口	9,148,260,389口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 463,281円	
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9915円 (9,915円)	1.0451円 (10,451円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第1期 自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日	第2期 自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日
費用控除後の配当等収益額	A	26,196円 (27,072円)	39,849,365円 (46,820,202円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	210,018円	165,372,037円
収益調整金額	C	20,167円	206,939,478円
分配準備積立金額	D	- 円	222,603円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	256,381円	412,383,483円
当ファンドの期末残存口数	F	54,750,331口	9,148,260,389口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	46.82円	450.77円
1万口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円	- 円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、商品(コモディティ)の価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク、カントリーリスク、資産等の選定・配分にかかるリスク、ヘッジファンドの運用手法に係るリスク、仕組み債券に係るリスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (平成25年 7月10日現在)	第2期 (平成26年 7月10日現在)
	計算期間(自 平成25年3月29日 至 平成25年 7月10日)の損益に 含まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成25年 7月11 日 至 平成26年 7月10日)の損 益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	5,505	55,406,351
投資証券	10,451	9,555,483
親投資信託受益証券	228,402	172,020,163
合計	244,358	236,981,997

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	507,722,490	499,649,702	
	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)	623,781,744	658,838,278	
	F0Fs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)	214,106,730	207,897,634	
	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資 家専用)	201,550,860	217,050,121	
	F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用)	133,147,671	135,570,958	
	F0Fs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)	342,669,484	358,432,280	
	F0Fs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機 関投資家専用)	969,840,121	989,527,875	

	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	344,678.9255	355,972,985	
投資信託受益証券 小計		2,993,163,778.9255	3,422,939,833	
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H} , JPY	366,736.767	660,126,180	
投資証券 小計		366,736.767	660,126,180	
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	610,292,019	847,329,439	
	国内債券インデックス マザーファンド	273,868,696	354,796,895	
	外国株式インデックス マザーファンド	396,494,892	686,610,204	
	外国債券インデックス マザーファンド	347,218,511	875,997,581	
	新興国株式インデックス マザーファンド	126,076,931	297,062,464	
	新興国債券インデックス マザーファンド	519,007,865	880,133,537	
	J-REITインデックス マザーファンド	295,117,795	378,665,642	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	291,556,446	382,201,345	
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	387,963,017	180,441,599	
	FRM シグマ リンク マザーファンド	571,364,027	510,456,621	
親投資信託受益証券 小計		3,818,960,199	5,393,695,327	
合計		6,812,490,714.6925	9,476,761,340	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

< 参考 >

「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」は、「ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」、「グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド」、「FRM シグマ リンク マザーファンド」の受益証券を投

資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成26年7月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,541,908,887
株式	14,529,470,200
国債証券	10,997,685,000
未収入金	1,471,527,179
未収配当金	10,396,800
未収利息	13,678
流動資産合計	37,551,001,744
資産合計	37,551,001,744
負債の部	
流動負債	
未払金	532,296,319
未払解約金	5,387,431
流動負債合計	537,683,750
負債合計	537,683,750
純資産の部	
元本等	
元本	26,659,635,144
剰余金	
剰余金又は欠損金()	10,353,682,850
元本等合計	37,013,317,994
純資産合計	37,013,317,994
負債純資産合計	37,551,001,744

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	19,230,537,464円
計算期間中の追加設定元本額	17,803,750,613円
計算期間中の一部解約元本額	10,374,652,933円
計算日の元本額	26,659,635,144円
計算日の元本額の内訳	
ART テクニカル運用日本株式ファンド	3,937,800,254円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,523,698,129円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,040,998,323円
ART テクニカル運用日本株式ファンド(SMA専用)	12,008,866,102円
分散投資コア戦略ファンドA	434,206,721円
分散投資コア戦略ファンドS	610,292,019円
コア投資戦略ファンド(切替型)	510,195,481円
ART テクニカル運用日本株式ファンド(適格機関投資家専用)	3,593,578,115円
2. 計算日における受益権総数	26,659,635,144口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3884円 (13,884円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 時価の算定方法	(1)株式及び国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	70,463,637
国債証券	1,228,000
合計	69,235,637

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年11月26日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本水産	431,700	321.00	138,575,700	
清水建設	183,000	681.00	124,623,000	
鹿島建設	779,000	430.00	334,970,000	
アサヒグループホールディングス	110,400	3,266.00	360,566,400	
宝ホールディングス	166,000	889.00	147,574,000	
東洋紡	1,954,000	171.00	334,134,000	
東レ	504,000	680.00	342,720,000	
日本曹達	257,000	548.00	140,836,000	
三井化学	1,277,000	268.00	342,236,000	
資生堂	179,900	1,847.00	332,275,300	
協和発酵キリン	92,000	1,396.00	128,432,000	
塩野義製薬	161,300	2,132.00	343,891,600	
昭和シェル石油	103,600	1,144.00	118,518,400	
JXホールディングス	656,600	531.00	348,654,600	
ブリヂストン	95,600	3,702.00	353,911,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	233,600	2,084.00	486,822,400	
東邦亜鉛	306,000	445.00	136,170,000	
三菱マテリアル	1,027,000	370.00	379,990,000	
住友金属鉱山	215,000	1,716.00	368,940,000	
古河機械金属	1,783,000	208.00	370,864,000	
東洋製罐グループホールディングス	89,300	1,556.00	138,950,800	
日本製鋼所	433,000	441.00	190,953,000	
オークマ	349,000	949.00	331,201,000	
アマダ	813,000	1,009.00	820,317,000	

日立造船	396,300	538.00	213,209,400	
富士通	468,000	766.00	358,488,000	
アルプス電気	255,700	1,420.00	363,094,000	
パイオニア	523,000	259.00	135,457,000	
本田技研工業	39,300	3,573.00	140,418,900	
スズキ	145,400	3,274.00	476,039,600	
富士重工業	121,100	2,881.00	348,889,100	
オリンパス	101,100	3,620.00	365,982,000	
東京瓦斯	590,000	591.00	348,690,000	
京成電鉄	327,000	1,006.00	328,962,000	
トレンドマイクロ	37,900	3,435.00	130,186,500	
伊藤忠商事	266,500	1,301.00	346,716,500	
イオン	379,100	1,155.00	437,860,500	
ファーストリテイリング	3,700	33,505.00	123,968,500	
あおぞら銀行	387,000	336.00	130,032,000	
千葉銀行	180,000	731.00	131,580,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	264,000	496.00	130,944,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,718,300	201.00	345,378,300	
松井証券	135,100	985.00	133,073,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	132,200	2,356.00	311,463,200	
第一生命保険	220,200	1,428.00	314,445,600	
東急不動産ホールディングス	614,400	808.00	496,435,200	
三井不動産	104,000	3,382.00	351,728,000	
三菱地所	56,000	2,494.00	139,664,000	
東京建物	502,000	932.00	467,864,000	
電通	83,400	4,110.00	342,774,000	
合計	20,250,700	-	14,529,470,200	

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第419回国庫短期証券	2,000,000,000	1,999,770,000	
	第438回国庫短期証券	2,000,000,000	1,999,630,000	
	第460回国庫短期証券	7,000,000,000	6,998,285,000	
	国債証券 小計	11,000,000,000	10,997,685,000	
	合計	11,000,000,000	10,997,685,000	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,371,140,079
国債証券	207,779,061,450
地方債証券	16,242,522,924
特殊債券	22,616,745,169
社債券	14,617,771,290
派生商品評価勘定	1,317,732
未収利息	645,646,364
前払費用	20,332,532
流動資産合計	263,294,537,540
資産合計	263,294,537,540
負債の部	
流動負債	
前受金	1,100,000
未払解約金	200,946,571
流動負債合計	202,046,571
負債合計	202,046,571
純資産の部	
元本等	
元本	203,089,216,360
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	60,003,274,609
元本等合計	263,092,490,969
純資産合計	263,092,490,969
負債純資産合計	263,294,537,540

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	195,639,739,622円
計算期間中の追加設定元本額	71,535,448,882円
計算期間中の一部解約元本額	64,085,972,144円
計算日の元本額	203,089,216,360円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,160,759,741円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,745,806円
SMT 国内債券インデックス・オープン	4,698,703,477円
世界経済インデックスファンド	176,087,686円
マイセレクション25	149,037,652円
マイセレクション50	89,623,185円
マイセレクション75	28,453,891円
DCマイセレクション25	12,025,652,430円
DCマイセレクション50	14,688,757,413円
DCマイセレクション75	4,054,298,797円
DC日本債券インデックス・オープン	398,622,748円
DC日本債券インデックス・オープンS	49,745,868,161円
DC日本債券インデックス・オープンP	17,564,098,053円

DCマイセレクションS25	4,534,216,603円
DCマイセレクションS50	5,144,726,812円
DCマイセレクションS75	960,078,323円
DCターゲット・イヤールファンド2015	30,753,918円
DCターゲット・イヤールファンド2025	969,140,681円
DCターゲット・イヤールファンド2035	506,901,982円
DCターゲット・イヤールファンド2045	118,096,091円
DC世界経済インデックスファンド	176,476,158円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	937,176,793円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	35,715,309円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	254,339,247円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	34,117,708円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,471,999円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,267,823,701円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,793,782,584円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	3,757,513,529円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	508,316,049円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	16,116,980,030円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,795,625,682円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,318,806,861円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,264,578,681円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,886,078,541円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,358,111,116円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,328,782,484円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,596,871,881円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,554,511,812円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	258,992,042円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,043,196,670円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,871,493,269円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,290,785,552円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,825,853,863円
分散投資コア戦略ファンドA	941,722,111円
分散投資コア戦略ファンドS	273,868,696円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	913,049円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	33,352,624円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	18,247,314,692円
コア投資戦略ファンド(切替型)	229,804,675円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	9,857,555円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,130,707円

2. 担保に供している資産

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

国債証券 106,252,000円

	なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
3. 計算日における受益権総数	203,089,216,360口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2955円 (12,955円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	347,139,650	
地方債証券	32,098,989	
特殊債券	38,665,540	
社債券	20,809,760	
合計	438,713,939	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成26年5月30日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
債券関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,019,632,268	-	1,020,950,000	1,317,732
	合計	1,019,632,268	-	1,020,950,000	1,317,732

(注)1. 時価の算定方法

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

- 2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第331 回利付国債(2年)	790,000,000	790,379,200	
	第332 回利付国債(2年)	1,370,000,000	1,370,712,400	
	第333 回利付国債(2年)	1,290,000,000	1,290,722,400	
	第334 回利付国債(2年)	910,000,000	910,546,000	
	第335 回利付国債(2年)	1,190,000,000	1,190,749,700	
	第336 回利付国債(2年)	830,000,000	830,556,100	
	第337 回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,050,745,500	
	第338 回利付国債(2年)	1,100,000,000	1,100,825,000	
	第339 回利付国債(2年)	680,000,000	680,530,400	
	第340 回利付国債(2年)	640,000,000	640,524,800	
	第341 回利付国債(2年)	630,000,000	630,478,800	
	第91 回利付国債(5年)	200,000,000	200,818,000	
	第92 回利付国債(5年)	1,480,000,000	1,484,292,000	
	第93 回利付国債(5年)	1,110,000,000	1,117,081,800	
	第94 回利付国債(5年)	1,310,000,000	1,320,231,100	
	第95 回利付国債(5年)	620,000,000	625,623,400	
	第96 回利付国債(5年)	1,770,000,000	1,783,080,300	
	第97 回利付国債(5年)	2,700,000,000	2,717,712,000	
	第98 回利付国債(5年)	630,000,000	632,916,900	
	第99 回利付国債(5年)	2,600,000,000	2,619,006,000	
	第100 回利付国債(5年)	390,000,000	392,000,700	
	第101 回利付国債(5年)	820,000,000	826,674,800	
	第102 回利付国債(5年)	2,280,000,000	2,293,018,800	
	第103 回利付国債(5年)	2,090,000,000	2,103,146,100	
	第104 回利付国債(5年)	610,000,000	612,202,100	
	第105 回利付国債(5年)	3,260,000,000	3,272,388,000	
	第106 回利付国債(5年)	2,280,000,000	2,289,051,600	
	第107 回利付国債(5年)	920,000,000	923,615,600	
	第108 回利付国債(5年)	790,000,000	790,402,900	
	第109 回利付国債(5年)	990,000,000	990,178,200	
	第110 回利付国債(5年)	900,000,000	906,768,000	
	第111 回利付国債(5年)	1,290,000,000	1,304,435,100	
	第112 回利付国債(5年)	740,000,000	748,547,000	

第113回利付国債（5年）	3,880,000,000	3,909,643,200	
第114回利付国債（5年）	1,110,000,000	1,118,547,000	
第115回利付国債（5年）	1,960,000,000	1,966,938,400	
第116回利付国債（5年）	3,120,000,000	3,130,296,000	
第117回利付国債（5年）	3,560,000,000	3,570,751,200	
第118回利付国債（5年）	1,040,000,000	1,042,797,600	
第1回利付国債（40年）	150,000,000	174,355,500	
第2回利付国債（40年）	300,000,000	333,453,000	
第3回利付国債（40年）	340,000,000	377,753,600	
第4回利付国債（40年）	530,000,000	588,538,500	
第5回利付国債（40年）	490,000,000	517,229,300	
第6回利付国債（40年）	690,000,000	708,153,900	
第7回利付国債（40年）	200,000,000	193,800,000	
第272回利付国債（10年）	930,000,000	944,824,200	
第273回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,281,583,800	
第274回利付国債（10年）	730,000,000	745,125,600	
第275回利付国債（10年）	280,000,000	285,401,200	
第276回利付国債（10年）	480,000,000	490,636,800	
第277回利付国債（10年）	410,000,000	420,606,700	
第278回利付国債（10年）	720,000,000	741,052,800	
第279回利付国債（10年）	440,000,000	454,344,000	
第280回利付国債（10年）	600,000,000	621,324,000	
第281回利付国債（10年）	700,000,000	726,236,000	
第282回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,305,108,000	
第283回利付国債（10年）	280,000,000	290,637,200	
第284回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,258,097,500	
第285回利付国債（10年）	1,990,000,000	2,076,823,700	
第286回利付国債（10年）	870,000,000	913,935,000	
第287回利付国債（10年）	540,000,000	568,852,200	
第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,198,303,800	
第289回利付国債（10年）	2,430,000,000	2,548,656,900	
第290回利付国債（10年）	470,000,000	492,592,900	
第291回利付国債（10年）	840,000,000	877,296,000	
第292回利付国債（10年）	860,000,000	910,808,800	
第293回利付国債（10年）	370,000,000	394,649,400	
第294回利付国債（10年）	180,000,000	191,286,000	
第295回利付国債（10年）	100,000,000	105,486,000	
第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,221,170,000	
第297回利付国債（10年）	560,000,000	591,494,400	
第298回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,746,037,800	
第299回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,381,002,000	
第300回利付国債（10年）	830,000,000	882,713,300	
第301回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,322,633,600	

第302回利付国債（10年）	200,000,000	212,348,000	
第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,479,404,800	
第304回利付国債（10年）	480,000,000	508,406,400	
第305回利付国債（10年）	1,960,000,000	2,080,402,800	
第306回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,250,987,400	
第307回利付国債（10年）	800,000,000	850,872,000	
第308回利付国債（10年）	990,000,000	1,055,102,400	
第309回利付国債（10年）	1,480,000,000	1,559,934,800	
第310回利付国債（10年）	1,590,000,000	1,668,228,000	
第311回利付国債（10年）	160,000,000	165,916,800	
第312回利付国債（10年）	1,370,000,000	1,455,652,400	(注)
第313回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,294,772,600	
第314回利付国債（10年）	580,000,000	613,002,000	
第315回利付国債（10年）	1,060,000,000	1,127,861,200	
第316回利付国債（10年）	720,000,000	761,191,200	
第317回利付国債（10年）	480,000,000	507,547,200	
第318回利付国債（10年）	2,110,000,000	2,215,457,800	
第319回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,215,584,500	
第320回利付国債（10年）	1,620,000,000	1,700,611,200	
第321回利付国債（10年）	1,540,000,000	1,616,692,000	
第322回利付国債（10年）	1,030,000,000	1,073,177,600	
第323回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,312,479,000	
第324回利付国債（10年）	1,420,000,000	1,468,194,800	
第325回利付国債（10年）	2,360,000,000	2,437,714,800	
第326回利付国債（10年）	300,000,000	307,092,000	
第327回利付国債（10年）	1,840,000,000	1,898,493,600	
第328回利付国債（10年）	2,710,000,000	2,747,398,000	
第329回利付国債（10年）	2,340,000,000	2,409,287,400	
第330回利付国債（10年）	2,240,000,000	2,304,064,000	
第331回利付国債（10年）	750,000,000	757,912,500	
第332回利付国債（10年）	3,000,000,000	3,027,030,000	
第333回利付国債（10年）	2,750,000,000	2,770,267,500	
第334回利付国債（10年）	960,000,000	965,424,000	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	50,120,000	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	191,400,000	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	141,632,400	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	139,472,300	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	58,024,000	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	225,663,000	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	210,342,600	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	54,187,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	244,113,600	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	154,260,800	

第11回利付国債（30年）	90,000,000	95,397,300	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	213,504,900	
第13回利付国債（30年）	290,000,000	320,006,300	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	350,892,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	402,995,200	
第16回利付国債（30年）	370,000,000	438,191,000	
第17回利付国債（30年）	230,000,000	268,035,100	
第18回利付国債（30年）	445,000,000	510,050,100	
第19回利付国債（30年）	130,000,000	148,820,100	
第20回利付国債（30年）	230,000,000	271,337,900	
第21回利付国債（30年）	280,000,000	319,964,400	
第22回利付国債（30年）	400,000,000	471,616,000	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	506,819,500	
第24回利付国債（30年）	330,000,000	388,815,900	
第25回利付国債（30年）	320,000,000	365,116,800	
第26回利付国債（30年）	680,000,000	788,915,600	
第27回利付国債（30年）	580,000,000	684,487,000	
第28回利付国債（30年）	510,000,000	602,274,300	
第29回利付国債（30年）	790,000,000	917,814,100	
第30回利付国債（30年）	540,000,000	616,701,600	
第31回利付国債（30年）	580,000,000	650,644,000	
第32回利付国債（30年）	810,000,000	924,987,600	
第33回利付国債（30年）	740,000,000	798,304,600	
第34回利付国債（30年）	1,020,000,000	1,142,981,400	
第35回利付国債（30年）	920,000,000	989,717,600	
第36回利付国債（30年）	1,040,000,000	1,117,656,800	
第37回利付国債（30年）	860,000,000	903,971,800	
第38回利付国債（30年）	540,000,000	554,688,000	
第39回利付国債（30年）	640,000,000	671,334,400	
第40回利付国債（30年）	720,000,000	737,640,000	
第41回利付国債（30年）	580,000,000	580,000,000	
第42回利付国債（30年）	530,000,000	528,955,900	
第43回利付国債（30年）	240,000,000	239,287,200	
第29回利付国債（20年）	60,000,000	62,951,400	
第30回利付国債（20年）	80,000,000	83,454,400	
第31回利付国債（20年）	80,000,000	84,632,000	
第32回利付国債（20年）	50,000,000	53,063,000	
第33回利付国債（20年）	140,000,000	151,432,400	
第34回利付国債（20年）	50,000,000	54,598,500	
第35回利付国債（20年）	10,000,000	10,866,100	
第36回利付国債（20年）	70,000,000	76,507,900	
第37回利付国債（20年）	70,000,000	76,730,500	
第38回利付国債（20年）	20,000,000	21,915,600	

第39回利付国債（20年）	500,000,000	546,055,000	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	109,125,000	
第41回利付国債（20年）	330,000,000	351,037,500	
第42回利付国債（20年）	80,000,000	89,216,000	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	159,812,800	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	192,344,800	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	326,484,900	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	190,180,700	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	101,065,500	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	148,911,100	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	157,242,400	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	244,197,800	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	111,932,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	124,107,500	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	90,440,000	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	227,556,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	157,581,200	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	169,236,000	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	268,924,800	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	336,468,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	221,306,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	378,560,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	251,448,000	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	329,334,400	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	223,380,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	360,771,200	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	248,421,800	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	369,484,500	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	146,875,300	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	220,031,400	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	448,039,800	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	471,924,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	232,068,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	725,942,700	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	411,516,000	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	230,708,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	150,178,600	
第76回利付国債（20年）	170,000,000	192,863,300	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	331,922,400	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	192,973,800	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	309,420,000	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	254,513,600	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	447,466,500	

第 8 2 回利付国債（20年）	400,000,000	463,380,000	
第 8 3 回利付国債（20年）	200,000,000	231,854,000	
第 8 4 回利付国債（20年）	570,000,000	654,342,900	
第 8 5 回利付国債（20年）	290,000,000	336,202,800	
第 8 6 回利付国債（20年）	210,000,000	248,295,600	
第 8 7 回利付国債（20年）	410,000,000	480,040,300	
第 8 8 回利付国債（20年）	550,000,000	650,864,500	
第 8 9 回利付国債（20年）	410,000,000	480,647,100	
第 9 0 回利付国債（20年）	680,000,000	797,660,400	
第 9 1 回利付国債（20年）	410,000,000	485,837,700	
第 9 2 回利付国債（20年）	840,000,000	975,643,200	
第 9 3 回利付国債（20年）	370,000,000	425,281,700	
第 9 4 回利付国債（20年）	490,000,000	569,242,800	
第 9 5 回利付国債（20年）	570,000,000	675,757,800	
第 9 6 回利付国債（20年）	350,000,000	406,427,000	
第 9 7 回利付国債（20年）	640,000,000	751,353,600	
第 9 8 回利付国債（20年）	320,000,000	371,612,800	
第 9 9 回利付国債（20年）	830,000,000	963,231,600	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	550,000,000	645,755,000	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	265,000,000	317,875,450	
第 1 0 2 回利付国債（20年）	400,000,000	479,932,000	
第 1 0 3 回利付国債（20年）	270,000,000	320,371,200	
第 1 0 4 回利付国債（20年）	360,000,000	417,621,600	
第 1 0 5 回利付国債（20年）	700,000,000	811,797,000	
第 1 0 6 回利付国債（20年）	330,000,000	387,132,900	
第 1 0 7 回利付国債（20年）	370,000,000	428,637,600	
第 1 0 8 回利付国債（20年）	620,000,000	701,449,400	
第 1 0 9 回利付国債（20年）	230,000,000	259,826,400	
第 1 1 0 回利付国債（20年）	850,000,000	984,189,500	
第 1 1 1 回利付国債（20年）	300,000,000	351,111,000	
第 1 1 2 回利付国債（20年）	600,000,000	693,870,000	
第 1 1 3 回利付国債（20年）	970,000,000	1,120,272,400	
第 1 1 4 回利付国債（20年）	490,000,000	565,474,700	
第 1 1 5 回利付国債（20年）	560,000,000	654,231,200	
第 1 1 6 回利付国債（20年）	490,000,000	571,643,800	
第 1 1 7 回利付国債（20年）	770,000,000	887,825,400	
第 1 1 8 回利付国債（20年）	850,000,000	966,161,000	
第 1 1 9 回利付国債（20年）	380,000,000	420,625,800	
第 1 2 0 回利付国債（20年）	200,000,000	215,604,000	
第 1 2 1 回利付国債（20年）	940,000,000	1,051,991,600	
第 1 2 2 回利付国債（20年）	280,000,000	309,265,600	
第 1 2 3 回利付国債（20年）	700,000,000	803,579,000	
第 1 2 4 回利付国債（20年）	400,000,000	452,944,000	

第125回利付国債（20年）	280,000,000	325,015,600	
第126回利付国債（20年）	390,000,000	440,715,600	
第127回利付国債（20年）	460,000,000	512,955,200	
第128回利付国債（20年）	460,000,000	512,164,000	
第129回利付国債（20年）	560,000,000	614,639,200	
第130回利付国債（20年）	440,000,000	482,077,200	
第131回利付国債（20年）	480,000,000	518,625,600	
第132回利付国債（20年）	530,000,000	571,090,900	
第133回利付国債（20年）	660,000,000	721,254,600	
第134回利付国債（20年）	420,000,000	457,758,000	
第135回利付国債（20年）	380,000,000	408,310,000	
第136回利付国債（20年）	530,000,000	560,920,200	
第137回利付国債（20年）	290,000,000	310,708,900	
第138回利付国債（20年）	520,000,000	540,628,400	
第139回利付国債（20年）	470,000,000	496,277,700	
第140回利付国債（20年）	1,170,000,000	1,250,788,500	
第141回利付国債（20年）	260,000,000	277,113,200	
第142回利付国債（20年）	680,000,000	736,032,000	
第143回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,098,174,000	
第144回利付国債（20年）	290,000,000	298,491,200	
第145回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,250,764,600	
第146回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,310,122,000	
第147回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,523,052,300	
第148回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,198,207,400	
第149回利付国債（20年）	570,000,000	577,079,400	
第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,424,000	
国債証券 小計	196,590,000,000	207,779,061,450	
地方債証券			
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	115,839,000	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,722,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	111,730,000	
第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	107,987,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,700,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	115,067,000	
第23回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,007,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	210,200,000	
第633回東京都公募公債	129,000,000	133,097,040	
第639回東京都公募公債	50,000,000	51,913,500	
第649回東京都公募公債	102,000,000	107,297,880	
第650回東京都公募公債	140,000,000	147,807,800	
第674回東京都公募公債	100,000,000	106,206,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	106,076,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	106,086,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	102,562,000	

第720回東京都公募公債	100,000,000	103,212,000	
平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,980,000	
平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	104,316,000	
平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	115,733,200	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	107,048,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	106,624,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	116,608,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	113,245,000	
第144回神奈川県公募公債	100,000,000	104,235,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	105,374,000	
第167回神奈川県公募公債	140,000,000	149,658,600	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	212,834,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	216,402,000	
第72回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	100,842,000	
第284回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,016,000	
第290回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,512,000	
第291回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,665,000	
第307回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,560,000	
第311回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,497,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,016,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,945,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,614,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	103,913,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	105,595,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	108,050,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	102,367,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	98,790,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	205,328,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	105,540,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	106,909,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	105,398,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,229,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	106,748,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	109,539,045	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	104,849,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,821,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	116,948,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,235,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	213,410,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,268,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,183,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,287,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	117,982,000	

平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	106,675,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,826,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,600,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	106,375,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	205,629,920	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,992,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	106,965,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,804,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	211,940,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	105,888,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	105,524,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	106,903,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	106,763,000	
平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,998,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,610,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	102,832,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	102,067,000	
平成22年度第1回長野県公募公債	100,000,000	100,547,000	
第29回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,958,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,202,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,457,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,573,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	124,914,000	
第46回共同発行市場公募地方債	136,500,000	142,389,975	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,441,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	167,469,984	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,414,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,206,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,279,117	
第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,228,000	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	117,619,700	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,246,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,065,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,324,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	157,606,083	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,023,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,256,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,238,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	266,360,000	
第97回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,580,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,962,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,363,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,678,000	

第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,990,000		
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,740,000		
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,307,000		
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,115,000		
第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,693,000		
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,658,000		
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,283,000		
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	205,514,000		
平成17年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,064,000		
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,660,000		
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	102,116,000		
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	105,314,000		
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	105,629,000		
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	114,119,000		
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	114,300,000		
第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	102,686,000		
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,267,000		
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	107,231,580		
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,720,000		
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	102,391,000		
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	115,513,000		
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	114,299,000		
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	213,572,000		
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	107,271,000		
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,671,000		
平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	102,045,000		
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,764,000		
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	109,618,000		
第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,543,000		
第82回川崎市公募公債	100,000,000	106,872,000		
平成23年度第1回北九州市公募公債（5年）	100,000,000	100,542,000		
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	106,036,000		
平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	104,960,000		
平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年）	100,000,000	104,123,000		
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	117,480,000		
地方債証券 小計	15,330,190,000	16,242,522,924		
特殊債券	第42回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	100,296,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,851,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	110,307,840	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,468,000	
	第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,747,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,651,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,699,000	

第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,071,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,478,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,657,000	
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,586,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,081,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,410,000	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,095,000	
第21回道路債券	100,000,000	120,304,000	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,952,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,346,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,178,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,651,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	331,647,750	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,620,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,029,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,792,000	
第42回道路債券	100,000,000	114,953,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,390,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,118,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,636,000	
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,817,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,650,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,822,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,770,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,420,200	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	116,342,430	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,618,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	192,509,790	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,216,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,490,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,067,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	229,376,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,401,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,324,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	146,786,460	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,484,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,429,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,663,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,386,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,178,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,026,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,898,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,059,000	

第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,811,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,461,000	
第140回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,635,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,936,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,742,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,784,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,999,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,316,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,042,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,123,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,906,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,304,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,979,000	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	183,653,460	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	214,558,340	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,552,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,645,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,131,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,742,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	338,670,000	
第3回公営企業債券（20年）	10,000,000	10,420,000	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,242,000	
第6回地方公共団体金融機構債券（5年）	100,000,000	100,603,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,822,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	117,520,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	114,579,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,112,400	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,647,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,641,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,770,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,742,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	101,743,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,139,990	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,012,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,816,490	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,877,090	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,200,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	104,682,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	105,701,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	107,034,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,966,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,463,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,471,000	

第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,869,000	
第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	142,034,200	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	133,870,210	
第862回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,035,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,754,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,342,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,898,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,428,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	221,692,640	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	128,429,400	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	107,472,260	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	83,780,800	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,476,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,870,120	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,161,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,825,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,727,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,520,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,980,000	
第190回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,022,000	
第191回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,023,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,596,000	41,526,208	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,608,000	31,792,774	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,454,000	32,992,949	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	108,783,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,203,000	42,479,978	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	32,547,000	34,841,563	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,057,000	27,621,983	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,750,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	53,874,000	58,287,896	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	32,126,000	34,190,416	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	28,273,000	30,476,597	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,394,000	36,619,291	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,010,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,934,000	30,159,781	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,640,000	39,996,640	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	44,165,000	46,416,531	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	44,421,000	46,592,742	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,778,000	55,025,071	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,704,000	56,241,543	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,504,000	55,852,997	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,359,000	62,459,886	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,157,000	65,411,692	

第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,239,000	67,357,123	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,140,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,894,000	139,226,712	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,377,000	41,973,125	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,268,000	76,726,212	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,598,000	41,049,744	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,688,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,425,000	40,765,929	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,967,000	87,230,920	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,266,000	37,229,666	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,784,000	87,374,754	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,121,000	87,911,351	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,272,000	41,582,910	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,198,000	174,470,563	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,145,000	89,791,362	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,825,000	41,828,113	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,298,000	91,829,037	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,719,000	91,274,251	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,372,000	92,079,205	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,434,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,846,000	185,127,071	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,307,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,483,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,082,000	188,435,685	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,261,000	94,687,893	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,868,000	96,489,733	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,990,000	96,752,366	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,992,000	96,633,175	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,424,000	95,792,203	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,097,000	98,092,555	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	166,863,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,359,000	98,582,802	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,325,000	100,049,079	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,743,000	100,487,082	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,740,000	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,441,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,658,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	115,995,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	150,619,140	
い第726号商工債	100,000,000	100,428,000	
い第729号商工債	100,000,000	100,903,000	
い第731号商工債	100,000,000	100,994,000	
い第736号商工債	100,000,000	100,673,000	

	い第738号商工債	100,000,000	100,722,000	
	い第741号商工債	100,000,000	100,787,000	
	い第750号商工債	100,000,000	100,471,000	
	い第752号商工債	200,000,000	200,950,000	
	い第761号商工債	100,000,000	100,447,000	
	い第723号農林債	200,000,000	200,880,000	
	い第740号農林債	100,000,000	100,812,000	
	い第743号農林債	100,000,000	100,737,000	
	い第746号農林債	100,000,000	100,454,000	
	い第748号農林債	100,000,000	100,479,000	
	い第752号農林債	100,000,000	100,334,000	
	い第761号農林債	200,000,000	200,510,000	
	第258回信金中金債(5年)	100,000,000	100,769,000	
	第259回信金中金債(5年)	100,000,000	100,804,000	
	第265回信金中金債(5年)	100,000,000	100,872,000	
	第267回信金中金債(5年)	200,000,000	201,600,000	
	第274回信金中金債(5年)	100,000,000	100,463,000	
	第288回信金中金債(5年)	100,000,000	100,456,000	
	第5回S B A B銀行A B (p u b l) 円貨債券	100,000,000	100,963,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,092,000	
	第19回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,444,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,132,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,614,000	
	第43回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,546,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,530,000	
	特殊債券 小計	21,474,549,000	22,616,745,169	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	102,669,000	
	第9回J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	102,750,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	104,397,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,401,000	
	第7回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,968,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,538,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,132,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	204,672,000	
	第17回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,916,000	
	第3回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	101,092,000	
	第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,402,000	
	第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,428,000	

第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	107,140,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,798,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	106,694,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,303,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,280,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	103,291,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,324,000	
第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	100,948,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,126,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,414,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,453,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,254,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,307,000	
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,606,000	
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	102,036,000	
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,896,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,441,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,965,000	
第59回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,684,000	
第30回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,166,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	103,012,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,328,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,299,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,109,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	102,052,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,533,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,694,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,467,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	101,992,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	100,933,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,182,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,707,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,885,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,691,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,844,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,756,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,307,000	

第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,003,000	
第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	302,100,000	
第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,712,000	
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,402,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	123,043,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,563,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,846,000	
第151回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,292,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	109,165,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	108,501,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	109,383,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,296,000	
第53回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,969,000	
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,813,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	212,450,000	
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,802,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,700,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	104,465,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,855,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,610,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,274,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,443,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,761,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,776,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,116,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,798,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,114,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	109,419,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,687,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,397,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	103,166,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,689,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,934,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,193,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,137,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,745,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,300,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,936,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,622,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	118,243,000	

第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,656,600	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,365,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,609,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,991,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,538,000	
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,593,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,790,000	
第17回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,925,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,245,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,314,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,226,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	121,773,600	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,400,800	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,898,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,782,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,543,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,123,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,828,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,231,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,159,000	
第408回中部電力株式会社社債	50,000,000	52,544,500	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,855,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,293,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,132,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,348,000	
第489回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,822,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,405,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,987,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,347,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,937,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	108,152,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	107,801,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,579,000	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,837,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,964,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,057,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,071,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,446,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,236,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,993,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,777,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	33,451,790	
第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,644,000	

第17回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	207,094,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,765,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	109,656,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,721,000	
社債券 小計	14,170,000,000	14,617,771,290	
合計	247,564,739,000	261,256,100,833	

(注) 代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,065,170,363
コール・ローン	390,184,944
株式	160,896,790,204
投資信託受益証券	123,011,145
投資証券	3,453,123,459
派生商品評価勘定	98,571,855
未収入金	17,015,262
未収配当金	223,671,875
未収利息	506
差入委託証拠金	1,230,705,170

流動資産合計	174,498,244,783
資産合計	174,498,244,783
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,585,583
未払金	66,981,334
未払解約金	293,917,175
流動負債合計	399,484,092
負債合計	399,484,092
純資産の部	
元本等	
元本	100,538,126,225
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,560,634,466
元本等合計	174,098,760,691
純資産合計	174,098,760,691
負債純資産合計	174,498,244,783

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額 計算期間中の追加設定元本額 計算期間中の一部解約元本額 計算日の元本額	115,731,046,967円 19,783,415,577円 34,976,336,319円 100,538,126,225円
計算日の元本額の内訳 SBI資産設計オープン(資産成長型) SBI資産設計オープン(分配型) SMT グローバル株式インデックス・オープン 世界経済インデックスファンド マイセレクション25 マイセレクション50 マイセレクション75 外国株式インデックス・オープン DCマイセレクション25	1,216,281,189円 13,501,682円 19,599,085,288円 1,075,073,087円 10,738,842円 26,992,521円 32,133,362円 1,034,209,590円 867,025,327円

DCマイセレクション50	4,450,096,012円
DCマイセレクション75	4,685,671,716円
DC外国株式インデックス・オープン	5,770,003,905円
DCマイセレクションS25	328,503,180円
DCマイセレクションS50	1,525,899,092円
DCマイセレクションS75	1,105,258,006円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	4,042,603円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	142,149,291円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	147,096,591円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	69,590,306円
DC世界経済インデックスファンド	1,026,189,748円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	14,478,997,666円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	76,464,288円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	39,788,078円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	244,047,701円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	487,643,708円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,682,814,447円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	2,944,398,670円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,365,668,692円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,725,050,806円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	932,002,226円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,910,611,290円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	7,094,272,240円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,984,270,711円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	921,230,345円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	961,764,918円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	297,233,649円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,629,435,686円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	4,663,288,666円
外国株式ファンド・シリーズ1	983,877,522円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,104,236,262円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,631,933,354円
分散投資コア戦略ファンドA	309,328,075円
分散投資コア戦略ファンドS	396,494,892円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	11,818,859円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	46,638,989円
コア投資戦略ファンド(切替型)	337,490,037円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	133,044,065円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	14,739,045円
2. 計算日における受益権総数	100,538,126,225口
3. 1口当たり純資産額	1.7317円
(1万口当たり純資産額)	(17,317円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 時価の算定方法	<p>ん。</p> <p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載して</p> <p>おります。</p>

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>4. 金銭債権の計算日後の償還予定額</p>	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>
---	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,537,025,897	
投資信託受益証券	1,363,623	
投資証券	17,256,652	
合計	2,555,646,172	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成26年5月30日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	9,626,719,631	-	9,686,758,445	60,038,814
	合計	9,626,719,631	-	9,686,758,445	60,038,814

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

通貨関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在		
		契約額等(円)	時価	評価損益

市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建		うち1年超	(円)	(円)
	アメリカドル	90,450,668	-	90,388,400	62,268
	カナダドル	11,416,512	-	11,437,200	20,688
	オーストラリアドル	14,361,750	-	14,361,000	750
	イギリスポンド	10,463,112	-	10,458,600	4,512
	シンガポールドル	12,281,700	-	12,280,500	1,200
	ノルウェークローネ	9,904,500	-	9,900,000	4,500
	計	148,878,242	-	148,825,700	52,542
	合計	148,878,242	-	148,825,700	52,542

(注)時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	26,439	107.50	2,842,192.50	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,745	63.76	175,021.20	
	APACHE CORP	20,605	99.65	2,053,288.25	
	BAKER HUGHES	23,207	74.10	1,719,638.70	
	CABOT OIL & GAS CORP	21,935	34.89	765,312.15	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	11,374	69.03	785,147.22	
	CHENIERE ENERGY INC	11,868	72.30	858,056.40	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	27,697	29.31	811,799.07	
	CHEVRON CORP	100,148	131.39	13,158,445.72	
	CIMAREX ENERGY CO	4,370	144.58	631,814.60	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	14,569	17.52	255,248.88	
	CONCHO RESOURCES INC	5,666	147.88	837,888.08	

CONOCOPHILLIPS	64,364	85.80	5,522,431.20
CONSOL ENERGY INC	11,490	44.11	506,823.90
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,577	156.38	402,991.26
CORE LABORATORIES N.V.	2,348	163.50	383,898.00
DENBURY RESOURCES INC	18,996	17.84	338,888.64
DEVON ENERGY CORPORATION	20,190	79.40	1,603,086.00
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	3,474	48.40	168,141.60
ENERGEN CORP	3,649	88.38	322,498.62
ENSCO PLC-CL A	12,142	53.95	655,060.90
EOG RESOURCES INC	28,287	116.56	3,297,132.72
EQT CORPORATION	7,819	105.75	826,859.25
EXXON MOBIL	226,856	103.55	23,490,938.80
FMC TECHNOLOGIES INC	12,792	60.49	773,788.08
HALLIBURTON CO	44,663	70.67	3,156,334.21
HELMERICH & PAYNE	5,415	115.75	626,786.25
HESS CORP	15,366	99.03	1,521,694.98
HOLLYFRONTIER CORP	9,792	43.43	425,266.56
KINDER MORGAN INC	35,252	35.79	1,261,669.08
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	5,360	77.97	417,919.20
MARATHON OIL CORP	37,186	39.57	1,471,450.02
MARATHON PETROLEUM CORP	15,480	78.09	1,208,833.20
MURPHY OIL CORP	8,962	66.05	591,940.10
NABORS INDUSTRIES LTD	13,930	29.26	407,591.80
NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,453	84.50	1,897,278.50
NOBLE CORP PLC	12,624	32.33	408,133.92
NOBLE ENERGY INC	18,804	75.79	1,425,155.16
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	41,846	101.95	4,266,199.70
OCEANEERING INTL INC	5,388	75.34	405,931.92
ONEOK INC	10,691	67.04	716,724.64
PEABODY ENERGY CORP	14,207	16.02	227,596.14
PHILLIPS 66	30,845	79.81	2,461,739.45
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,501	226.04	1,695,526.04
QEP RESOURCES INC	9,981	33.63	335,661.03
RANGE RESOURCES CORP	8,831	84.67	747,720.77
SCHLUMBERGER	68,499	116.96	8,011,643.04
SOUTHWESTERN ENERGY CO	19,018	43.97	836,221.46
SPECTRA ENERGY CORP	35,024	42.56	1,490,621.44
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	7,710	35.91	276,866.10
TESORO CORP	7,212	59.00	425,508.00
VALERO ENERGY CORP	28,403	49.28	1,399,699.84
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	39,815	22.49	895,439.35
WHITING PETROLEUM CORP	5,932	80.98	480,373.36

WILLIAMS COS	35,775	57.86	2,069,941.50
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,901	129.28	1,409,281.28
AIRGAS INC	3,393	110.03	373,331.79
ALBEMARLE CORP	4,304	72.08	310,232.32
ALCOA	57,641	15.69	904,387.29
ASHLAND INC	3,915	109.37	428,183.55
AVERY DENNISON CORP	4,954	50.89	252,109.06
BALL CORP	7,358	63.44	466,791.52
CELANESE CORP-SERIES A	8,241	65.06	536,159.46
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,922	243.14	710,455.08
CROWN HOLDINGS INC	7,486	51.14	382,834.04
DOW CHEMICAL CO	64,074	51.20	3,280,588.80
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	48,890	65.04	3,179,805.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,354	87.27	729,053.58
ECOLAB INC	14,258	110.27	1,572,229.66
FMC CORP	7,358	70.07	515,575.06
FREEMPORT-MCMOR-B	54,643	39.04	2,133,262.72
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,194	104.38	437,769.72
INT'L PAPER CO	21,652	49.83	1,078,919.16
LYONDELLBASELL INDU-CL A	24,390	98.82	2,410,219.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,327	127.77	297,320.79
MEADWESTVACO CORP	8,828	43.71	385,871.88
MONSANTO CO	27,360	123.47	3,378,139.20
MOSAIC CO/THE	17,024	48.04	817,832.96
NEWMONT MINING CORP	27,014	25.53	689,667.42
NUCOR CORP	16,622	50.20	834,424.40
OWENS-ILLINOIS INC	8,238	34.15	281,327.70
PPG INDUSTRIES INC	7,507	207.82	1,560,104.74
PRAXAIR INC	15,527	132.41	2,055,930.07
ROCK-TENN COMPANY -CL A	3,687	100.28	369,732.36
SEALED AIR CORP	9,873	33.41	329,856.93
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,412	205.12	904,989.44
SIGMA-ALDRICH	6,492	102.31	664,196.52
VULCAN MATERIALS CO	6,674	64.92	433,276.08
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,454	85.38	209,522.52
3 M COMPANY	33,222	144.68	4,806,558.96
AGCO CORP	4,746	53.90	255,809.40
AMETEK INC	13,197	52.52	693,106.44
B/E AEROSPACE INC	5,493	93.38	512,936.34
BOEING CO	37,084	126.79	4,701,880.36
CATERPILLAR	33,481	110.14	3,687,597.34
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	5,158	68.15	351,517.70

CUMMINS INC	9,312	154.47	1,438,424.64
DANAHER CORP	32,997	78.29	2,583,335.13
DEERE&CO	18,434	89.16	1,643,575.44
DOVER CORP	9,268	89.58	830,227.44
EATON CORP	24,885	77.90	1,938,541.50
EMERSON ELECTRIC CO	36,439	67.70	2,466,920.30
FASTENAL CO	14,654	49.01	718,192.54
FLOWSERVE CORP	7,263	73.92	536,880.96
FLUOR CORP	8,820	78.02	688,136.40
GENERAL DYNAMICS CORP	15,440	115.62	1,785,172.80
GENERAL ELECTRIC CO	526,964	26.32	13,869,692.48
GRAINGER (WW) INC	3,249	250.06	812,444.94
HONEYWELL INTL INC	38,678	94.54	3,656,618.12
ILLINOIS TOOL WORKS	21,185	86.74	1,837,586.90
INGERSOLL-RAND PLC	14,843	61.57	913,883.51
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,748	53.29	359,600.92
JOY GLOBAL INC	5,239	60.66	317,797.74
KBR INC	8,182	23.51	192,358.82
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,812	119.24	573,782.88
LOCKHEED MARTIN CORP	14,335	157.93	2,263,926.55
MASCO CORP	19,054	21.64	412,328.56
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,844	119.80	1,299,111.20
PACCAR INC	18,186	65.53	1,191,728.58
PALL CORP	5,994	83.25	499,000.50
PARKER HANNIFIN CORP	7,784	124.48	968,952.32
PENTAIR PLC	10,793	70.97	765,979.21
PRECISION CASTPARTS CORP	7,647	254.58	1,946,773.26
QUANTA SERVICES INC	10,558	35.06	370,163.48
RAYTHEON COMPANY	16,911	91.86	1,553,444.46
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,082	124.57	882,204.74
ROCKWELL COLLIN	6,615	78.72	520,732.80
ROPER INDUSTRIES INC	5,151	145.26	748,234.26
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,385	48.25	404,576.25
SPX CORP	1,919	108.21	207,654.99
STANLEY BLACK&DECKER	7,456	87.12	649,566.72
TEXTRON	14,466	37.34	540,160.44
TRANSDIGM GROUP INC	2,505	166.04	415,930.20
UNITED RENTALS INC	5,070	108.35	549,334.50
UNITED TECHNOLOGIES CORP	45,305	113.84	5,157,521.20
XYLEM INC	10,093	37.54	378,891.22
ADT CORPORATION	10,721	33.55	359,689.55
CINTAS CORP	5,599	63.62	356,208.38

DUN & BRADSTREET CORP	2,027	110.75	224,490.25	
EQUIFAX INC	6,491	73.14	474,751.74	
IHS INC-CLASS A	3,569	134.75	480,922.75	
IRON MOUNTAIN INC	8,532	35.42	302,203.44	
MANPOWER GROUP	4,455	83.11	370,255.05	
NIELSEN NV	14,338	48.87	700,698.06	
REPUBLIC SERVICES INC	15,596	37.32	582,042.72	
ROBERT HALF INTL INC	7,318	48.34	353,752.12	
STERICYCLE INC	4,626	119.43	552,483.18	
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,488	104.42	364,216.96	
TYCO INTERNATIONAL LTD	23,821	45.08	1,073,850.68	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,126	60.95	495,279.70	
WASTE MANAGEMENT INC	23,275	44.24	1,029,686.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,442	41.98	396,422.37	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,554	64.00	483,456.00	
CSX CORP	53,420	31.10	1,661,362.00	
DELTA AIR LINES INC	10,604	36.96	391,923.84	
EXPEDITORS INTL WASH INC	11,078	44.88	497,180.64	
FEDEX CORP	15,790	151.32	2,389,342.80	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	24,316	28.60	695,437.60	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,793	74.14	355,353.02	
KANSAS CITY SOUTHERN	5,728	111.72	639,932.16	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,355	103.40	1,691,107.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,298	27.21	225,788.58	
UNION PACIFIC CORP	47,844	100.61	4,813,584.84	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	40.07	216,017.37	
UNITED PARCEL SERVICE B	37,142	102.98	3,824,883.16	
AUTOLIV INC	4,931	106.44	524,855.64	
BORGWARNER INC	12,370	67.38	833,490.60	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16,093	69.75	1,122,486.75	
FORD MOTOR COMPANY	190,899	17.43	3,327,369.57	
GENERAL MOTORS CO	66,816	37.97	2,537,003.52	
HARLEY-DAVIDSON	11,611	69.05	801,739.55	
JOHNSON CONTROLS INC	34,883	50.73	1,769,614.59	
TESLA MOTORS INC	4,393	223.06	979,902.58	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	6,284	91.40	574,357.60	
COACH INC	14,691	34.50	506,839.50	
DR HORTON INC	16,578	24.45	405,332.10	
FOSSIL GROUP INC	2,424	105.54	255,828.96	
GARMIN LTD	5,787	57.86	334,835.82	
HASBRO INC	5,948	54.11	321,846.28	
LEGGETT & PLATT INC	7,102	33.95	241,112.90	

LENNAR CORP-CL A	8,045	40.97	329,603.65	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,197	40.29	209,387.13	
MATTEL INC	17,952	39.56	710,181.12	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	9,899	91.38	904,570.62	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,306	134.96	446,177.76	
NEWELL RUBBERMAID	14,823	32.23	477,745.29	
NIKE B	36,883	78.69	2,902,323.27	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,368	133.06	448,146.08	
PULTE GROUP INC	17,827	20.03	357,074.81	
PVH CORP	4,194	117.11	491,159.34	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,265	162.92	531,933.80	
TOLL BROTHERS INC	8,144	36.40	296,441.60	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,246	59.91	494,017.86	
VF CORP	18,074	63.12	1,140,830.88	
WHIRLPOOL CORP	4,283	141.11	604,374.13	
BLOCK H & R INC	14,023	32.90	461,356.70	
CARNIVAL CORPORATION	19,994	36.97	739,178.18	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,609	604.17	972,109.53	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,661	45.63	303,941.43	
LAS VEGAS SANDS CORP	21,614	75.89	1,640,286.46	
MARRIOTT INTL A	12,563	65.42	821,871.46	
MCDONALD'S CORP	51,740	101.07	5,229,361.80	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	20,081	26.00	522,106.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,710	54.81	477,395.10	
STARBUCKS CORP	39,713	79.45	3,155,197.85	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	10,144	84.16	853,719.04	
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,142	77.03	550,148.26	
WYNN RESORTS LTD	4,136	206.06	852,264.16	
YUM BRANDS INC	23,434	83.23	1,950,411.82	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	17.86	189,333.86	
CBS CORP-CL B	29,691	63.93	1,898,145.63	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,898	162.15	632,060.70	
COMCAST CORP-CL A	112,402	54.73	6,151,761.46	
COMCAST CORP-SPECIAL A	24,133	54.27	1,309,697.91	
DIRECTV	25,816	86.00	2,220,176.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,963	78.71	626,767.73	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,757	77.12	366,859.84	
DISH NETWORK CORPORATION-A	11,313	65.96	746,205.48	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	21,619	19.28	416,814.32	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,072	44.09	488,164.48	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,201	42.42	1,153,866.42	
LIBERTY MEDIA CORP	4,935	137.16	676,884.60	

NEWS CORP-CLASS A	20,142	18.22	366,987.24	
OMNICOM GROUP	13,167	72.05	948,682.35	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,261	80.85	344,501.85	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	167,674	3.35	561,707.90	
THE WALT DISNEY CO	87,454	87.22	7,627,737.88	
TIME WARNER CABLE-A	14,575	149.77	2,182,897.75	
TIME WARNER INC	46,932	72.41	3,398,346.12	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	76,839	35.91	2,759,288.49	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	22,853	34.83	795,969.99	
VIACOM INC-CLASS B	20,386	86.51	1,763,592.86	
ADVANCE AUTO PARTS	3,734	133.58	498,787.72	
AMAZON.COM	20,511	329.97	6,768,014.67	
AUTONATION INC	4,068	61.23	249,083.64	
AUTOZONE INC	1,835	538.66	988,441.10	
BED BATH & BEYOND INC	10,934	59.19	647,183.46	
BEST BUY COMPANY INC	14,689	31.49	462,556.61	
CARMAX INC	12,059	53.44	644,432.96	
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,316	46.46	246,981.36	
DOLLAR GENERAL CORP	16,820	57.53	967,654.60	
DOLLAR TREE INC	11,299	55.22	623,930.78	
EXPEDIA INC	5,770	80.15	462,465.50	
FAMILY DOLLAR STORES	5,520	64.24	354,604.80	
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,678	41.79	237,283.62	
GAP	13,415	41.42	555,649.30	
GENUINE PARTS CO	8,040	88.59	712,263.60	
HOME DEPOT	73,990	80.73	5,973,212.70	
KOHL'S CORP	10,841	53.20	576,741.20	
L BRANDS INC	12,820	61.86	793,045.20	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	24,379	28.94	705,528.26	
LKQ CORP	15,504	27.03	419,073.12	
LOWES COMPANIES	54,113	47.86	2,589,848.18	
MACY'S INC	18,914	59.47	1,124,815.58	
NETFLIX INC	2,984	443.00	1,321,912.00	
NORDSTROM INC	7,529	70.14	528,084.06	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,473	155.65	851,872.45	
PETSMART INC	5,053	70.55	356,489.15	
PRICELINE GROUP INC/THE	2,739	1,236.37	3,386,417.43	
ROSS STORES INC	11,050	67.76	748,748.00	
STAPLES INC	34,140	11.06	377,588.40	
TARGET (DAYTON HUDSON)	31,504	60.05	1,891,815.20	
TIFFANY & CO	6,895	102.57	707,220.15	
TJX COMPANIES INC	37,618	54.48	2,049,428.64	

TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,518	61.38	461,454.84
TRIPADVISOR INC	6,310	103.52	653,211.20
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,108	94.42	293,457.36
URBAN OUTFITTERS INC	6,170	34.43	212,433.10
COSTCO WHOLESALE CORP	23,081	117.92	2,721,711.52
CVS CAREMARK CORPORATION	61,826	76.84	4,750,709.84
KROGER CO	25,368	49.29	1,250,388.72
SAFEWAY INC	12,078	34.48	416,449.44
SYSCO CORP	29,817	37.12	1,106,807.04
WALGREEN CO	47,066	71.95	3,386,398.70
WAL-MART STORES	84,659	77.21	6,536,521.39
WHOLE FOODS MKT INC	19,517	38.41	749,647.97
ALTRIA GROUP INC	103,825	42.80	4,443,710.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,553	46.15	1,594,620.95
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,200	94.09	583,358.00
BUNGE LIMITED	7,957	75.14	597,888.98
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,449	45.30	473,339.70
COCA-COLA CO	208,164	41.95	8,732,479.80
COCA-COLA ENTERPRISES	13,141	47.94	629,979.54
CONAGRA	22,867	30.56	698,815.52
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,907	90.12	802,698.84
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	10,510	58.55	615,360.50
GENERAL MILLS INC	32,780	53.26	1,745,862.80
HERSHEY FOODS CORPORATION	8,039	96.64	776,888.96
HORMEL FOODS CORP	8,128	48.91	397,540.48
JM SMUCKER CO	5,676	106.60	605,061.60
KELLOGG CO	14,137	66.10	934,455.70
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	6,597	123.02	811,562.94
KRAFT FOODS GROUP INC	31,257	59.72	1,866,668.04
LORILLARD INC	18,868	63.01	1,188,872.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,992	70.54	422,675.68
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,557	93.26	984,545.82
MOLSON COORS BREWING CO -B	7,769	73.54	571,332.26
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	89,175	38.01	3,389,541.75
MONSTER BEVERAGE CORP	7,320	68.98	504,933.60
PEPSICO INC	79,765	89.77	7,160,504.05
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	83,342	86.03	7,169,912.26
REYNOLDS AMERICAN INC	16,567	62.67	1,038,253.89
TYSON FOODS INC	14,542	38.81	564,375.02
AVON PRODUCTS INC	24,395	14.63	356,898.85
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,973	68.18	475,419.14
CLOROX COMPANY	7,049	92.81	654,217.69

COLGATE-PALMOLIVE CO	47,974	69.65	3,341,389.10
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,469	122.26	424,119.94
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,444	74.67	929,193.48
HERBALIFE LTD	4,464	65.72	293,374.08
KIMBERLY-CLARK CORP	20,137	113.06	2,276,689.22
PROCTER & GAMBLE CO	142,341	81.67	11,624,989.47
ABBOTT LABORATORIES	80,151	41.27	3,307,831.77
AETNA INC	19,495	81.19	1,582,799.05
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,037	72.98	878,460.26
BARD C R INC	4,050	145.81	590,530.50
BAXTER INTERNATIONAL	28,517	75.82	2,162,158.94
BECTON DICKINSON & CO	10,156	119.47	1,213,337.32
BOSTON SCIENTIFIC CORP	69,956	13.02	910,827.12
CARDINAL HEALTH	17,759	70.24	1,247,392.16
CAREFUSION CORP	11,482	44.72	513,475.04
CERNER CORP	16,116	50.95	821,110.20
CIGNA CORP	14,189	92.52	1,312,766.28
COVIDIEN PLC	23,332	90.91	2,121,112.12
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	8,948	73.22	655,172.56
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,997	47.58	380,497.26
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,625	87.89	494,381.25
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	40,735	67.81	2,762,240.35
HCA HOLDINGS INC	16,922	54.95	929,863.90
HENRY SCHEIN INC	4,467	118.97	531,438.99
HOLOGIC INC	11,506	25.51	293,518.06
HUMANA INC	8,157	127.70	1,041,648.90
INTUITIVE SURGICAL INC	2,067	386.24	798,358.08
LABORATORY CRP OF AMER	4,843	104.45	505,851.35
MCKESSON CORP	11,871	189.70	2,251,928.70
MEDTRONIC	52,535	63.60	3,341,226.00
OMNICARE INC	5,836	65.66	383,191.76
PATTERSON COMPANIES INC	4,632	39.37	182,361.84
QUEST DIAGNOSTICS	7,276	59.35	431,830.60
RESMED INC	7,971	49.36	393,448.56
ST JUDE MEDICAL INC	14,893	69.60	1,036,552.80
STRYKER CORP	17,849	83.98	1,498,959.02
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,279	82.74	4,325,564.46
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,000	93.73	468,650.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,539	85.29	472,421.31
WELLPOINT INC	14,825	110.87	1,643,647.75
ZIMMER HOLDINGS INC	8,831	103.79	916,569.49
ABBVIE INC	82,997	55.01	4,565,664.97

ACTAVIS PLC	13,091	217.28	2,844,412.48	
AGILENT TECHNOLOGIES	16,915	56.90	962,463.50	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,383	164.52	1,708,211.16	
ALLERGAN INC	15,667	165.20	2,588,188.40	
AMGEN	39,633	119.57	4,738,917.81	
BIOGEN IDEC INC	12,409	320.14	3,972,617.26	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,235	60.24	435,836.40	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	86,627	47.92	4,151,165.84	
CELGENE CORP	42,716	87.52	3,738,504.32	
ENDO INTERNATIONAL PLC	7,445	67.25	500,676.25	
GILEAD SCIENCES INC	80,751	88.68	7,160,998.68	
HOSPIRA INC	9,252	51.51	476,570.52	
ILLUMINA INC	6,801	175.23	1,191,739.23	
JOHNSON & JOHNSON	148,510	106.04	15,748,000.40	
LILLY (ELI) & CO	52,570	62.62	3,291,933.40	
MERCK & CO	154,372	58.55	9,038,480.60	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,700	252.84	429,828.00	
MYLAN INC	19,913	50.06	996,844.78	
PERRIGO CO PLC	6,847	148.06	1,013,766.82	
PFIZER	335,083	30.05	10,069,244.15	
PHARMACYCLICS INC	3,500	95.93	335,755.00	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	3,064	55.05	168,673.20	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,049	310.93	1,258,955.57	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,565	117.84	2,423,379.60	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,134	98.10	1,190,345.40	
WATERS CORP	4,274	103.53	442,487.22	
ZOETIS INC	26,046	32.46	845,453.16	
BANK OF AMERICA CORP	555,179	15.60	8,660,792.40	
BB&T CORP	36,863	39.67	1,462,355.21	
CIT GROUP INC	9,861	45.11	444,829.71	
CITIGROUP	159,402	47.38	7,552,466.76	
COMERICA INC	9,514	50.30	478,554.20	
FIFTH THIRD BANCORP	46,284	21.51	995,800.26	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,616	54.73	362,093.68	
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.79	271,055.73	
JPMORGAN CHASE & CO	198,797	56.02	11,136,607.94	
KEY CORP	47,236	14.29	675,002.44	
M & T BANK CORP	6,337	122.82	778,310.34	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	24,669	16.04	395,690.76	
OCWEN FINANCIAL CORP	6,111	36.46	222,807.06	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,290	15.07	275,721.75	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,943	88.26	2,466,249.18	

REGIONS FINL CORP	72,555	10.63	771,259.65	
SUNTRUST BANKS	27,486	39.87	1,095,866.82	
US BANCORP	94,810	43.38	4,112,857.80	
WELLS FARGO & CO	262,421	52.19	13,695,751.99	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,734	205.52	561,891.68	
AMERICAN EXPRESS	50,072	94.74	4,743,821.28	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,348	121.16	1,253,763.68	
BANK NEW YORK CO	60,461	37.63	2,275,147.43	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,805	128.75	7,571,143.75	
BLACKROCK INC	7,062	320.96	2,266,619.52	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,827	84.39	2,517,100.53	
CME GROUP INC	16,641	71.58	1,191,162.78	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,348	63.02	1,597,430.96	
EATON VANCE CORP	6,650	38.15	253,697.50	
FNF GROUP	12,973	27.55	357,406.15	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,610	57.54	1,243,439.40	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	22,339	164.67	3,678,563.13	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,988	186.91	1,119,217.08	
INVESCO LTD	22,728	38.36	871,846.08	
LEGG MASON INC	6,202	50.88	315,557.76	
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,616	25.53	424,206.48	
MCGRAW-HILL FINANCIAL	14,222	82.30	1,170,470.60	
MOODY'S CORP	9,861	88.79	875,558.19	
MORGAN STANLEY	77,269	32.01	2,473,380.69	
NASDAQ OMX GROUP	6,376	39.12	249,429.12	
NAVIENT CORP	22,604	17.72	400,542.88	
NORTHERN TRUST CORP	11,855	64.02	758,957.10	
PRICE T ROWE GROUP INC	13,376	84.01	1,123,717.76	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,405	50.00	320,250.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,648	27.09	1,642,954.32	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,978	32.76	228,599.28	
STATE STREET CORP	22,616	68.15	1,541,280.40	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	14,439	31.13	449,486.07	
VOYA FINANCIAL INC	7,335	36.57	268,240.95	
ACE LTD	17,862	104.67	1,869,615.54	
AFLAC	24,405	62.92	1,535,562.60	
ALLEGHANY CORP	856	436.56	373,695.36	
ALLSTATE CORP	23,465	58.48	1,372,233.20	
AMERICAN INT'L GROUP	72,583	55.07	3,997,145.81	
AON PLC	15,294	89.98	1,376,154.12	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,848	57.26	392,116.48	
ASSURANT INC	4,030	65.47	263,844.10	

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,941	44.76	265,919.16	
CHUBB CORPORATION	12,889	93.46	1,204,605.94	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,700	47.99	417,513.00	
EVEREST RE GROUP LTD	2,493	163.89	408,577.77	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	26,026	17.18	447,126.68	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	22,516	36.59	823,860.44	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,750	52.21	717,887.50	
LOEWS CORP	17,876	44.05	787,437.80	
MARSH & MCLENNAN COS	28,802	51.65	1,487,623.30	
METLIFE INC	49,342	56.35	2,780,421.70	
PARTNERRE LTD	2,555	111.03	283,681.65	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,321	51.51	789,184.71	
PROGRESSIVE CORP	29,765	25.19	749,780.35	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,342	89.60	2,181,043.20	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,183	107.35	234,345.05	
TORCHMARK CORP	7,314	55.11	403,074.54	
TRAVELERS COS INC/THE	18,770	94.70	1,777,519.00	
UNUM GROUP	14,141	34.97	494,510.77	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	8,583	43.00	369,069.00	
WR BERKLEY CORP	5,726	46.18	264,426.68	
XL GROUP PLC	14,744	33.39	492,302.16	
CBRE GROUP INC-A	14,402	32.51	468,209.02	
REALOGY HOLDINGS CORP	7,466	38.77	289,456.82	
WEYERHAEUSER CO	29,747	33.10	984,625.70	
ACCENTURE PLC-CL A	32,959	80.64	2,657,813.76	
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,101	22.52	565,274.52	
ADOBE SYSTEMS INC	25,036	71.57	1,791,826.52	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	9,006	60.69	546,574.14	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,637	276.57	729,315.09	
ANSYS INC	5,240	75.58	396,039.20	
AUTODESK INC	11,509	55.63	640,245.67	
AUTOMATIC DATA PROCESS	25,397	80.44	2,042,934.68	
CA INC	16,511	28.21	465,775.31	
CITRIX SYSTEMS INC	10,112	62.82	635,235.84	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	31,636	50.37	1,593,505.32	
COMPUTER SCIENCES CORP	7,907	63.30	500,513.10	
EBAY	64,630	50.93	3,291,605.90	
ELECTRONIC ARTS INC	15,498	35.52	550,488.96	
EQUINIX INC	2,777	212.59	590,362.43	
FACEBOOK INC-A	98,636	64.97	6,408,380.92	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,219	55.21	840,240.99	

FIREEYE INC	3,393	34.20	116,040.60
FISERV INC	13,143	60.96	801,197.28
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,722	129.75	482,929.50
GOOGLE INC-CL A	14,759	583.36	8,609,810.24
GOOGLE INC-CL C	15,038	576.08	8,663,091.04
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,989	188.42	9,795,767.38
INTUIT INC	13,885	81.06	1,125,518.10
LINKEDIN CORP - A	5,331	159.56	850,614.36
MASTERCARD INC-CLASS A	54,161	76.63	4,150,357.43
MICROSOFT CORP	413,638	41.67	17,236,295.46
NETSUITE INC	1,707	80.38	137,208.66
NUANCE COMMUNICATIONS INC	12,022	18.30	220,002.60
ORACLE CORP	189,918	40.26	7,646,098.68
PAYCHEX INC	17,132	41.70	714,404.40
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	34.54	238,326.00
RED HAT INC	9,757	54.93	535,952.01
SALESFORCE.COM INC	29,577	54.60	1,614,904.20
SERVICENOW INC	6,543	56.64	370,595.52
SYMANTEC CORP	35,448	22.63	802,188.24
SYNOPSIS INC	8,164	38.73	316,191.72
TERADATA CORP	8,368	40.48	338,736.64
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,333	31.97	298,376.01
TWITTER INC	6,171	38.06	234,868.26
VANTIV INC - CL A	6,378	34.20	218,127.60
VERISIGN INC	6,665	49.51	329,984.15
VISA INC-CLASS A SHARES	26,322	216.16	5,689,763.52
VMWARE INC-CLASS A	4,666	94.72	441,963.52
WESTERN UNION CO	28,486	17.39	495,371.54
WORKDAY INC-CLASS A	4,603	81.93	377,123.79
XEROX CORP	59,126	12.47	737,301.22
YAHOO	50,966	34.85	1,776,165.10
AMPHENOL CORPORATION	8,063	97.28	784,368.64
APPLE INC	328,615	95.39	31,346,584.85
ARROW ELECTRONICS INC	5,800	61.18	354,844.00
AVNET INC	7,613	44.21	336,570.73
CISCO SYSTEMS	270,708	25.44	6,886,811.52
CORNING	73,143	22.02	1,610,608.86
EMC CORP	106,777	26.69	2,849,878.13
F5 NETWORKS INC	3,880	111.75	433,590.00
FLEXTRONICS INTL LTD	33,519	10.98	368,206.21
FLIR SYSTEMS INC	6,867	34.15	234,542.38
HARRIS CORP	5,322	73.35	390,368.70

HEWLETT-PACKARD CO	99,780	33.65	3,357,597.00
JUNIPER NETWORKS INC	27,303	24.38	665,647.14
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,591	66.58	838,308.78
NETAPP INC	18,444	36.49	673,021.56
QUALCOMM	88,869	80.77	7,177,949.13
SANDISK CORP	12,200	104.25	1,271,850.00
SEAGATE TECHNOLOGY	16,751	58.48	979,598.48
TE CONNECTIVITY LTD	21,655	64.01	1,386,136.55
TRIMBLE NAVIGATION LTD	12,972	33.40	433,264.80
WESTERN DIGITAL CORP	11,791	94.30	1,111,891.30
AT&T INC	277,712	35.65	9,900,432.80
CENTURYLINK INC	30,673	36.59	1,122,325.07
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	53,046	5.79	307,136.34
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	8,500	44.57	378,845.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	6,688	103.44	691,806.72
SPRINT CORP	41,934	8.41	352,664.94
T-MOBILE US INC	12,775	33.03	421,958.25
VERIZON COMMUNICATIONS	220,837	48.90	10,798,929.30
WINDSTREAM HOLDINGS INC	33,150	10.03	332,494.50
AES CORP	37,287	15.38	573,474.06
ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,173	59.05	364,515.65
AMEREN CORPORATION	13,296	39.75	528,516.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,475	54.71	1,393,737.25
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,509	48.47	460,901.23
CALPINE CORP	17,272	23.84	411,764.48
CENTERPOINT ENERGY INC	22,554	24.90	561,594.60
CMS ENERGY CORP	14,951	30.07	449,576.57
CONSOLIDATED EDISON INC	15,264	56.40	860,889.60
DOMINION RESOURCES	30,011	69.20	2,076,761.20
DTE ENERGY COMPANY	9,457	75.42	713,246.94
DUKE ENERGY CORP	36,567	72.11	2,636,846.37
EDISON INTL	16,102	56.44	908,796.88
ENTERGY CORP	9,623	77.97	750,305.31
EXELON CORP	44,834	34.26	1,536,012.84
FIRSTENERGY CORP	21,740	33.17	721,115.80
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	3,984	69.28	276,011.52
MDU RESOURCES GROUP INC	8,823	34.06	300,511.38
NEXTERA ENERGY INC	22,506	98.83	2,224,267.98
NISOURCE INC	16,828	38.51	648,046.28
NORTHEAST UTILITIES	16,346	45.81	748,810.26
NRG ENERGY INC	16,296	35.55	579,322.80
OGE ENERGY CORP	11,103	37.46	415,918.38

	PEPCO HOLDINGS INC	14,374	27.61	396,866.14	
	PG&E CORP	23,235	46.86	1,088,792.10	
	PINNACLE WEST CAPITAL	6,136	56.51	346,745.36	
	PPL CORPORATION	32,999	34.00	1,121,966.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,374	38.61	1,018,300.14	
	SCANA CORP	6,775	53.04	359,346.00	
	SEMPRA ENERGY	11,918	102.24	1,218,496.32	
	SOUTHERN CO	46,606	44.46	2,072,102.76	
	WISCONSIN ENERGY CORP	12,243	45.22	553,628.46	
	XCEL ENERGY INC	26,973	31.64	853,425.72	
	ALTERA CORPORATION	17,227	35.34	608,802.18	
	ANALOG DEVICES	15,899	54.74	870,311.26	
	APPLIED MATERIALS	61,939	23.27	1,441,320.53	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	12,798	74.23	949,995.54	
	BROADCOM CORP-CL A	27,893	38.16	1,064,396.88	
	CREE INC	6,609	49.62	327,938.58	
	INTEL CORP	261,288	30.89	8,071,186.32	
	KLA-TENCOR CORP	8,938	74.86	669,098.68	
	LAM RESEARCH CORP	8,750	71.52	625,800.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	12,056	48.03	579,049.68	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	19,411	14.33	278,159.63	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,649	34.12	499,823.88	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,969	49.64	494,861.16	
	MICRON TECHNOLOGY	55,739	32.89	1,833,255.71	
	NVIDIA CORP	29,853	19.11	570,490.83	
	TEXAS INSTRUMENTS	56,758	49.27	2,796,466.66	
	XILINX INC	13,820	48.82	674,692.40	
	アメリカドル小計	16,271,777		948,580,299.59 (96,347,301,029)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	6,922	49.02	339,316.44	
	ARC RESOURCES LTD	16,744	30.88	517,054.72	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	7.19	144,188.26	
	BAYTEX ENERGY CORP	6,001	48.24	289,488.24	
	CAMECO CORP	21,148	21.01	444,319.48	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	56,118	49.01	2,750,343.18	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	26,085	23.60	615,606.00	
	CENOVUS ENERGY INC	39,203	33.99	1,332,509.97	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	21,074	45.67	962,449.58	
	ENBRIDGE	44,589	50.81	2,265,567.09	
	ENCANA CORP	39,999	24.05	961,975.95	
	ENERPLUS CORP	10,454	25.57	267,308.78	
	HUSKY ENERGY INC	18,542	34.12	632,653.04	

IMPERIAL OIL	15,870	57.62	914,429.40
INTER PIPELINE LTD	16,069	32.39	520,474.91
KEYERA CORP	3,777	77.99	294,568.23
MEG ENERGY CORP	8,375	38.77	324,698.75
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	14,995	21.50	322,392.50
PEMBINA PIPELINE CORP	17,218	45.45	782,558.10
PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	7.35	231,341.25
PENN WEST PETROLEUM LTD	23,074	9.94	229,355.56
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,778	38.60	261,630.80
SUNCOR ENERGY	77,084	45.63	3,517,342.92
TALISMAN ENERGY INC	55,994	10.86	608,094.84
TOURMALINE OIL CORP	8,740	56.33	492,324.20
TRANSCANADA CORP	36,433	51.93	1,891,965.69
VERMILION ENERGY INC	5,094	70.58	359,534.52
AGNICO EAGLE MINES	10,066	43.10	433,844.60
AGRIUM INC	7,581	95.44	723,530.64
BARRICK GOLD CORP	59,858	20.14	1,205,540.12
ELDORADO GOLD CORP	34,039	8.44	287,289.16
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,311	26.12	791,723.32
FRANCO-NEVADA CORP	7,259	62.57	454,195.63
GOLDCORP INC	41,679	30.19	1,258,289.01
KINROSS GOLD CORP	55,654	4.65	258,791.10
METHANEX CORP	5,075	67.06	340,329.50
NEW GOLD INC	29,614	6.94	205,521.16
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	45,238	38.98	1,763,377.24
SILVER WHEATON CORP	18,897	28.94	546,879.18
TECK RESOURCES LTD-CL B	29,114	25.99	756,672.86
YAMANA GOLD INC	37,317	8.89	331,748.13
BOMBARDIER B	71,394	3.77	269,155.38
CAE INC	12,079	14.07	169,951.53
FINNING INTERNATIONAL INC	8,970	31.25	280,312.50
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,077	56.35	455,138.95
CANADIAN NATL RAILWAY CO	43,514	70.67	3,075,134.38
CP RAILWAY LIMITED	9,312	196.12	1,826,269.44
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,784	116.93	1,377,903.12
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,652	64.00	361,728.00
TIM HORTONS INC	7,360	59.43	437,404.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	20,777	27.92	580,093.84
THOMSON REUTERS CORP	20,240	39.44	798,265.60
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,119	103.09	424,627.71
DOLLARAMA INC	3,609	91.17	329,032.53
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	21,051	29.41	619,109.91

	EMPIRE CO LTD 'A'	2,863	71.45	204,561.35	
	LOBLAW COMPANIES LTD	11,523	47.58	548,264.34	
	METRO INC	4,535	66.21	300,262.35	
	WESTON (GEORGE) LTD	2,658	78.41	208,413.78	
	SAPUTO INC	6,225	64.59	402,072.75	
	CATAMARAN CORPORATION	11,095	46.32	513,920.40	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	16,874	128.91	2,175,227.34	
	BANK MONTREAL	33,294	79.94	2,661,522.36	
	BANK NOVA SCOTIA	64,193	72.16	4,632,166.88	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	20,625	97.96	2,020,425.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	17,624	46.37	817,224.88	
	ROYAL BANK OF CANADA	76,045	78.50	5,969,532.50	
	TORONTO-DOMINION BANK	96,906	55.30	5,358,901.80	
	CI FINANCIAL CORP	8,227	35.09	288,685.43	
	IGM FINANCIAL INC	5,864	51.06	299,415.84	
	ONEX CORP	4,342	65.57	284,704.94	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,098	507.62	557,366.76	
	GREAT-WEST LIFECO INC	15,149	30.65	464,316.85	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	5,185	48.25	250,176.25	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,059	72.18	509,518.62	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	95,028	21.67	2,059,256.76	
	POWER CORP OF CANADA	18,862	30.40	573,404.80	
	POWER FINANCIAL CORP	13,355	33.83	451,799.65	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	31,406	39.88	1,252,471.28	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	28,687	46.85	1,343,985.95	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	18.45	102,102.30	
	CGI GROUP INC - CL A	12,163	38.02	462,437.26	
	OPEN TEXT CORP	6,226	51.60	321,261.60	
	BCE INC	13,980	48.28	674,954.40	
	BELL ALIANT INC	5,225	27.65	144,471.25	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,886	42.05	836,206.30	
	TELUS CORP	16,454	39.18	644,667.72	
	ATCO LTD -CLASS I	4,000	51.54	206,160.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,764	39.61	228,312.04	
	FORTIS INC	11,903	32.75	389,823.25	
	TRANSALTA CORP	15,621	12.79	199,792.59	
	カナダドル小計	2,023,027		80,993,139.31 (7,721,075,970)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	22.12	187,776.68	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	56,076	14.16	794,036.16	
	SANTOS	52,200	14.04	732,888.00	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	35,062	41.25	1,446,307.50
WORLEYPARSONS LTD	10,573	18.46	195,177.58
ALUMINA LIMITED	119,523	1.39	166,734.58
AMCOR	65,010	10.11	657,251.10
BHP BILLITON LTD	169,105	37.25	6,299,161.25
BORAL LIMITED	35,177	5.34	187,845.18
FORTESCUE METALS GROUP LTD	77,368	4.38	338,871.84
ILUKA RESOURCES LTD	21,335	8.41	179,427.35
INCITEC PIVOT LTD	83,630	2.96	247,544.80
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,623	13.74	310,840.02
NEWCREST MINING LIMITED	40,479	10.85	439,197.15
ORICA LTD	19,603	20.32	398,332.96
RIO TINTO LTD	23,193	62.14	1,441,213.02
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,336	20.35	108,587.60
ALS LTD	21,808	9.00	196,272.00
BRAMBLES LTD	79,421	9.14	725,907.94
SEEK LTD	15,860	16.31	258,676.60
ASCIANO GROUP	51,076	5.71	291,643.96
AURIZON HOLDINGS LTD	116,448	4.98	579,911.04
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.21	93,736.03
TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.23	218,127.61
TRANSURBAN GROUP	75,466	7.55	569,768.30
CROWN RESORTS LTD	21,269	15.48	329,244.12
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	45.50	148,466.50
TABCORP HOLDINGS	45,765	3.35	153,312.75
TATTS GROUP LTD	65,227	3.41	222,424.07
REA GROUP LTD	2,513	44.68	112,280.84
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.11	95,825.32
METCASH LTD	55,380	2.66	147,310.80
WESFARMERS LIMITED	59,265	42.63	2,526,466.95
WOOLWORTHS LTD	64,998	35.89	2,332,778.22
COCA-COLA AMATIL LIMITED	28,004	9.53	266,878.12
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	5.10	196,615.20
COCHLEAR LIMITED	2,709	62.08	168,174.72
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,522	45.50	296,751.00
SONIC HEALTHCARE LTD	21,648	17.52	379,272.96
CSL LIMITED	25,173	67.60	1,701,694.80
AUST AND NZ BANKING GROUP	144,644	33.18	4,799,287.92
BANK OF QUEENSLAND LTD	18,181	12.15	220,899.15
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,308	12.22	235,943.76
COMMONWEALTH BANK OF AUST	85,072	80.79	6,872,966.88
NATIONAL AUSTRALIA BANK	124,103	33.27	4,128,906.81

	WESTPAC BANKING	163,711	33.85	5,541,617.35	
	ASX LTD	10,432	35.99	375,447.68	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	14,778	59.17	874,414.26	
	AMP LTD	158,697	5.33	845,855.01	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	121,841	5.87	715,206.67	
	QBE INSURANCE GROUP	62,788	11.35	712,643.80	
	SUNCORP GROUP LIMITED	65,908	13.63	898,326.04	
	COMPUTERSHARE LIMITED	22,437	12.48	280,013.76	
	TELSTRA CORP	224,105	5.29	1,185,515.45	
	TPG TELECOM LTD	20,000	5.56	111,200.00	
	AGL ENERGY LTD	29,447	15.65	460,845.55	
	SP AUSNET	87,439	1.34	117,168.26	
	オーストラリアドル小計	3,167,708		54,518,990.97 (5,221,828,955)	
イギリス ボンド	AMEC PLC	15,243	11.85	180,629.55	
	BG GROUP	176,864	12.05	2,132,095.52	
	BP PLC	967,994	5.08	4,917,409.52	
	PETROFAC LTD	12,770	11.80	150,686.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	204,745	23.93	4,899,547.85	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	128,858	25.25	3,254,308.79	
	TULLOW OIL PLC	47,460	8.03	381,103.80	
	ANGLO AMERICAN PLC	73,284	15.05	1,102,924.20	
	ANTOFAGASTA PLC	19,350	8.17	158,186.25	
	BHP BILLITTON PLC	109,611	19.80	2,170,297.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,661	22.45	149,539.45	
	FRESNILLO PLC	9,483	9.29	88,097.07	
	GLENCORE PLC	559,165	3.46	1,935,270.06	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,991	30.75	337,973.25	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,501	50.95	229,325.95	
	REXAM PLC	36,243	5.30	192,087.90	
	RIO TINTO PLC REG	65,746	32.61	2,143,977.06	
	BAE SYSTEMS PLC	169,479	4.16	706,049.51	
	BUNZL PLC	17,199	16.30	280,343.70	
	COBHAM PLC	56,036	3.04	170,461.51	
	IMI PLC	14,701	14.58	214,340.58	
	MEGGITT PLC	40,649	5.01	203,651.49	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	56,502	2.63	148,656.76	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	97,063	10.46	1,015,278.98	
SMITHS GROUP PLC	21,067	12.50	263,337.50		
TRAVIS PERKINS PLC	12,089	16.16	195,358.24		
WEIR GROUP PLC/THE	11,331	26.85	304,237.35		
WOLSELEY LTD	13,535	32.05	433,796.75		

AGGREKO PLC	12,371	17.04	210,801.84
BABCOCK INTL GROUP PLC	26,521	11.14	295,443.94
CAPITA GROUP PLC	35,312	11.32	399,731.84
EXPERIAN PLC	51,666	9.97	515,110.02
G4S PLC	76,673	2.57	197,049.61
INTERTEK GROUP PLC	8,601	26.99	232,140.99
EASYJET PLC	7,667	12.87	98,674.29
ROYAL MAIL PLC	36,948	4.69	173,544.75
NEW GKN	87,889	3.52	310,072.39
BURBERRY GROUP PLC	23,806	14.19	337,807.14
PERSIMMON PLC	15,599	12.47	194,519.53
CARNIVAL PLC	9,460	21.54	203,768.40
COMPASS GROUP PLC	89,421	10.24	915,671.04
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,916	24.36	314,633.76
TUI TRAVEL PLC	20,444	3.74	76,562.78
WHITBREAD PLC	9,667	42.59	411,717.53
WILLIAM HILL	44,403	3.33	147,906.39
BRITISH SKY BROADCASTING	53,402	8.83	471,806.67
ITV PLC	200,934	1.77	357,059.71
PEARSON	41,654	11.09	461,942.86
REED ELSEVIER PLC	61,631	9.23	569,162.28
WPP PLC	70,175	12.31	863,854.25
ASOS PLC	3,098	29.20	90,461.60
KINGFISHER PLC	123,985	3.43	425,640.50
MARKS & SPENCER GROUP PLC	87,223	4.18	364,592.14
NEXT PLC	7,921	63.65	504,171.65
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	14,452	7.14	103,187.28
MORRISON SUPERMARKETS	118,741	1.73	205,896.89
SAINSBURY (J) PLC	63,963	3.09	197,773.59
TESCO	425,642	2.79	1,189,669.39
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,442	30.00	553,260.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	98,425	35.47	3,491,626.87
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	13.12	147,757.44
DIAGEO	131,205	18.60	2,440,413.00
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	51,011	26.60	1,356,892.60
SABMILLER PLC	50,682	32.76	1,660,342.32
TATE & LYLE	23,966	6.59	158,055.77
UNILEVER PLC	67,627	26.37	1,783,323.99
RECKITT BENCKISER PLC	34,078	50.20	1,710,715.60
SMITH & NEPHEW PLC	48,397	10.23	495,101.31
ASTRAZENECA	66,256	43.61	2,889,755.44
GLAXOSMITHKLINE	255,229	15.56	3,972,639.38

	SHIRE PLC	30,292	45.19	1,368,895.48	
	BARCLAYS	877,838	2.11	1,856,627.37	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,010,293	5.96	6,026,397.74	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,065,086	0.72	2,234,447.69	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	131,020	3.16	414,285.24	
	STANDARD CHARTERED PLC	128,571	11.99	1,542,209.14	
	3I GROUP PLC	49,028	3.90	191,650.45	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	50,274	4.55	228,998.07	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,576	11.80	124,796.80	
	ICAP PLC	32,393	3.60	116,647.19	
	INVESTEC PLC	30,876	5.28	163,179.66	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	9,458	19.56	184,998.48	
	SCHRODERS PLC	5,924	24.94	147,744.56	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,529	15.22	175,471.38	
	AVIVA PIC	156,581	4.93	773,353.55	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,421	2.75	201,907.75	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	74,378	3.21	239,125.27	
	LEGAL & GENERAL GROUP	314,312	2.24	706,259.06	
	OLD MUTUAL PLC	259,537	1.97	513,104.64	
	PRUDENTIAL	135,653	13.71	1,860,480.89	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	54,813	4.69	257,237.40	
	STANDARD LIFE PLC	125,741	3.78	475,300.98	
	SAGE GROUP PLC	58,315	3.77	220,139.12	
	BT GROUP PLC	410,398	3.80	1,561,974.78	
	INMARSAT PLC	23,362	7.48	174,747.76	
	VODAFONE GROUP PLC	1,389,158	1.91	2,653,291.78	
	CENTRICA PLC	258,458	3.08	797,342.93	
	NATIONAL GRID PLC	192,481	8.44	1,625,502.04	
	SEVERN TRENT PLC	12,322	19.18	236,335.96	
	SSE PLC	50,573	15.60	788,938.80	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	36,246	8.75	317,333.73	
	ARM HOLDINGS PLC	73,437	8.67	637,065.97	
	イギリスボンド小計	14,799,729		88,675,022.82 (15,457,829,977)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	18,824	38.74	729,241.76	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	359.50	171,481.50	
	GIVAUDAN-REG	496	1,469.00	728,624.00	
	HOLCIM LTD	11,538	78.90	910,348.20	
	SIKA AG-BR	110	3,561.00	391,710.00	
	SYNGENTA AG	4,893	331.60	1,622,518.80	
	ABB LTD	115,050	20.50	2,358,525.00	
	GEBERIT AG-REG	2,055	308.70	634,378.50	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,042	134.00	139,628.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,485	134.90	335,226.50	
	SULZER AG-REG	1,193	121.60	145,068.80	
	ADECCO	8,693	70.35	611,552.55	
	SGS SA	296	2,132.00	631,072.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,767	116.70	322,908.90	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	27,157	90.30	2,452,277.10	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,613	511.50	825,049.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,319	93.20	216,130.80	
	ARYZTA AG	4,457	85.65	381,742.05	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,182.00	156,024.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	49	4,549.00	222,901.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	55,175.00	275,875.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	168,891	68.80	11,619,700.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,677	136.10	364,339.70	
	ACTELION LTD-REG	5,535	111.70	618,259.50	
	LONZA GROUP AG-REG	2,757	95.15	262,328.55	
	NOVARTIS	120,620	80.00	9,649,600.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	36,816	265.50	9,774,648.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	79,942	25.66	2,051,311.72	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,321	36.50	449,716.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,299	79.25	102,945.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	936	249.00	233,064.00	
	UBS AG-REG	194,556	16.39	3,188,772.84	
	BALOISE HOLDING AG	2,556	110.90	283,460.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,662	212.50	353,175.00	
	SWISS RE LTD	18,733	76.95	1,441,504.35	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,933	270.60	2,146,669.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,934	73.55	215,795.70	
	SWISSCOM	1,169	515.00	602,035.00	
	スイスフラン小計	866,988		57,619,611.57 (6,571,516,699)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	112,000	105.00	11,760,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	78,000	15.38	1,199,640.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	14.24	811,680.00	
	MTR CORP	71,000	29.30	2,080,300.00	
	GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	314,800	1.80	566,640.00	
	LI & FUNG	314,800	10.10	3,179,480.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	72,000	23.75	1,710,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	26.45	1,229,925.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	122,000	62.40	7,612,800.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	43,600	27.50	1,199,000.00	

	SANDS CHINA LTD	124,000	57.25	7,099,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	11.80	1,156,400.00	
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	19.64	1,865,800.00	
	WYNN MACAU LTD	82,800	29.55	2,446,740.00	
	BANK EAST ASIA	65,960	32.00	2,110,720.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	200,500	23.15	4,641,575.00	
	HANG SENG BANK	41,400	127.30	5,270,220.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	9.11	1,166,080.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	56,600	152.00	8,603,200.00	
	AIA GROUP LTD	624,800	39.10	24,429,680.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	72,000	139.20	10,022,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	120,000	23.90	2,868,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	61,600	45.15	2,781,240.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	36.55	1,462,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	27.70	1,066,450.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	270,500	8.94	2,418,270.00	
	SINO LAND CO	139,400	12.46	1,736,924.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	85,000	106.10	9,018,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	36,500	96.75	3,531,375.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	51,800	23.50	1,217,300.00	
	WHARF HOLDINGS	77,000	56.05	4,315,850.00	
	WHEELOCK & CO LTD	53,000	32.75	1,735,750.00	
	PCCW LTD	232,000	4.72	1,095,040.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	31,000	52.50	1,627,500.00	
	CLP HOLDINGS	94,500	63.00	5,953,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	321,163	16.72	5,369,845.36	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	75,000	67.50	5,062,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	83.25	1,148,850.00	
	香港ドル小計	4,561,523		152,570,174.36 (2,000,194,985)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	74,300	10.75	798,725.00	
	NOBLE GROUP LTD	227,363	1.37	312,624.12	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	45,000	5.39	242,550.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	41,000	4.05	166,050.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	76,000	3.80	288,800.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.06	141,645.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	99,000	2.50	247,500.00	
	SINGAPORE AIRLINES	24,533	10.40	255,143.20	
	GENTING SINGAPORE PLC	313,000	1.32	414,725.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.19	389,670.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	46.80	280,800.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	26,000	2.43	63,180.00	

	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	284,000	0.55	157,620.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.20	355,200.00	
	DBS GROUP	91,000	17.01	1,547,910.00	
	OCBC BANK	135,000	9.44	1,274,400.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	67,000	23.20	1,554,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,000	6.94	291,480.00	
	CAPITALAND LTD	130,500	3.19	416,295.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.20	244,800.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	158,000	2.70	426,600.00	
	KEPPEL LAND LTD	40,000	3.43	137,200.00	
	UOL GROUP LIMITED	22,300	6.53	145,619.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	425,243	3.86	1,641,437.98	
	STARHUB LTD	38,000	4.14	157,320.00	
	シンガポールドドル小計	2,726,239		11,951,694.30 (978,604,729)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	35,168	8.86	311,588.48	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,782	3.85	183,960.70	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	15,000	8.52	127,800.00	
	XERO LTD	3,006	25.00	75,150.00	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	108,032	2.67	288,985.60	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.40	137,716.20	
	ニュージーランドドル小計	234,491		1,125,200.98 (100,896,771)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,307	132.80	1,501,569.60	
	BOLIDEN AB	13,292	107.20	1,424,902.40	
	ALFA LAVAL AB	16,494	170.90	2,818,824.60	
	ASSA ABLOY B	16,934	353.90	5,992,942.60	
	ATLAS COPCO A	34,888	197.50	6,890,380.00	
	ATLAS COPCO B	20,730	180.50	3,741,765.00	
	SANDVIK AB	55,142	90.75	5,004,136.50	
	SKANSKA B	19,200	150.80	2,895,360.00	
	SKF AB-B	21,056	172.00	3,621,632.00	
	VOLVO B	79,072	93.60	7,401,139.20	
	SECURITAS B	15,190	82.10	1,247,099.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	166.00	2,262,082.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,855	52.15	1,035,438.25	
	HENNES & MAURITZ B	49,008	284.20	13,928,073.60	
	SWEDISH MATCH AB	10,523	232.40	2,445,545.20	
	SCA SV CELLULOSA B	29,937	173.80	5,203,050.60	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	85.90	1,812,747.70	
	GETINGE AB-B SHS	10,818	176.40	1,908,295.20	
	NORDEA BANK AB	160,134	95.30	15,260,770.20	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	79,981	89.50	7,158,299.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	26,015	322.20	8,382,033.00	
	SWEDBANK AB-A	47,847	174.30	8,339,732.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	128.90	960,691.70	
	INVESTOR AB-B SHS	25,163	251.40	6,325,978.20	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	12,549	287.40	3,606,582.60	
	ERICSSON (LM) B	159,514	79.25	12,641,484.50	
	HEXAGON AB-B SHS	13,502	218.60	2,951,537.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,309	613.00	2,028,417.00	
	TELE2 AB-B SHS	15,978	81.60	1,303,804.80	
	TELIASONERA AB	123,887	50.45	6,250,099.15	
	スウェーデンクローナ小計	1,133,508		146,344,413.40 (2,189,312,424)	
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	8,029	97.35	781,623.15	
	SEADRILL LTD	20,267	235.50	4,772,878.50	
	STATOIL ASA	58,513	187.90	10,994,592.70	
	SUBSEA 7 SA	13,385	112.10	1,500,458.50	
	NORSK HYDRO	69,507	34.72	2,413,283.04	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,529	306.50	2,920,638.50	
	ORKLA	38,985	54.85	2,138,327.25	
	DNB ASA	53,015	115.30	6,112,629.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,106	114.30	1,155,115.80	
	TELENOR ASA	41,786	140.50	5,870,933.00	
	ノルウェークローネ小計	323,122		38,660,479.94 (638,284,523)	
デンマーク クローネ	NOVOZYMES A/S	12,663	272.70	3,453,200.10	
	VESTAS WIND SYSTEMS	11,858	256.00	3,035,648.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	155	12,720.00	1,971,600.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	340	13,420.00	4,562,800.00	
	DSV A/S	9,332	176.80	1,649,897.60	
	PANDORA A/S	6,120	413.00	2,527,560.00	
	CARLSBERG AS-B	5,492	582.00	3,196,344.00	
	COLOPLAST-B	5,601	476.40	2,668,316.40	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	491.60	729,534.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	103,817	247.20	25,663,562.40	
	DANSKE BANK A/S	35,811	152.00	5,443,272.00	
	TRYG A/S	1,289	551.50	710,883.50	
TDC A/S	41,126	55.00	2,261,930.00		
	デンマーククローネ小計	235,088		57,874,548.40 (1,075,887,854)	
イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	201	1,362.00	273,762.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	20,596	28.76	592,340.96	

	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,929.00	310,569.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	44,466	184.10	8,186,190.60	
	BANK HAPOALIM BM	58,582	19.85	1,162,852.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,820	13.47	953,945.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	43.69	358,258.00	
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	137.20	460,717.60	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.36	710,544.04	
	イスラエルシェケル小計	318,017		13,009,180.30 (385,462,012)	
ユーロ	ENI	134,405	19.75	2,654,498.75	
	FUGRO NV-CVA	3,638	40.76	148,284.88	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,031	12.93	272,035.98	
	NESTE OIL OYJ	6,385	13.68	87,346.80	
	OMV AG	8,150	32.17	262,226.25	
	REPSOL SA	46,543	19.14	891,065.73	
	SAIPEM	15,941	19.33	308,139.53	
	TECHNIP S.A.	5,427	78.62	426,670.74	
	TENARIS SA	25,624	17.12	438,682.88	
	TOTAL SA	112,577	51.54	5,802,218.58	
	VOPAK	3,622	33.60	121,699.20	
	AIR LIQUIDE	17,816	100.30	1,786,944.80	
	AKZO NOBEL	12,441	53.83	669,699.03	
	ARCELORMITTAL	51,938	10.87	564,566.06	
	ARKEMA	3,184	70.35	223,994.40	
	BASF SE	48,227	85.50	4,123,408.50	
	CRH	41,755	19.05	795,432.75	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	32.03	135,443.98	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,624	61.87	471,696.88	
	IMERYS SA	1,975	62.14	122,726.50	
	K+S AG	8,300	23.83	197,789.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	8,993	51.57	463,769.01	
	LAFARGE (FRANCE)	9,630	63.40	610,542.00	
	LANXESS	4,818	49.25	237,310.59	
	LINDE AG	9,734	152.90	1,488,328.60	
	SOLVAY SA	3,155	125.20	395,006.00	
	STORA ENSO OYJ R	31,297	7.05	220,643.85	
	THYSSEN KRUPP	24,299	22.10	537,129.39	
	UMICORE	5,353	34.09	182,483.77	
	UPM KYMMENE CORP	27,512	12.40	341,148.80	
	VOESTALPINE AG	5,461	33.95	185,400.95	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,407	31.55	296,837.88	
	ACS ACTIVIDADES CONS - RTS	9,407	0.65	6,133.36	

AIRBUS GROUP NV	31,000	47.00	1,457,155.00
ALSTOM RGPT	11,643	25.50	296,896.50
ANDRITZ AG	3,496	41.71	145,818.16
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,427	39.94	176,836.51
BOUYGUES ORD	9,712	28.65	278,297.36
BRENTAG AG	2,783	130.50	363,181.50
CNH INDUSTRIAL NV	50,975	7.10	361,922.50
FERROVIAL SA	22,078	15.40	340,001.20
FERROVIAL SA - RTS	22,078	0.27	6,159.76
FINMECCANICA SPA	21,154	6.92	146,385.68
GEA GROUP AG	9,866	34.27	338,107.82
HOCHTIEF AG	1,223	61.22	74,872.06
KONE OYJ-B	16,796	30.77	516,812.92
KONINKLIJKE PHILIPS	50,819	23.70	1,204,664.39
LEGRAND SA	14,256	43.93	626,266.08
MAN SE	1,667	89.50	149,196.50
METSO OYJ	6,575	27.02	177,656.50
OCI NV	5,400	28.24	152,496.00
OSRAM LICHT AG	4,722	35.97	169,850.34
PRYSMIAN SPA	10,872	16.28	176,996.16
REXEL SA	14,819	16.29	241,475.60
SAFRAN SA	13,991	45.31	634,002.16
SAINT-GOBAIN	23,607	39.63	935,663.44
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,546	67.30	1,853,845.80
SIEMENS	41,633	94.44	3,931,820.52
THALES SA	4,601	43.57	200,465.57
VALLOUREC	5,583	33.54	187,281.73
VINCI S.A.	24,959	51.95	1,296,620.05
WARTSILA OYJ	6,994	35.45	247,937.30
ZARDOYA OTIS SA	10,201	12.66	129,144.66
ZODIAC AEROSPACE	8,950	23.25	208,087.50
BUREAU VERITAS SA	11,149	20.00	222,980.00
EDENRED	11,350	22.18	251,743.00
RANDSTAD HOLDING NV	6,762	38.00	256,989.81
SOCIETE BIC SA	1,437	101.05	145,208.85
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	22,413	16.32	365,892.22
ADP	1,728	96.41	166,596.48
ATLANTIA SPA	23,265	19.75	459,483.75
BOLLORE	311	452.85	140,836.35
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,159	15.22	185,120.77
DEUTSCHE POST AG-REG	50,802	26.35	1,338,632.70
FRAPORT AG	2,319	49.88	115,683.31

GRUPE EUROTUNNEL SA - REGR	25,823	9.70	250,508.92	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	4.27	243,171.84	
TNT EXPRESS	22,191	6.56	145,772.67	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,094	92.72	1,584,955.68	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,666	70.62	188,272.92	
CONTINENTAL AG	5,738	165.50	949,639.00	
DAIMLER AG	50,556	68.16	3,445,896.96	
FIAT ORD	47,091	7.51	353,653.41	
MICHELIN	9,752	86.13	839,939.76	
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	28.49	176,011.22	
PEUGEOT SA	20,500	10.80	221,400.00	
PIRELLI & CO	11,059	11.83	130,827.97	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,935	74.80	593,538.00	
RENAULT SA	9,986	68.54	684,440.44	
VALEO SA	3,978	95.91	381,529.98	
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,459	184.50	1,376,185.50	
VOLKSWAGEN STAMM	1,589	183.60	291,740.40	
ADIDAS AG	10,925	72.12	787,911.00	
CHRISTIAN DIOR	2,802	142.15	398,304.30	
HUGO BOSS AG	1,699	107.20	182,132.80	
KERING	4,084	155.15	633,632.60	
LUXOTTICA GROUP SPA	9,028	42.16	380,620.48	
LVMH	14,744	139.50	2,056,788.00	
ACCOR	9,315	37.27	347,216.62	
SODEXO	5,007	77.56	388,342.92	
ALTICE SA	3,137	47.00	147,439.00	
AXEL SPRINGER SE	2,489	44.30	110,262.70	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,169	25.34	181,662.46	
JC DECAUX SA	3,121	28.25	88,168.25	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	103.65	137,128.95	
LAGADERE S.C.A	5,564	23.97	133,396.90	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	11,754	31.65	372,072.87	
PUBLICIS GROUPE	9,336	60.46	564,454.56	
REED ELSEVIER NV	37,555	16.45	617,779.75	
RTL GROUP	2,054	78.00	160,212.00	
SES	15,539	27.60	428,954.09	
SKY DEUTSCHLAND AG	23,240	6.33	147,178.92	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	39.26	126,433.30	
WOLTERS KLUWER	15,329	21.28	326,277.76	
INDITEX	11,740	112.10	1,316,054.00	
CARREFOUR	32,139	27.20	874,341.49	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,860	94.28	269,640.80	

COLRUYT SA	4,415	37.77	166,754.55
DELHAIZE GROUP	5,268	49.25	259,449.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	33,359	6.80	226,841.20
JERONIMO MARTINS	15,262	11.40	174,063.11
KONINKLIJKE AHOLD NV	48,280	13.65	659,022.00
METRO STAMM	8,530	31.56	269,249.45
ANHEUSER-BUSCH INBEV	42,066	84.31	3,546,584.46
DANONE (GROUPE)	29,809	54.90	1,636,514.10
HEINEKEN HOLDING NV	5,452	48.80	266,057.60
HEINEKEN NV	11,920	53.96	643,203.20
KERRY GROUP PLC-A	9,060	55.09	499,115.40
PERNOD-RICARD	11,083	86.74	961,339.42
REMY COINTREAU	1,575	64.03	100,847.25
UNILEVER NV-CVA	85,429	31.73	2,710,662.17
BEIERSDORF AG	5,460	69.67	380,398.20
HENKEL AG & CO KGAA	6,146	73.87	454,005.02
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,274	86.52	802,386.48
LOREAL	12,552	126.25	1,584,690.00
CELESIO AG	2,526	25.98	65,625.48
ESSILOR INTERNATIONAL	10,580	75.91	803,127.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	11,168	49.86	556,836.48
FRESENIUS SE&CO KGAA	6,499	111.25	723,013.75
BAYER	43,420	103.15	4,478,773.00
GRIFOLS SA	8,679	38.38	333,100.02
MERCK KGAA	7,010	64.16	449,761.60
ORION OYJ-CLASS B	5,839	26.90	157,069.10
QIAGEN N.V.	11,173	17.98	200,890.54
SANOFI	62,227	76.38	4,752,898.26
UCB (GROUPE)	5,804	63.67	369,540.68
BANCO BILBAO VIZCAYA	317,042	9.33	2,960,221.15
BANCO DE SABADELL SA	187,781	2.37	445,604.31
BANCO SANTANDER SA	639,053	7.60	4,862,554.27
BCP BANCO COMERCIAL NOM	1,846,500	0.10	199,975.95
BNP PARIBAS	56,992	48.36	2,756,418.08
CAIXABANK	93,851	4.37	410,973.52
COMMERZBANK AG	50,443	11.05	557,395.15
CREDIT AGRICOLE SA	54,249	10.21	553,882.29
ERSTE GROUP BANK AG	14,327	18.42	263,974.97
INTESA SANPAOLO	630,416	2.20	1,388,176.03
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	1.93	125,580.00
KBC GROEP NV	13,397	39.24	525,765.26

NATIXIS	46,847	4.77	223,507.03
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,746	22.78	130,922.61
SOCIETE GENERALE	38,171	37.50	1,431,412.50
UNICREDIT SPA	235,426	5.95	1,400,784.70
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	45,851	6.18	283,588.43
DEUTSCHE BANK NAMEN	73,868	26.02	1,922,414.70
DEUTSCHE BOERSE	10,126	54.04	547,209.04
EURAZEO	2,073	57.99	120,213.27
EXOR SPA	5,807	29.61	171,945.27
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,236	76.03	322,063.08
ING GROEP	205,666	10.23	2,103,963.18
MEDIOBANCA	30,462	7.08	215,670.96
WENDEL	1,898	100.65	191,033.70
AEGON	98,534	6.43	633,672.15
AGEAS	11,969	29.44	352,427.20
ALLIANZ SE-REG	24,486	128.60	3,148,899.60
ASSICURAZIONI GENERALI	63,268	15.59	986,348.12
AXA	97,941	17.69	1,732,576.29
CNP ASSURANCES	8,550	15.35	131,285.25
DELTA LLOYD NV	11,075	18.44	204,278.37
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,252	65.16	211,900.32
MAPFRE SA	65,064	2.84	184,911.88
MUENCHENER RUECKVERSICH.	9,463	161.30	1,526,381.90
SAMPO OYJ-A SHS	23,132	37.21	860,741.72
SCOR SE	7,779	24.59	191,285.61
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	47,000	2.32	109,134.00
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	39.30	88,975.20
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,145	15.84	255,736.80
IMMOFINANZ AG	55,175	2.57	141,965.27
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,889	30.29	632,727.81
ATOS	4,325	59.38	256,818.50
CAP GEMINI SA	7,599	53.41	405,862.59
DASSAULT SYSTEMES SA	3,198	95.22	304,513.56
GEMALTO	4,231	77.00	325,787.00
SAP SE	48,384	57.53	2,783,531.52
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,632	31.22	175,831.04
ALCATEL-LUCENT	148,862	2.67	397,461.54
NOKIA CORP	197,059	5.46	1,075,942.14
BELGACOM	7,760	24.09	186,977.20
DEUTSCHE TELEKOM	163,631	12.20	1,996,298.20
ELISA A	7,061	22.70	160,284.70

ILIAD SA	1,349	211.00	284,639.00	
KPN (KON.)	171,949	2.45	421,790.89	
ORANGE	96,826	11.35	1,098,975.10	
TELECOM ITALIA ORD	544,541	0.88	479,196.08	
TELECOM ITALIA RNC	319,440	0.68	219,774.72	
TELEFONICA	216,971	12.42	2,695,864.67	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,719	6.12	102,420.59	
TELEKOM AUSTRIA AG	13,843	7.14	98,880.54	
VIVENDI	63,096	17.71	1,117,745.64	
ZIGGO NV	7,516	33.92	254,980.30	
E.ON SE	105,098	14.72	1,547,568.05	
ELECTRICITE DE FRANCE	12,365	22.65	280,129.07	
ENAGAS	10,414	24.00	249,936.00	
ENEL	350,505	4.19	1,468,615.95	
ENEL GREEN POWER SPA	92,686	2.05	190,562.41	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	114,604	3.28	375,901.12	
FORTUM OYJ	23,610	19.40	458,034.00	
GAS NATURAL SDG SA	19,183	22.28	427,397.24	
GDF SUEZ	76,605	19.86	1,521,758.32	
IBERDROLA SA	273,911	5.36	1,468,162.96	
IBERDROLA SA - RTS	273,911	0.11	30,951.94	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,917	62.37	369,043.29	
RWE STAMM	25,441	31.22	794,395.22	
SNAM SPA	110,056	4.38	482,045.28	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,532	13.60	197,635.20	
TERNA SPA	83,672	3.88	325,149.39	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,757	13.06	258,026.42	
ASML HOLDING NV	18,708	68.70	1,285,239.60	
INFINEON TECHNOLOGIES	58,579	9.04	529,847.05	
STMICROELECTRONICS	32,158	6.61	212,596.53	
ユーロ小計	11,442,438		160,235,167.94 (22,208,594,276)	
合計	58,103,655		160,896,790,204 (160,896,790,204)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	257,000.00	188,895.00	
	アメリカドル小計		257,000.00	188,895.00 (19,186,065)	
	オーストラリア ドル	APA GROUP	40,986.00	286,492.14	
		LEND LEASE GROUP	28,820.00	382,441.40	

		SYDNEY AIRPORT	58,361.00	251,535.91		
		オーストラリアドル小計	128,167.00	920,469.45 (88,162,563)		
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	130,000.00	1,194,700.00		
		香港ドル小計	130,000.00	1,194,700.00 (15,662,517)		
		投資信託受益証券合計		123,011,145 (123,011,145)		
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	18,579.00	426,573.84		
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	46,690.00	580,823.60		
		AMERICAN TOWER CORPORATION	20,727.00	1,883,462.49		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	50,991.00	569,059.56		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,791.00	974,576.41		
		BOSTON PROPERTIES	7,935.00	941,329.05		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,483.00	320,400.01		
		CROWN CASTLE INTL CORP	17,176.00	1,273,943.92		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,811.00	403,756.08		
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	338,599.88		
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,864.00	1,135,971.76		
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,300.00	615,747.00		
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,356.00	412,183.92		
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,817.00	664,826.30		
		HCP INC	23,765.00	982,207.45		
		HEALTH CARE REIT INC	14,921.00	934,949.86		
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,654.00	909,429.98		
		KIMCO REALTY CORP	20,531.00	475,087.34		
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318.00	311,509.10		
		MACERICH CO/THE	7,524.00	503,656.56		
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	9,142.00	405,539.12		
		PROLOGIS INC	25,562.00	1,049,320.10		
		PUBLIC STORAGE	7,650.00	1,304,707.50		
		RAYONIER INC	7,016.00	246,261.60		
		REALTY INCOME CORP	11,520.00	516,326.40		
		REGENCY CENTERS CORP	4,458.00	246,928.62		
		SIMON PROPERTY GROUP	16,495.00	2,765,551.70		
		SL GREEN REALTY CORP	4,630.00	502,864.30		
		UDR INC	13,985.00	396,614.60		
		VENTAS INC	15,287.00	983,565.58		
		VORNADO REALTY TRUST	8,760.00	931,801.20		
				アメリカドル小計	491,591.00	24,007,574.83 (2,438,449,375)
		カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535.00	173,531.05	

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,604.00	203,407.00	
カナダドル小計		15,139.00	376,938.05 (35,933,504)	
オーストラリア ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	258,676.08	
	DEXUS PROPERTY GROUP	290,814.00	330,073.89	
	FEDERATION CENTRES	67,999.00	167,957.53	
	GOODMAN GROUP	91,399.00	465,220.91	
	GPT GROUP	90,744.00	352,994.16	
	MIRVAC GROUP	182,219.00	324,349.82	
	SCENTRE GROUP	283,059.00	908,619.39	
	STOCKLAND	116,175.00	454,244.25	
	WESTFIELD CORP	104,929.00	768,080.28	
オーストラリアドル小計		1,354,140.00	4,030,216.31 (386,014,118)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,918.00	340,440.76	
	HAMMERSON PLC	38,982.00	225,510.87	
	INTU PROPERTIES PLC	40,230.00	124,391.16	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	42,914.00	433,002.26	
	SEGRO PLC	38,146.00	132,061.45	
イギリスポンド小計		210,190.00	1,255,406.50 (218,842,461)	
香港ドル	LINK REIT	125,000.00	5,231,250.00	
香港ドル小計		125,000.00	5,231,250.00 (68,581,687)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000.00	254,190.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	181,500.00	
	CAPITAMALL TRUST	109,000.00	210,370.00	
シンガポールドル小計		330,000.00	646,060.00 (52,899,392)	
ユーロ	CORIO NV	3,438.00	125,555.76	
	FONCIERE DES REGIONS	1,649.00	130,551.33	
	GECINA SA	1,389.00	146,886.75	
	ICADE	2,102.00	160,613.82	
	KLEPIERRE	5,171.00	192,102.65	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,148.00	1,065,378.60	
ユーロ小計		18,897.00	1,821,088.91 (252,402,922)	
投資証券合計			3,453,123,459 (3,453,123,459)	
合計			3,576,134,604 (3,576,134,604)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率	
アメリカドル	株式	584銘柄	97.5%	58.6%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券	31銘柄	2.5%	1.5%
カナダドル	株式	91銘柄	99.5%	4.7%
	投資証券	2銘柄	0.5%	0.0%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	91.7%	3.2%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.5%	0.1%
	投資証券	9銘柄	6.8%	0.2%
イギリスポンド	株式	102銘柄	98.6%	9.4%
	投資証券	5銘柄	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.0%	4.0%
香港ドル	株式	38銘柄	96.0%	1.2%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.8%	0.0%
	投資証券	1銘柄	3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	25銘柄	94.9%	0.6%
	投資証券	3銘柄	5.1%	0.0%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%	1.3%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式	13銘柄	100.0%	0.7%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	229銘柄	98.9%	13.5%
	投資証券	6銘柄	1.1%	0.2%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

借入金明細表
該当事項はありません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	276,237,198
コール・ローン	3,200,789,065
国債証券	224,928,290,271
派生商品評価勘定	8,136,870
未収入金	13,105,210
未収利息	2,147,838,998
前払費用	147,018,794
差入委託証拠金	88,860,157
流動資産合計	230,810,276,563
資産合計	230,810,276,563
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,324,894
未払金	7,398,350
未払解約金	545,495,341
流動負債合計	555,218,585
負債合計	555,218,585
純資産の部	
元本等	
元本	91,264,530,297
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	138,990,527,681
元本等合計	230,255,057,978
純資産合計	230,255,057,978
負債純資産合計	230,810,276,563

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	102,334,678,750円
計算期間中の追加設定元本額	28,602,596,934円
計算期間中の一部解約元本額	39,672,745,387円
計算日の元本額	91,264,530,297円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	4,086,994,149円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	202,287,788円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,660,144,392円

財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,172,955,098円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	715,760,441円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,481,279円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,930,963,205円
世界経済インデックスファンド	680,356,647円
マイセレクション25	12,748,644円
マイセレクション50	6,208,527円
マイセレクション75	4,283,686円
DCマイセレクション25	1,074,564,364円
DCマイセレクション50	959,966,550円
DCマイセレクション75	611,563,794円
DC外国債券インデックス・オープン	1,244,940,359円
DCマイセレクションS25	398,599,487円
DCマイセレクションS50	333,460,878円
DCマイセレクションS75	146,523,516円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,333,754円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	43,763,755円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	30,906,966円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	11,094,330円
DC世界経済インデックスファンド	661,717,814円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	13,295,999,419円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	276,787,072円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	17,507,188円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	5,258,099円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	228,041,427円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	753,695,138円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,120,804,370円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	9,662,596,858円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,493,907,786円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,298,117,287円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,153,484,602円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,905,668,980円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,426,481,621円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,179,794,691円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,214,228,106円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,992,289,985円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	454,292,817円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	615,888,816円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	2,683,065,841円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	1,037,751,020円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	561,827,837円
外国債券ファンド・シリーズ1	213,605,099円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,269,183,669円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,299,433,491円
分散投資コア戦略ファンドA	361,417,170円

分散投資コア戦略ファンドS	347,218,511円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	2,586,479円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	94,351,259円
コア投資戦略ファンド(切替型)	291,781,111円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	28,192,740円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	29,131,867円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	73,944,912円
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)	12,876,575,606円
2. 計算日における受益権総数	91,264,530,297口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5229円 (25,229円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成26年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載し ております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載してありま す。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似してい ることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市 場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれ ております。当該価額の算定においては一定の前提条件 等を採用しているため、異なる前提条件等によった場 合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまで もデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上 の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の リスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	89,595,643	
合計	89,595,643	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首か
ら計算日までの期間(平成26年5月30日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの
債券関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	1,995,813,363	-	1,998,125,284	2,311,921
合計		1,995,813,363	-	1,998,125,284	2,311,921

(注)1. 時価の算定方法

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

- 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建				
	アメリカドル	1,117,377,030	-	1,118,175,600	798,570
	カナダドル	110,366,410	-	110,559,600	193,190
	イギリスポンド	233,887,450	-	235,305,000	1,417,550
	ユーロ	1,339,074,555	-	1,340,165,300	1,090,745
	計	2,800,705,445	-	2,804,205,500	3,500,055
合計		2,800,705,445	-	2,804,205,500	3,500,055

(注)時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,949,023.46	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	14,013,945.26	
		T 0.25% 10/15/15	15,900,000.00	15,910,558.55	
		T 0.375% 02/15/16	3,000,000.00	3,002,050.77	

T 0.375% 03/15/16	11,000,000.00	11,000,429.65	
T 0.375% 06/30/15	22,000,000.00	22,053,281.36	
T 0.625% 07/15/16	13,300,000.00	13,328,314.50	
T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	985,546.88	
T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,912,500.00	
T 0.625% 12/15/16	10,000,000.00	9,982,226.60	
T 0.75% 01/15/17	12,000,000.00	12,000,234.36	
T 0.75% 02/28/18	10,100,000.00	9,916,345.74	
T 0.75% 03/31/18	7,500,000.00	7,350,585.97	
T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	5,964,492.18	
T 0.75% 12/31/17	10,000,000.00	9,849,218.80	
T 0.875% 01/31/17	10,000,000.00	10,029,101.60	
T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,432,861.33	
T 0.875% 04/15/17	16,000,000.00	16,013,124.96	
T 0.875% 06/15/17	5,000,000.00	4,992,773.45	
T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,231,890.61	
T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,406,070.31	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,700,468.75	
T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,967,427.76	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,849,531.24	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,041,601.59	
T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,914,101.56	
T 1.125% 12/31/19	10,000,000.00	9,639,257.80	
T 1.25% 01/31/19	900,000.00	887,273.44	
T 1.25% 02/29/20	11,000,000.00	10,639,277.33	
T 1.25% 10/31/18	15,600,000.00	15,432,421.83	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,357,773.46	
T 1.25% 11/30/18	9,400,000.00	9,288,558.58	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,078,876.96	
T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,684,218.75	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,198,882.81	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,883,166.00	
T 1.375% 11/30/15	27,800,000.00	28,238,718.75	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	2,978,085.93	
T 1.5% 01/31/19	10,000,000.00	9,961,914.10	
T 1.5% 02/28/19	10,000,000.00	9,953,710.90	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,377,742.20	
T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,385,076.18	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,812,347.67	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,260,761.73	
T 1.625% 11/15/22	8,500,000.00	8,008,759.75	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,647,035.14	

T 1.75% 05/15/23	10,200,000.00	9,628,640.67	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,254,296.95	
T 1.75% 10/31/20	1,500,000.00	1,474,980.46	
T 1.875% 06/30/15	8,600,000.00	8,745,292.95	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,182,328.11	
T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,106,294.91	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,075,878.91	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,562,890.62	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,570,978.47	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,454,394.52	
T 2% 02/15/23	12,500,000.00	12,096,923.87	
T 2% 05/31/21	1,800,000.00	1,781,859.38	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,215,945.33	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,363,671.87	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,482,597.67	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,006,093.75	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,079,269.51	
T 2.25% 03/31/21	6,600,000.00	6,653,109.40	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,525,224.60	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	5,942,153.32	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,073,398.44	
T 2.375% 03/31/16	5,200,000.00	5,379,257.83	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,156,640.64	
T 2.375% 06/30/18	9,050,000.00	9,401,571.32	
T 2.5% 05/15/24	5,200,000.00	5,174,406.27	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,037,441.41	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,303,203.12	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,245,312.50	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,708,720.71	
T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,289,531.28	
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	631,406.25	
T 2.75% 02/15/24	8,100,000.00	8,255,513.67	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,004,472.64	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,419,375.04	
T 2.75% 11/15/23	5,200,000.00	5,311,210.94	
T 2.75% 11/15/42	8,400,000.00	7,447,289.05	
T 2.75% 11/30/16	6,250,000.00	6,559,448.25	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,127,449.20	
T 2.875% 05/15/43	9,100,000.00	8,260,027.32	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,050,517.59	
T 3% 05/15/42	5,500,000.00	5,151,953.12	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,151,822.23	

T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,711,572.27	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	956,093.75	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,906,123.05	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,346,582.05	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,643,257.83	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,872,099.58	
T 3.125% 11/15/41	2,800,000.00	2,695,382.81	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,693,730.46	
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,639,941.40	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,717,792.96	
T 3.375% 05/15/44	9,900,000.00	9,902,320.36	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,154,775.41	
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,112,265.64	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,648,403.30	
T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,682,363.29	
T 3.625% 02/15/44	2,200,000.00	2,307,078.13	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,955,814.44	
T 3.75% 08/15/41	6,100,000.00	6,583,591.77	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,480,468.75	
T 3.75% 11/15/43	900,000.00	965,601.56	
T 3.875% 08/15/40	4,200,000.00	4,632,714.82	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,645,404.30	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	700,652.34	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,060,791.00	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,076,261.73	
T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	5,854,394.55	
T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,662,335.93	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	5,842,867.21	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,389,648.44	
T 4.375% 11/15/39	4,000,000.00	4,763,515.64	
T 4.5% 02/15/36	2,500,000.00	3,021,289.07	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	10,799,714.85	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,209,433.59	
T 4.5% 08/15/39	2,900,000.00	3,515,287.11	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,277,765.62	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,498,242.20	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,422,159.18	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,449,449.22	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	645,751.95	
T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,214,468.76	
T 5.25% 02/15/29	1,400,000.00	1,787,460.93	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,658,769.52	

	T 5.375% 02/15/31	2,400,000.00	3,138,562.51	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,563,679.69	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,263,789.07	
	T 6.125% 11/15/27	1,650,000.00	2,257,148.43	
	T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,556,951.17	
	T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,549,234.37	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,147,842.76	
	T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,480,292.98	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,373,326.17	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,764,001.96	
アメリカドル小計		814,550,000.00	835,052,826.52 (84,816,315,589)	
カナダドル	CAN 1% 05/01/16	3,300,000.00	3,293,878.50	
	CAN 1% 11/01/15	1,000,000.00	999,430.00	
	CAN 1.25% 02/01/16	3,000,000.00	3,007,920.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	1,800,000.00	1,791,819.00	
	CAN 1.25% 09/01/18	1,400,000.00	1,386,658.00	
	CAN 1.5% 02/01/17	2,300,000.00	2,318,239.00	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,900,000.00	1,803,033.50	
	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,659,702.00	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,000,000.00	1,008,420.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	350,000.00	351,587.25	
	CAN 2% 06/01/16	1,800,000.00	1,829,745.00	
	CAN 2.5% 06/01/24	2,100,000.00	2,147,323.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,800,000.00	1,897,326.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	2,200,000.00	2,275,537.00	
	CAN 3% 12/01/15	1,700,000.00	1,745,755.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,600,000.00	1,744,744.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,550,000.00	2,804,464.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,300,000.00	2,642,596.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	2,974,792.50	
	CAN 4% 06/01/16	2,050,000.00	2,160,382.25	
	CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,511,685.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,200,000.00	2,696,045.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,936,410.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,950,000.00	2,689,488.75	
CAN 5.75% 06/01/29	1,600,000.00	2,234,128.00		
CAN 5.75% 06/01/33	1,800,000.00	2,616,120.00		
CAN 8.0% 06/01/27	550,000.00	889,743.25		
カナダドル小計		49,750,000.00	54,416,974.00 (5,187,570,131)	

オーストラリア ドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,700,000.00	1,593,673.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,850,000.00	1,794,176.25	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,150,000.00	1,069,994.50	
	ACGB 3.25% 10/21/18	550,000.00	558,291.25	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,100,000.00	1,163,552.50	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,850,000.00	1,935,035.25	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,750,000.00	2,956,401.25	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,050,000.00	1,116,517.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,550,000.00	1,711,913.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,800,000.00	2,916,018.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,050,000.00	2,107,594.75	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,550,000.00	3,909,561.75	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,350,000.00	3,657,714.25	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,300,000.00	3,816,714.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,000,000.00	3,466,740.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,400,000.00	2,803,008.00	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,472,144.00	
オーストラリアドル小計		37,200,000.00	40,049,049.75 (3,835,897,985)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	2,952,435.00	
	UKT 1.25% 07/22/18	4,850,000.00	4,745,385.50	
	UKT 1.75% 01/22/17	2,600,000.00	2,632,318.00	
	UKT 1.75% 07/22/19	1,400,000.00	1,380,232.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,350,000.00	3,157,207.50	
	UKT 2% 01/22/16	3,100,000.00	3,153,366.50	
	UKT 2.25% 09/07/23	3,950,000.00	3,820,242.50	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,700,000.00	1,695,886.00	
	UKT 3.25% 01/22/44	3,700,000.00	3,595,105.00	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,000,000.00	1,016,940.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,400,000.00	1,451,142.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,200,000.00	2,375,571.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,400,000.00	3,685,617.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,885,293.50	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,900,000.00	3,167,742.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,600,000.00	1,849,096.00	
	UKT 4% 03/07/22	2,100,000.00	2,332,701.00	
	UKT 4% 09/07/16	3,350,000.00	3,560,949.50	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,900,000.00	3,317,556.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,900,000.00	3,311,684.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,900,000.00	2,188,230.00	
UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	2,049,516.00		
UKT 4.25% 12/07/40	2,200,000.00	2,540,802.00		

	UKT 4.25% 12/07/46	2,150,000.00	2,516,886.75	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,900,000.00	2,247,149.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,100,000.00	2,530,143.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	1,950,000.00	2,174,367.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,750,000.00	3,244,670.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,650,000.00	3,198,179.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	3,200,000.00	3,648,832.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,500,000.00	2,616,900.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,300,000.00	2,772,891.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	2,350,000.00	2,907,290.75	
	UKT 5% 03/07/18	3,300,000.00	3,691,990.50	
	UKT 5% 03/07/25	2,400,000.00	2,892,024.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,500,000.00	2,020,875.00	
	UKT 8% 06/07/21	2,000,000.00	2,727,040.00	
	UKT 8% 12/07/15	1,600,000.00	1,764,312.00	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,832,797.50	
	イギリスポンド小計	96,100,000.00	105,651,367.00 (18,417,146,295)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	350,000.00	392,444.50	
	SWISS 2.5% 03/12/16	350,000.00	364,694.75	
	SWISS 3% 01/08/18	3,100,000.00	3,422,896.00	
	SWISS 4% 02/11/23	1,850,000.00	2,401,096.50	
	SWISS 4% 04/08/28	400,000.00	554,582.00	
	スイスフラン小計	6,050,000.00	7,135,713.75 (813,828,153)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	400,000.00	396,450.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	650,000.00	658,427.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	800,000.00	816,796.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	550,000.00	579,716.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	800,000.00	853,380.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	450,000.00	421,458.75	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,050,000.00	1,076,024.25	
	SIGB 2.875% 09/01/30	400,000.00	395,912.00	
	SIGB 3% 09/01/24	550,000.00	575,907.75	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,050,000.00	1,126,797.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	700,000.00	763,619.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	350,000.00	369,465.25	
	SIGB 3.5% 03/01/27	800,000.00	863,188.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	858,240.00	
	SIGB 4% 09/01/18	650,000.00	734,509.75	
	シンガポールドル小計	10,000,000.00	10,489,892.00 (858,912,356)	

マレーシア リングット	MGS 3.172% 07/15/16	2,450,000.00	2,441,878.25	
	MGS 3.197% 10/15/15	500,000.00	499,525.00	
	MGS 3.26% 03/01/18	800,000.00	791,252.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,900,000.00	2,878,685.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,250,000.00	1,201,062.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,450,000.00	1,396,016.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,550,000.00	1,526,548.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,900,000.00	1,761,803.50	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,400,000.00	2,400,384.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	100,000.00	94,344.50	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,000,000.00	2,015,520.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,504,957.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	350,000.00	337,995.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	350,000.00	353,920.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	1,989,125.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,300,000.00	2,338,720.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	600,000.00	608,667.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,706,352.25	
	MGS 4.262% 09/15/16	4,300,000.00	4,377,722.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	4,100,000.00	4,226,813.00	
MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,127,032.50		
MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,322,685.00		
MGS 5.248% 09/15/28	1,000,000.00	1,098,040.00		
マレーシアリングット小計		38,900,000.00	38,999,050.25 (1,249,919,560)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	10,950,000.00	10,824,403.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	5,250,000.00	5,618,497.50	
	SGB 3% 07/12/16	8,200,000.00	8,641,652.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,850,000.00	7,044,657.75	
	SGB 3.5% 06/01/22	8,400,000.00	9,701,748.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	8,600,000.00	9,457,162.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	13,300,000.00	15,388,233.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	9,300,000.00	9,734,868.00	
	SGB 5% 12/01/20	8,150,000.00	10,072,381.25	
スウェーデンクローナ小計		78,000,000.00	86,483,603.00 (1,293,794,700)	
ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	7,100,000.00	6,949,977.00	
	NGB 3% 03/14/24	3,650,000.00	3,830,547.25	
	NGB 3.75% 05/25/21	9,000,000.00	9,996,255.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	9,250,000.00	9,976,957.50	
	NGB 4.5% 05/22/19	8,350,000.00	9,427,859.75	

ノルウェークローネ小計		37,350,000.00	40,181,596.50 (663,398,158)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,050,000.00	9,236,430.00	
	DGB 2.5% 11/15/16	6,450,000.00	6,815,102.25	
	DGB 3% 11/15/21	13,650,000.00	15,721,455.75	
	DGB 4% 11/15/15	12,600,000.00	13,270,194.00	
	DGB 4% 11/15/17	7,350,000.00	8,287,896.75	
	DGB 4% 11/15/19	13,600,000.00	16,118,720.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,050,000.00	24,553,449.25	
	DGB 7% 11/10/24	3,500,000.00	5,439,787.50	
デンマーククローネ小計		83,250,000.00	99,443,035.50 (1,848,646,029)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,500,000.00	11,896,090.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	32,200,000.00	32,565,148.00	
	MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,572,156.00	
	MBONO 6.25% 06/16/16	40,000,000.00	42,235,800.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	18,400,000.00	19,733,172.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	24,400,000.00	26,501,450.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	16,000,000.00	18,151,200.00	
	MBONO 8% 06/11/20	18,700,000.00	21,542,493.50	
	MBONO 8% 12/07/23	27,100,000.00	31,683,829.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	44,300,000.00	54,032,710.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	28,400,000.00	34,696,138.00	
メキシコペソ小計		279,800,000.00	315,610,187.00 (2,474,383,866)	
ポーランドズロチ	POLGB 2.5% 07/25/18	3,100,000.00	3,064,753.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	1,400,000.00	1,420,475.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	3,100,000.00	3,210,701.00	
	POLGB 4% 10/25/23	3,700,000.00	3,880,911.50	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,222,535.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	5,000,000.00	5,252,300.00	
	POLGB 5% 04/25/16	2,450,000.00	2,559,282.25	
	POLGB 5.25% 10/25/17	3,500,000.00	3,783,622.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,550,000.00	2,863,497.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,920,554.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,200,000.00	1,482,546.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,300,000.00	3,870,306.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,250,000.00	2,615,377.50	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,100,000.00	8,493,255.00	
ポーランドズロチ小計		44,350,000.00	47,640,115.75 (1,601,660,691)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	19,600,000.00	22,934,548.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	13,900,000.00	10,385,315.50	

	SAGB 6.5% 02/28/41	12,400,000.00	9,313,454.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	13,400,000.00	12,594,727.00	
	SAGB 7% 02/28/31	15,300,000.00	12,966,750.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	12,200,000.00	11,929,099.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	7,700,000.00	7,529,060.00	
	SAGB 8% 12/21/18	12,000,000.00	12,209,100.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	11,800,000.00	12,129,279.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	1,000,000.00	955,205.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	5,600,000.00	5,432,392.00	
	南アフリカランド小計	124,900,000.00	118,378,929.50 (1,126,967,408)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,100,000.00	1,140,942.00	
	BGB 2.25% 06/22/23	700,000.00	747,852.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,750,000.00	1,902,267.50	
	BGB 3% 06/22/34	700,000.00	752,073.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,450,000.00	1,630,931.00	
	BGB 3.25% 09/28/16	2,950,000.00	3,157,326.00	
	BGB 3.5% 06/28/17	350,000.00	384,392.75	
	BGB 3.75% 06/22/45	650,000.00	780,760.50	
	BGB 3.75% 09/28/15	800,000.00	835,864.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,951,937.50	
	BGB 4% 03/28/18	3,050,000.00	3,470,808.50	
	BGB 4% 03/28/22	2,950,000.00	3,576,668.50	
	BGB 4% 03/28/32	1,150,000.00	1,414,500.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,500,000.00	2,761,137.50	
	BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,981,452.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,406,045.25	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,470,396.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	3,100,000.00	3,826,113.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,210,081.50	
	BGB 5% 03/28/35	2,750,000.00	3,836,758.75	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,450,000.00	3,442,874.75	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,221,926.50	
	BTNS 1% 07/25/17	3,000,000.00	3,075,285.00	
	BTNS 1.75% 02/25/17	2,500,000.00	2,608,050.00	
	BTNS 2% 07/12/15	1,700,000.00	1,733,252.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	8,000,000.00	8,286,120.00	
	BTNS 2.5% 07/25/16	4,000,000.00	4,196,640.00	
	BTPS 1.15% 05/15/17	2,000,000.00	2,018,700.00	
	BTPS 1.5% 12/15/16	1,200,000.00	1,222,116.00	
	BTPS 2.75% 12/01/15	2,300,000.00	2,371,587.50	
	BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,892,092.00	

BTPS 3.5% 11/01/17	3,000,000.00	3,245,415.00	
BTPS 3.5% 12/01/18	3,500,000.00	3,832,692.50	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,700,000.00	4,106,963.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	3,700,000.00	3,909,087.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	3,900,000.00	4,035,466.50	
BTPS 3.75% 08/01/16	6,300,000.00	6,704,554.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,431,700.00	
BTPS 4% 02/01/17	5,500,000.00	5,952,842.50	
BTPS 4% 02/01/37	3,600,000.00	3,768,606.00	
BTPS 4% 09/01/20	4,000,000.00	4,512,500.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,294,874.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	5,350,000.00	6,101,808.75	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	3,014,838.75	
BTPS 4.5% 02/01/18	2,800,000.00	3,136,392.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	3,750,000.00	4,323,393.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,350,000.00	4,973,790.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,950,000.00	4,532,289.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	3,080,389.50	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,150,000.00	3,612,530.25	
BTPS 4.5% 08/01/18	7,500,000.00	8,488,462.50	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,800,000.00	4,221,344.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,700,000.00	4,330,979.50	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,695,900.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	1,400,000.00	1,613,780.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	1,915,296.50	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,400,000.00	2,612,100.00	
BTPS 5% 03/01/22	2,350,000.00	2,792,187.75	
BTPS 5% 03/01/25	3,750,000.00	4,448,343.75	
BTPS 5% 08/01/34	3,300,000.00	3,900,748.50	
BTPS 5% 09/01/40	3,100,000.00	3,621,466.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	3,288,852.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,449,290.75	
BTPS 5.25% 11/01/29	5,000,000.00	6,042,375.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,570,064.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,100,000.00	5,015,202.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,300,000.00	2,954,844.50	
BTPS 6% 05/01/31	4,000,000.00	5,237,860.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	5,100,000.00	6,874,570.50	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,687,550.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,220,968.00	
DBR 1.5% 02/15/23	3,600,000.00	3,745,728.00	
DBR 1.5% 05/15/23	3,950,000.00	4,098,065.75	

DBR 1.5% 05/15/24	2,450,000.00	2,511,764.50	
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	3,032,544.50	
DBR 1.75% 02/15/24	1,950,000.00	2,050,503.00	
DBR 1.75% 07/04/22	3,100,000.00	3,309,560.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,830,828.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,761,937.50	
DBR 2.25% 09/04/21	2,800,000.00	3,101,812.00	
DBR 2.5% 01/04/21	2,700,000.00	3,030,250.50	
DBR 2.5% 07/04/44	2,200,000.00	2,356,508.00	
DBR 2.5% 08/15/46	900,000.00	962,941.50	
DBR 3% 07/04/20	2,800,000.00	3,216,108.00	
DBR 3.25% 01/04/20	2,600,000.00	3,003,078.00	
DBR 3.25% 07/04/15	6,250,000.00	6,446,937.50	
DBR 3.25% 07/04/21	2,300,000.00	2,705,651.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,100,000.00	2,580,774.00	
DBR 3.5% 01/04/16	5,800,000.00	6,099,367.00	
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	4,053,035.00	
DBR 3.75% 01/04/17	3,600,000.00	3,932,730.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,150,000.00	3,646,172.25	
DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	3,882,492.00	
DBR 4.0% 01/04/18	3,300,000.00	3,748,717.50	
DBR 4.0% 01/04/37	3,500,000.00	4,662,472.50	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,599,472.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,150,000.00	4,825,350.25	
DBR 4.25% 07/04/39	2,000,000.00	2,810,720.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,756,650.00	
DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	3,741,296.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,250,000.00	3,410,752.50	
DBR 5.5% 01/04/31	2,450,000.00	3,686,956.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,800,000.00	2,661,462.00	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	624,666.00	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,341,336.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,991,887.50	
DBR 6.5% 07/04/27	1,450,000.00	2,288,984.50	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,300,000.00	2,306,578.00	
FRTR 1% 05/25/18	2,500,000.00	2,567,737.50	
FRTR 1% 05/25/19	2,300,000.00	2,358,155.50	
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,568,137.50	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,050,000.00	4,188,773.25	
FRTR 1.75% 11/25/24	2,200,000.00	2,218,931.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	2,800,000.00	2,978,038.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,200,000.00	4,536,357.00	

FRTR 2.5% 05/25/30	500,000.00	514,062.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,200,000.00	5,755,698.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	3,150,000.00	3,414,300.75	
FRTR 3% 04/25/22	3,800,000.00	4,333,273.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,189,575.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	4,400,000.00	4,650,998.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,450,000.00	1,611,965.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,800,000.00	6,719,271.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	7,150,000.00	8,307,906.75	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,500,000.00	5,277,015.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,712,806.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,800,000.00	6,896,722.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	2,300,000.00	2,685,480.00	
FRTR 4% 04/25/18	3,800,000.00	4,336,997.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,950,000.00	2,529,842.25	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,152,342.50	
FRTR 4% 10/25/38	3,350,000.00	4,214,032.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000.00	7,792,851.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,000,000.00	4,533,060.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,000,000.00	3,499,485.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,100,000.00	6,358,858.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,450,000.00	4,700,573.25	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,900,000.00	3,983,135.50	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,562,125.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,700,000.00	5,269,151.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,200,000.00	6,330,723.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,440,904.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,599,785.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,587,118.40	
IRISH 3.4% 03/18/24	650,000.00	710,823.75	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,000,000.00	1,144,100.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,287,539.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,250,000.00	3,852,403.75	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	928,636.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	1,700,000.00	1,833,356.50	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,850,000.00	2,352,302.75	
IRISH 5.5% 10/18/17	950,000.00	1,106,811.75	
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	940,897.50	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,900,000.00	1,969,226.50	
NETHER 1.25% 01/15/19	1,600,000.00	1,662,128.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,650,000.00	1,715,290.50	
NETHER 2% 07/15/24	900,000.00	946,354.50	

NETHER 2.25% 07/15/22	2,400,000.00	2,614,020.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	3,250,000.00	3,445,796.25	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,400,000.00	1,486,604.00	
NETHER 2.75% 01/15/47	550,000.00	608,536.50	
NETHER 3.25% 07/15/15	2,300,000.00	2,374,520.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,300,000.00	2,672,324.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,250,000.00	2,626,920.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,700,000.00	2,054,356.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,150,000.00	2,830,991.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,000,000.00	2,649,780.00	
NETHER 4% 07/15/16	4,450,000.00	4,800,037.00	
NETHER 4% 07/15/19	1,900,000.00	2,233,421.50	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,550,000.00	2,927,234.25	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,300,000.00	2,599,667.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,150,000.00	3,106,857.50	
NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	833,140.00	
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,107,308.00	
OBL 0.5% 02/23/18	4,000,000.00	4,053,460.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,429,724.00	
OBL 0.5% 04/12/19	1,600,000.00	1,613,496.00	
OBL 0.5% 10/13/17	450,000.00	456,185.25	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,056,640.00	
OBL 1% 10/12/18	2,250,000.00	2,323,372.50	
OBL 1.25% 10/14/16	1,050,000.00	1,079,111.25	
OBL 1.75% 10/09/15	3,800,000.00	3,882,004.00	
OBL 2.75% 04/08/16	4,100,000.00	4,294,319.50	
RAGB 1.65% 10/21/24	750,000.00	760,473.75	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,050,000.00	1,088,913.00	
RAGB 1.95% 06/18/19	100,000.00	107,362.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	518,485.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	822,129.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,134,451.50	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,250,000.00	1,472,925.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	1,400,000.00	1,448,790.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,200,000.00	2,598,068.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,314,373.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	700,082.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,600,000.00	3,096,756.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,050,000.00	2,225,039.25	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,700,000.00	2,268,947.50	
RAGB 4.3% 09/15/17	750,000.00	848,032.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,050,000.00	2,427,087.25	

RAGB 4.65% 01/15/18	2,900,000.00	3,351,283.50	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,050,000.00	1,404,128.25	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,000,000.00	1,519,325.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	664,316.25	
RFGB 1.625% 09/15/22	750,000.00	778,923.75	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	618,006.00	
RFGB 2% 04/15/24	850,000.00	896,966.75	
RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	486,184.50	
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	610,516.50	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	809,168.50	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,150,000.00	1,351,227.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,900,000.00	2,122,746.50	
RFGB 4% 07/04/25	850,000.00	1,059,814.00	
RFGB 4.25% 07/04/15	900,000.00	937,116.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,073,412.00	
SPGB 2.1% 04/30/17	3,000,000.00	3,109,305.00	
SPGB 2.75% 04/30/19	1,900,000.00	2,021,419.50	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,400,000.00	1,386,238.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	5,600,000.00	5,838,784.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,100,000.00	1,155,044.00	
SPGB 3.3% 07/30/16	1,800,000.00	1,900,980.00	
SPGB 3.75% 10/31/15	1,400,000.00	1,461,593.00	
SPGB 3.75% 10/31/18	550,000.00	607,882.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	3,700,000.00	3,993,539.50	
SPGB 3.8% 04/30/24	3,150,000.00	3,430,050.75	
SPGB 4% 04/30/20	2,350,000.00	2,653,009.00	
SPGB 4% 07/30/15	2,800,000.00	2,907,772.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	5,900,000.00	6,600,064.50	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,400,000.00	2,549,916.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	2,550,000.00	2,761,344.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,371,422.25	
SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,356,221.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,100,000.00	3,578,795.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,400,000.00	2,770,176.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,550,000.00	1,735,395.50	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,200,000.00	2,582,580.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	2,950,000.00	3,488,242.25	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,000,000.00	2,319,940.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	1,450,000.00	1,726,819.50	
SPGB 5.15% 10/31/44	650,000.00	770,685.50	
SPGB 5.4% 01/31/23	5,050,000.00	6,174,710.75	
SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	4,162,416.00	

	SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,647,008.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,200,000.00	2,833,622.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,500,000.00	3,133,075.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,150,000.00	2,732,134.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,250,000.00	2,902,263.75	
	ユーロ小計	632,230,000.00	726,838,739.90 (100,739,849,350)	
	国債証券合計		224,928,290,271 (224,928,290,271)	
	合計		224,928,290,271 (224,928,290,271)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 140銘柄	100.0%	37.7%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.3%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.7%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	8.2%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 23銘柄	100.0%	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.8%
メキシコペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	1.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
ユーロ	国債証券 246銘柄	100.0%	44.8%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	845,459,788
コール・ローン	116,030,072
株式	26,861,512,565
投資信託受益証券	106,034,746
投資証券	44,719,516
派生商品評価勘定	13,081,160
未収入金	1,703,488
未収配当金	138,642,654
未収利息	150
差入委託証拠金	197,569,115
流動資産合計	28,324,753,254
資産合計	28,324,753,254
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	192,339
未払金	436,438,572
未払株式払込金	7,583,487
未払解約金	4,719,159
流動負債合計	448,933,557
負債合計	448,933,557
純資産の部	
元本等	
元本	11,830,629,493
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,045,190,204
元本等合計	27,875,819,697

純資産合計	27,875,819,697
負債純資産合計	28,324,753,254

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	9,346,341,776円
計算期間中の追加設定元本額	4,151,684,803円
計算期間中の一部解約元本額	1,667,397,086円
計算日の元本額	11,830,629,493円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	4,928,632,340円
世界経済インデックスファンド	468,387,009円
DC新興国株式インデックス・オープン	1,994,698,026円
DC世界経済インデックスファンド	467,525,251円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	2,343,980,879円
コア投資戦略ファンド(安定型)	355,749,967円
コア投資戦略ファンド(成長型)	840,412,458円
分散投資コア戦略ファンドA	99,156,054円
分散投資コア戦略ファンドS	126,076,931円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	5,580,012円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	22,052,233円
コア投資戦略ファンド(切替型)	104,051,857円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	62,743,185円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	6,954,796円
新興国株式インデックス・オープン	4,628,495円
2. 計算日における受益権総数	11,830,629,493口
3. 1口当たり純資産額	2.3562円
(1万口当たり純資産額)	(23,562円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,391,008,874	
投資信託受益証券	3,347,504	
投資証券	4,292,386	
合計	1,398,648,764	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年11月12日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	883,855,030	-	896,647,771	12,792,741
合計		883,855,030	-	896,647,771	12,792,741

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

通貨関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		

市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	アメリカドル	145,607,208	-	145,433,920	173,288
	インドネシアルピア	22,392,240	-	22,619,795	227,555
	計	167,999,448	-	168,053,715	54,267
	売 建				
	アメリカドル	22,392,240	-	22,350,427	41,813
計	22,392,240	-	22,350,427	41,813	
合計	190,391,688	-	190,404,142	96,080	

(注)時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	35,432	34.05	1,206,459.60	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	381,370	8.79	3,352,242.30	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	58,400	1.34	78,489.60	
	LUKOIL-SPON ADR	33,424	61.80	2,065,603.20	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	5,934	122.30	725,728.20	
	ROSNEFT OJSC-GDR	79,148	7.29	577,384.66	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	73,930	7.86	581,089.80	
	TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	15,771	39.97	630,366.87	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	11.95	202,313.50	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	37,643	21.50	809,324.50	
	SEVERSTAL - GDR REG S	16,824	8.53	143,508.72	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,506	33.49	318,355.94	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	19,730	23.25	458,722.50	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	17,325	64.00	1,108,800.00	

	BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR	18,201	59.18	1,077,135.18	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	70,828	4.84	343,374.14	
	CREDICORP LTD	4,670	154.38	720,954.60	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	183,361	10.28	1,885,867.88	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	192,333	2.50	482,178.83	
	GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	44,085	3.55	156,501.75	
	MEGAFON-GDR	6,371	30.80	196,226.80	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	36,861	19.34	712,891.74	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	11,069	16.09	178,100.21	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	11,266	31.80	358,258.80	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	95,284	2.02	192,473.68	
	アメリカドル小計	1,475,696		18,562,353.00 (1,885,378,194)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	273,000	4.21	1,149,330.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	114,000	19.56	2,229,840.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,619,400	7.24	11,724,456.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	226,500	21.70	4,915,050.00	
	CNOOC LTD-R	1,131,000	13.46	15,223,260.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	200,000	12.10	2,420,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,340,000	9.65	12,931,000.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	144,000	5.92	852,480.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	332,000	2.83	939,560.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	77,000	28.20	2,171,400.00	
	BBMG CORPORATION - H	57,000	5.22	297,540.00	
	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	84,000	4.15	348,600.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	218,000	7.07	1,541,260.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	134,000	5.05	676,700.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	90,000	10.14	912,600.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	82,000	13.36	1,095,520.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	83,000	4.09	339,470.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	133,000	5.37	714,210.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	289,000	2.22	641,580.00	
	YINGDE GASES GROUP COMPANY	61,000	8.36	509,960.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	379,000	1.77	670,830.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	152,000	4.41	670,320.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	30,000	70.45	2,113,500.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	277,000	5.33	1,476,410.00	
	CHINA INTL MARINE CO-H	35,600	15.56	553,936.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	137,000	7.20	986,400.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	222,000	3.99	885,780.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	110,000	13.38	1,471,800.00	

CITIC PACIFIC LIMITED -R	94,000	13.92	1,308,480.00	
CSR CORP LTD-H	140,000	6.60	924,000.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	46,000	17.38	799,480.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.12	524,160.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	40,000	24.10	964,000.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	68,000	8.55	581,400.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	34,200	30.35	1,037,970.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	39,500	25.70	1,015,150.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	109,380	4.67	510,804.60	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	164,000	11.32	1,856,480.00	
AIR CHINA LIMITED-H	92,000	4.57	420,440.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	5.49	592,920.00	
CHINA COSCO HOLDONGS-H	142,500	3.06	436,050.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	71,513	25.15	1,798,551.95	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	220,000	1.95	429,000.00	
COSCO PACIFIC LIMITED-R	100,000	10.94	1,094,000.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	9.50	646,000.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.97	701,360.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	184,000	15.38	2,829,920.00	
BYD CO LTD-H	39,500	45.15	1,783,425.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	60,600	15.90	963,540.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	172,000	14.08	2,421,760.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	350,000	2.88	1,008,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	62,750	30.10	1,888,775.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	150,246	9.42	1,415,317.32	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	47,000	12.92	607,240.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	76,000	21.25	1,615,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	32,000	27.00	864,000.00	
CHINAVISION MEDIA GROUP LTD	320,000	1.70	544,000.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	285,000	8.79	2,505,150.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	37,000	9.31	344,470.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	593,958	1.29	766,205.82	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	70,000	7.09	496,300.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	9.90	326,700.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE-R	76,000	21.35	1,622,600.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	158,500	8.67	1,374,195.00	
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	12,000	40.05	480,600.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	68,000	-	-	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	225,300	3.07	691,671.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	448,000	1.80	806,400.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	82,000	36.05	2,956,100.00	

TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	124,000	21.75	2,697,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	22,000	60.30	1,326,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	93,600	5.99	560,664.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	390,000	10.62	4,141,800.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	49,500	81.95	4,056,525.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	8.35	901,800.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	16.06	690,580.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	66,800	22.05	1,472,940.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	104,000	6.23	647,920.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	26,000	27.30	709,800.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	274,000	4.97	1,361,780.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	184,000	6.56	1,207,040.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,419,000	3.52	4,994,880.00	
BANK OF CHINA LTD-H	5,042,200	3.49	17,597,278.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	592,475	5.16	3,057,171.00	
CHINA CITIC BANK-H	500,200	4.78	2,390,956.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,594,620	5.56	25,546,087.20	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	215,000	3.40	731,000.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	285,923	14.66	4,191,631.18	
CHINA MINSHENG BANKING-H	430,000	7.10	3,053,000.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	3.54	492,060.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	4,701,515	4.95	23,272,499.25	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	301,000	3.97	1,194,970.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	76,000	10.78	819,280.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	77,500	17.60	1,364,000.00	
FAR EAST HORIZON LTD	76,000	5.76	437,760.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	99,600	12.22	1,217,112.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	480,000	20.60	9,888,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	166,600	28.05	4,673,130.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	54,400	14.86	808,384.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	55,700	26.55	1,478,835.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	440,000	3.10	1,364,000.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	199,412	11.48	2,289,249.76	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	131,500	60.05	7,896,575.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	5.66	407,520.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD- R	275,040	20.20	5,555,808.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	128,000	15.10	1,932,800.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	85,600	15.52	1,328,512.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	313,285	3.37	1,055,770.45	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	348,000	3.26	1,134,480.00	

	FRANSHION PROPERTIES	220,000	2.10	462,000.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	10.20	701,760.00	
	LONGFOR PROPERTIES	93,500	10.10	944,350.00	
	NEW WORLD CHINA LAND LTD	170,000	4.69	797,300.00	
	POLY PRORERTY GROUP CO LIMITED	137,000	3.34	457,580.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	16.08	1,238,160.00	
	SHUI ON LAND LTD	209,278	1.95	408,092.10	
	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	231,091	4.12	952,094.92	
	SOHO CHINA LTD	113,000	6.10	689,300.00	
	YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	344,000	1.53	526,320.00	
	KINGSOFT CORP LTD	51,000	23.15	1,180,650.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	329,600	121.20	39,947,520.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	47,000	52.75	2,479,250.00	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	48,800	16.18	789,584.00	
	LENOVO GROUP LTD	418,000	10.50	4,389,000.00	
	ZTE CORP-H	40,424	15.24	616,061.76	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	182,000	3.61	657,020.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	386,000	75.80	29,258,800.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	848,000	3.91	3,315,680.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	320,000	12.26	3,923,200.00	
	CITIC 21CN CO LTD	140,000	5.94	831,600.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	262,000	5.32	1,393,840.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	128,000	15.54	1,989,120.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	197,000	7.95	1,566,150.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	56,000	24.00	1,344,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	121,400	22.20	2,695,080.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.- H	158,000	3.76	594,080.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	48,000	55.80	2,678,400.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	162,000	8.81	1,427,220.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	188,000	9.12	1,714,560.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	625,000	2.69	1,681,250.00	
	HANERGY SOLAR GROUP LTD	742,000	1.24	920,080.00	
	香港ドル小計	43,352,810		376,930,708.31 (4,941,561,585)	
マレーシア	BUMI ARMADA BERHAD	43,800	3.25	142,350.00	
リンギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	15,300	23.14	354,042.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	219,000	4.39	961,410.00	
	LAFARGE MALAYAN BHD	26,100	10.48	273,528.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	167,900	6.77	1,136,683.00	
	DIALOG GROUP BHD	110,600	3.85	425,810.00	
	GAMUDA BHD	125,000	4.89	611,250.00	

IJM CORP BHD	65,200	6.72	438,144.00	
MMC CORP BHD	53,800	2.53	136,114.00	
SIME DARBY BERHAD	186,342	9.66	1,800,063.72	
AIRASIA BHD	64,800	2.28	147,744.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	44,662	8.35	372,927.70	
MISC BHD	56,540	6.65	375,991.00	
UMW HOLDINGS BHD	37,100	11.36	421,456.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	31,318	3.88	121,513.84	
GENTING BHD	137,600	9.80	1,348,480.00	
GENTING MALAYSIA BERHAD	183,100	4.21	770,851.00	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	120,700	3.34	403,138.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	8,800	66.90	588,720.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	4.16	334,048.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	11.40	159,600.00	
IOI CORPORATION BHD	190,840	5.18	988,551.20	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	29,000	24.30	704,700.00	
PPB GROUP BERHAD	25,800	14.84	382,872.00	
IHH HEALTHCARE BHD	150,400	4.61	693,344.00	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,600	5.00	353,000.00	
AMMB HOLDINGS BHD	140,100	7.17	1,004,517.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	329,953	7.24	2,388,859.72	
HONG LEONG BANK BERHAD	32,680	14.00	457,520.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	15,900	16.38	260,442.00	
MALAYAN BANKING BHD	276,654	9.99	2,763,773.46	
PUBLIC BANK BHD-LOCAL MKT	174,920	20.04	3,505,396.80	
RHB CAPITAL BHD	33,654	8.72	293,462.88	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	105,280	2.45	257,936.00	
UEM SUNRISE BHD	119,400	2.03	242,382.00	
AXIATA GROUP BERHAD	155,575	6.89	1,071,911.75	
DIGI.COM BERHAD	218,800	5.69	1,244,972.00	
MAXIS BHD	143,600	6.69	960,684.00	
TELECOM MALAYSIA BHD	68,308	6.42	438,537.36	
PETRONAS GAS BHD	48,000	24.26	1,164,480.00	
TENAGA NATIONAL BHD	173,575	12.46	2,162,744.50	
YTL CORPORATION BERHAD	280,217	1.64	459,555.88	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	122,325	1.53	187,157.25	
マレーシアリングット小計	4,697,543		33,310,664.06 (1,067,606,783)	
タイパーツ				
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	79,000	28.75	2,271,250.00	
IRPC PCL - NVDR	572,800	3.32	1,901,696.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	91,400	161.50	14,761,100.00	
PTT PCL-NVDR	54,900	322.00	17,677,800.00	

	THAI OIL PCL-NVDR	48,000	51.75	2,484,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	114,400	27.00	3,088,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	107,434	67.00	7,198,078.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	26,400	466.00	12,302,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	23,800	196.00	4,664,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	8.80	3,234,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	113,200	31.50	3,565,800.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	51.50	2,889,150.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	193,029	9.85	1,901,335.65	
	CP ALL PCL-NVDR	302,200	47.00	14,203,400.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	168,800	27.75	4,684,200.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	235,900	16.30	3,845,170.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	63,900	201.00	12,843,900.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	11,200	201.00	2,251,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	76,300	215.00	16,404,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	41,700	212.00	8,840,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	199,750	22.40	4,474,400.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	104,300	179.50	18,721,850.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,259,400	2.50	3,148,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	79,400	48.25	3,831,050.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	70,500	225.00	15,862,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	433,800	9.95	4,316,310.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	35,600	83.25	2,963,700.00	
	タイパーツ小計	4,930,713		194,331,289.65 (614,086,875)	
フィリピン ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	133,060	54.50	7,251,770.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	139,100	29.70	4,131,270.00	
	DMCI HOLDINGS INC	69,090	75.40	5,209,386.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	133,900	50.00	6,695,000.00	
	SM INVESTMENTS CORP	10,157	815.00	8,277,955.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	39,080	112.00	4,376,960.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	180.00	4,581,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	59,850	160.00	9,576,000.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	96.45	5,055,909.00	
	BDO UNIBANK INC	84,191	91.90	7,737,152.90	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	35,519	90.00	3,196,710.00	
	AYALA CORPORATION	12,470	658.00	8,205,260.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	5.02	3,693,214.00	
	AYALA LAND INC	342,400	30.70	10,511,680.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.67	2,979,460.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	494,950	16.32	8,077,584.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,721.00	3,080,590.00	

	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,410	2,992.00	7,210,720.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	36.45	3,262,275.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	6.17	3,740,871.00	
	フィリピンベソ小計	3,705,337		116,850,766.90 (274,599,302)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY PT	800,500	1,180.00	944,590,000.00	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	20,600	26,750.00	551,050,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	43,600	11,125.00	485,050,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	97,100	25,000.00	2,427,500,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	194,800	16,200.00	3,155,760,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	121,300	24,000.00	2,911,200,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	6,125.00	756,437,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,284,700	7,650.00	9,827,955,000.00	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	473,000	2,050.00	969,650,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	256,000	2,730.00	698,880,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	356,000	3,595.00	1,279,820,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	99,300	14,600.00	1,449,780,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	27,000.00	540,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	473,300	3,875.00	1,834,037,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	27,500	53,225.00	1,463,687,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	80,500	10,225.00	823,112,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	288,800	6,900.00	1,992,720,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,100	31,225.00	3,125,622,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,356,500	1,715.00	2,326,397,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	808,200	11,300.00	9,132,660,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	4,330.00	850,845,000.00	
	BANK MANDIRI	584,398	10,150.00	5,931,639,700.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	476,900	4,980.00	2,374,962,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	695,900	11,175.00	7,776,682,500.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	349,500	1,590.00	555,705,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	1,090.00	1,322,170,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	3,308,800	2,615.00	8,652,512,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	139,400	7,850.00	1,094,290,000.00	
XL AXIATA TBK PT	172,500	5,325.00	918,562,500.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	694,200	5,525.00	3,835,455,000.00		
	インドネシアルピア小計	14,856,398		80,008,733,700.00 (704,076,856)	
メキシコベソ	CEMEX SAB-SPONS	771,904	17.38	13,415,691.52	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	248,692	45.72	11,370,198.24	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	10,445	342.02	3,572,398.90	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	66,290	53.28	3,531,931.20	
	MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	48,200	25.81	1,244,042.00	

	ALFA S.A.B. -A	187,400	36.36	6,813,864.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	31,700	72.30	2,291,910.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	17,200	179.40	3,085,680.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	11,700	162.78	1,904,526.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,480	87.45	1,528,626.00	
	OHL MEXICO SAB DE CV	37,600	42.87	1,611,912.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	164,790	88.98	14,663,014.20	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	150.14	1,636,526.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	19,600	43.00	842,800.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	342,280	33.98	11,630,674.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	25,775	89.63	2,310,213.25	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	26,700	148.83	3,973,761.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	125,940	122.33	15,406,240.20	
	GRUMA S.A.B. -B	9,800	153.57	1,504,986.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	118,800	39.42	4,683,096.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	34.28	1,227,224.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	101,000	35.35	3,570,350.00	
	GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	47,800	36.33	1,736,574.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	113,600	35.09	3,986,224.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	161,200	92.12	14,849,744.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	151,100	38.84	5,868,724.00	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	75,800	28.01	2,123,158.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,177,540	14.73	32,075,164.20	
	メキシコペソ小計	5,157,036		172,459,253.11 (1,352,080,544)	
ブラジル リアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	6,600	39.40	260,040.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	191,100	16.14	3,084,354.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	265,140	17.33	4,594,876.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	24,000	51.71	1,241,040.00	
	BRADSPAR SA -PREF	18,500	21.18	391,830.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	14.57	129,673.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	47,400	10.43	494,382.00	
	DURATEX SA	24,172	8.79	212,471.88	
	FIBRIA CELULOSE SA	16,000	22.74	363,840.00	
	GERDAU SA-PREF	52,400	13.83	724,692.00	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	16,100	16.85	271,285.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	18,500	8.77	162,245.00	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	28,079	8.40	235,863.60	
	VALE SA	79,800	30.81	2,458,638.00	
	VALE SA-PREF A	122,615	27.74	3,401,340.10	
	EMBRAER SA	41,100	20.64	848,304.00	
	WEG SA	16,120	26.86	432,983.20	

ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	24,700	7.90	195,130.00	
CCR SA	57,700	18.46	1,065,142.00	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	13,500	15.28	206,280.00	
LOCALIZA RENT A CAR	8,890	36.69	326,174.10	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	16,100	13.70	220,570.00	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	20,400	29.55	602,820.00	
KROTON EDUCATIONAL SA	20,821	59.06	1,229,688.26	
B2W CIA DIGITAL	6,700	28.84	193,228.00	
LOJAS AMERICANAS SA	9,000	12.25	110,250.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	32,947	14.25	469,494.75	
LOJAS RENNER S.A.	9,000	71.60	644,400.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	9,500	104.75	995,125.00	
RAIA DROGASIL SA	15,500	19.00	294,500.00	
AMBEV SA	296,800	16.07	4,769,576.00	
BRF SA	40,600	54.31	2,204,986.00	
JBS SA	48,700	7.72	375,964.00	
M DIAS BRANCO SA	2,100	95.50	200,550.00	
SOUZA CRUZ SA	25,100	22.50	564,750.00	
HYPERMARCAS SA	23,500	18.91	444,385.00	
NATURA COSMETICOS SA	11,400	37.66	429,324.00	
ODONTOPREV S.A.	12,400	9.69	120,156.00	
QUALICORP SA	15,800	26.19	413,802.00	
BANCO BRADESCO S.A.	38,000	32.80	1,246,400.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	135,200	32.05	4,333,160.00	
BANCO DO BRASIL S.A.	57,200	25.26	1,444,872.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	14,400	10.96	157,824.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	185,009	31.73	5,870,335.57	
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	196,948	8.64	1,701,630.72	
BM&FBOVESPA SA	116,200	11.26	1,308,412.00	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	13,800	31.25	431,250.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,500	33.03	1,502,865.00	
PORTO SEGURO SA	8,300	32.85	272,655.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	32,200	18.40	592,480.00	
BR PROPERTIES SA	13,000	13.30	172,900.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	50.53	277,915.00	
CIELO SA	45,720	45.38	2,074,773.60	
TOTVS SA	8,100	39.36	318,816.00	
OI SA-PREFERENCE	187,031	1.66	310,471.46	
TELEFONICA BRASIL S.A.	17,800	44.12	785,336.00	
TIM PARTICIPACOES SA	51,200	12.04	616,448.00	
AES TIETE SA-PREF	6,100	19.31	117,791.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,300	6.39	104,157.00	

	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	10.58	187,266.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	12,300	29.65	364,695.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	46,492	17.02	791,293.84	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,500	33.19	182,545.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	22,900	23.45	537,005.00	
	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	3,400	39.75	135,150.00	
	CPFL ENERGIA SA	17,468	20.01	349,534.68	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	12,900	10.74	138,546.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	11,200	33.22	372,064.00	
	ブラジルリアル小計	3,041,052		62,082,744.96 (2,850,218,821)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	27,411	7,389.50	202,553,584.50	
	CAP SA	3,824	8,099.90	30,974,017.60	
	EMPRESAS CMPC SA	88,645	1,295.60	114,848,462.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,515	16,603.00	91,565,545.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	21,385	7,528.10	160,988,418.50	
	S.A.C.I. FALABELLA	63,568	4,950.00	314,661,600.00	
	CENCOSUD SA	81,991	1,882.50	154,348,057.50	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	11,579	6,367.30	73,726,966.70	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,093.30	31,843,279.60	
	VINA CONCHA Y TORO SA	36,750	1,084.70	39,862,725.00	
	BANCO DE CHILE	1,727,558	73.41	126,820,032.78	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,187	32,499.00	71,075,313.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	4,363,638	37.02	161,541,878.76	
	CORPBANCA	8,419,981	6.85	57,676,869.85	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	7,218.10	43,987,101.40	
	AES GENER SA	141,749	296.89	42,083,860.61	
	AGUAS ANDINAS SA-A	172,048	354.71	61,027,146.08	
	COLBUN SA	552,443	148.23	81,888,625.89	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	219,242	865.16	189,679,408.72	
	ENERSIS SA	1,187,168	193.98	230,286,848.64	
	チリペソ小計	17,147,988		2,281,439,742.13 (419,328,624)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,786	44,100.00	122,862,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,846	101,000.00	388,446,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,866	55,000.00	157,630,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,389	17,850.00	114,043,650.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	25,400.00	71,755,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	64,500.00	90,880,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,291	69,800.00	299,511,800.00	
	KOREA ZINC CO LTD	536	411,000.00	220,296,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	87,900.00	92,382,900.00	

LG CHEM LTD	3,014	284,000.00	855,976,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	193,500.00	92,686,500.00	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,019	167,500.00	170,682,500.00	
OCI COMPANY LTD	1,127	161,500.00	182,010,500.00	
POSCO	4,137	300,000.00	1,241,100,000.00	
CJ CORP	898	151,500.00	136,047,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,906	87,600.00	166,965,600.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	9,670.00	79,970,900.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,422	37,850.00	91,672,700.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	6,400	26,100.00	167,040,000.00	
DOOSAN CORP	423	118,500.00	50,125,500.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	4,293	33,050.00	141,883,650.00	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	10,720	12,950.00	138,824,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	38,000.00	129,124,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	4,625	33,250.00	153,781,250.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4,562	61,500.00	280,563,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,639	171,500.00	452,588,500.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	778	142,500.00	110,865,000.00	
KCC CORP	260	636,000.00	165,360,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,570	32,400.00	83,268,000.00	
LG CORP	5,661	62,300.00	352,680,300.00	
LS CORP	1,095	71,400.00	78,183,000.00	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	1,153	65,800.00	75,867,400.00	
SAMSUNG C&T CORP	7,815	72,500.00	566,587,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,041	76,400.00	155,932,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	11,702	26,750.00	313,028,500.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,380	51,500.00	122,570,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,514	168,000.00	254,352,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	10,240	11,300.00	115,712,000.00	
S-1 CORPORATION	981	78,800.00	77,302,800.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	922	278,000.00	256,316,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,615	34,150.00	55,152,250.00	
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	2,510	51,000.00	128,010,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	5,208	58,900.00	306,751,200.00	
HYUNDAI MOBIS	4,350	272,000.00	1,183,200,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	9,994	224,000.00	2,238,656,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,016	156,000.00	314,496,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,250	149,000.00	186,250,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	1,138	189,000.00	215,082,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	17,171	54,000.00	927,234,000.00	
COWAY CO.,LTD.	3,296	90,000.00	296,640,000.00	
LG ELECTRONICS INC	6,612	73,900.00	488,626,800.00	

HOTEL SHILLA CO LTD	2,007	101,000.00	202,707,000.00	
KANGWON LAND INC	6,709	32,350.00	217,036,150.00	
PARADISE CO LTD	2,266	39,650.00	89,846,900.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	22,050.00	111,793,500.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	832	137,500.00	114,400,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	766	297,000.00	227,502,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	417	209,000.00	87,153,000.00	
EMART	1,242	239,000.00	296,838,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	528	353,500.00	186,648,000.00	
HITE JINRO CO LTD	1,710	21,300.00	36,423,000.00	
KT&G CORP	7,022	91,800.00	644,619,600.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	45	1,956,000.00	88,020,000.00	
ORION CORP	243	915,000.00	222,345,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	209	1,642,000.00	343,178,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	613	424,000.00	259,912,000.00	
PACIFIC CORP	190	804,000.00	152,760,000.00	
CELLTRION INC	3,895	44,850.00	174,690,750.00	
YUHAN CORPORATION	545	174,500.00	95,102,500.00	
BS FINANCIAL GROUP INC	10,877	15,250.00	165,874,250.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	10,140	14,850.00	150,579,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	19,508	36,650.00	714,968,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	12,940	13,050.00	168,867,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	24,444	35,850.00	876,317,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	27,425	46,000.00	1,261,550,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	18,886	12,050.00	227,576,300.00	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	14,298	9,000.00	128,682,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,450	42,600.00	146,970,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,508	47,000.00	70,876,000.00	
SAMSUNG CARD CO	3,136	42,150.00	132,182,400.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,786	45,900.00	173,777,400.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	11,840	8,770.00	103,836,800.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	2,150	52,000.00	111,800,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	6,410.00	78,330,200.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	5,035	28,550.00	143,749,250.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,089	270,500.00	565,074,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	3,846	101,000.00	388,446,000.00	
NAVER CORP	1,798	805,000.00	1,447,390,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,050	168,000.00	176,400,000.00	
SK C&C CO LTD	1,235	179,000.00	221,065,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	14,390	32,650.00	469,833,500.00	
LG INNOTEK CO LTD	857	146,500.00	125,550,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3,754	58,000.00	217,732,000.00	

	SAMSUNG SDI CO LTD	3,445	164,000.00	564,980,000.00	
	KT CORP	3,800	30,350.00	115,330,000.00	
	LG UPLUS CORP	12,570	9,130.00	114,764,100.00	
	SK TELECOM	945	242,000.00	228,690,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	15,520	36,800.00	571,136,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,912	57,400.00	109,748,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,077	1,308,000.00	9,256,716,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,300	1,040,000.00	1,352,000,000.00	
	SK HYNIX INC	36,125	49,750.00	1,797,218,750.00	
	韓国ウォン小計	518,268		41,085,959,950.00 (4,137,356,166)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	74,240	74.30	5,516,032.00	
	ASIA CEMENT CORP	119,957	41.40	4,966,219.80	
	CHINA STEEL	725,452	25.15	18,245,117.80	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	203,061	71.50	14,518,861.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	265,824	76.90	20,441,865.60	
	NAN YA PLASTICS CORP	313,752	70.90	22,245,016.80	
	TAIWAN CEMENT	228,929	45.70	10,462,055.30	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	49,000	59.30	2,905,700.00	
	TSRC CORP	64,830	42.80	2,774,724.00	
	CTCI CORP	64,000	51.20	3,276,800.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	191,743	32.75	6,279,583.25	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	11,797	347.00	4,093,559.00	
	TAIWAN GLASS IND CORP	65,486	24.95	1,633,875.70	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	120,000	33.65	4,038,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	199,000	11.25	2,238,750.00	
	CHINA AIRLINES LTD	227,203	10.15	2,306,110.45	
	EVA AIRWAYS CORP	116,000	14.55	1,687,800.00	
	EVERGREEN MARINE	106,499	16.50	1,757,233.50	
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	32,000	50.20	1,606,400.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	143,900	12.05	1,733,995.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	95,061	77.00	7,319,697.00	
	CHINA MOTOR CORP	51,000	29.90	1,524,900.00	
	YULON MOTOR COMPANY	65,000	48.95	3,181,750.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,000	335.00	3,685,000.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	32.85	1,314,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	15,464	232.00	3,587,648.00	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,000	210.00	2,310,000.00	
	POU CHEN	117,780	34.65	4,081,077.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	78.00	2,874,066.00	
	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	2,928	367.00	1,074,576.00	
	FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	49,632	28.60	1,419,475.20	

HOTAI MOTOR COMPANY LTD	15,000	379.50	5,692,500.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	34,544	238.50	8,238,744.00	
STANDARD FOODS CORP	25,834	82.40	2,128,721.60	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	287,805	56.20	16,174,641.00	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	12,080	73.10	883,048.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	391,186	18.80	7,354,296.80	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	895,780	9.87	8,841,348.60	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	826,537	20.10	16,613,393.70	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	390,085	19.05	7,431,119.25	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	454,874	19.25	8,756,324.50	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	386,206	18.75	7,241,362.50	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	628,557	25.10	15,776,780.70	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	408,390	13.95	5,697,040.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	467,162	15.70	7,334,443.40	
TAIWAN BUSINESS BANK	385,843	9.36	3,611,490.48	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	337,508	17.15	5,788,262.20	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	60,900	74.80	4,555,320.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	452,082	44.65	20,185,461.30	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	542,944	16.30	8,849,987.20	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	473,287	46.95	22,220,824.65	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	224,685	28.40	6,381,054.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	603,349	9.43	5,689,581.07	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	10,000	41.00	410,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	21,600	67.00	1,447,200.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,445	56.20	1,879,609.00	
ACER INC	200,375	21.55	4,318,081.25	
ADVANTECH CO LTD	19,600	246.00	4,821,600.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	43,092	325.00	14,004,900.00	
AU OPTRONICS CORP	644,090	12.90	8,308,761.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	38,700	281.00	10,874,700.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,225	84.10	2,373,722.50	
CLEVO COMPANY	38,008	52.50	1,995,420.00	
COMPAL ELECTRONICS	271,760	25.75	6,997,820.00	
DELTA ELECTRONICS INC	117,520	206.50	24,267,880.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,447	74.80	4,072,635.60	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	702,352	105.00	73,746,960.00	
HTC CORPORATION	42,430	135.00	5,728,050.00	
INVENTEC CO LTD	136,511	29.20	3,986,121.20	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,040	2,365.00	16,649,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	126,571	53.10	6,720,920.10	
PEGATRON CORP	93,474	58.20	5,440,186.80	
QUANTA COMPUTER INC	181,270	87.50	15,861,125.00	

	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	20,354	188.00	3,826,552.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	90,381	50.70	4,582,316.70	
	TPK HOLDING CO LTD	16,969	267.00	4,530,723.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	133,000	28.65	3,810,450.00	
	WISTRON CORP	139,129	29.25	4,069,523.25	
	WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	42.30	3,434,210.10	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	97.90	2,146,163.80	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	155,000	17.85	2,766,750.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	229,315	96.10	22,037,171.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	102,000	67.70	6,905,400.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	102,200	91.20	9,320,640.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	393,739	39.00	15,355,821.00	
	EPISTAR CORP	57,000	76.20	4,343,400.00	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	1,280.00	3,840,000.00	
	INOTERA MEMORIES INC	144,000	58.70	8,452,800.00	
	KINSUS INTERCONNECT TECH	24,000	133.00	3,192,000.00	
	MEDIATEK INC	89,804	519.00	46,608,276.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	38,045	152.50	5,801,862.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	237.50	2,754,762.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	57,770	53.90	3,113,803.00	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	26,157	138.50	3,622,744.50	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,944	94.50	3,113,208.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	186,000	53.90	10,025,400.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,572,389	134.00	210,700,126.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	108.00	1,020,060.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	738,000	15.50	11,439,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	46.20	2,494,800.00	
	新台湾ドル小計	19,462,882		977,758,890.65 (3,324,380,228)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	12,903	582.85	7,520,513.55	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	351.75	7,791,262.50	
	COAL INDIA LTD	31,324	365.70	11,455,186.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	44,996	404.95	18,221,130.20	
	OIL INDIA LTD	7,461	573.65	4,280,002.65	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	81,000	1,000.95	81,076,950.00	
	ACC LTD	1,768	1,435.55	2,538,052.40	
	AMBUJA CEMENTS LTD	43,365	218.95	9,494,766.75	
	ASIAN PAINTS LTD	15,325	594.65	9,113,011.25	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	74,282	170.55	12,668,795.10	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	25,076	297.20	7,452,587.20	
	JSW STEEL LTD	5,443	1,196.10	6,510,372.30	

SESA STERLITE LTD	72,583	294.40	21,368,435.20
TATA STEEL LTD	21,182	518.35	10,979,689.70
ULTRATECH CEMENT LTD	2,375	2,494.00	5,923,250.00
ADANI ENTERPRISES LTD	7,547	444.05	3,351,245.35
ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,306	1,330.85	3,068,940.10
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	39,056	243.45	9,508,183.20
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	72,635	65.55	4,761,224.25
LARSEN & TOUBRO LTD	19,727	1,651.65	32,582,099.55
SIEMENS INDIA LTD	5,358	885.00	4,741,830.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	31,916	264.90	8,454,548.40
BAJAJ AUTO LTD	5,913	2,169.65	12,829,140.45
HERO MOTOCORP LTD	5,599	2,537.90	14,209,702.10
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	20,789	1,178.55	24,500,875.95
TATA MOTORS LTD	45,179	457.25	20,658,097.75
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	529	4,693.25	2,482,729.25
ITC LTD	147,168	341.50	50,257,872.00
NESTLE INDIA LIMITED	1,289	5,007.00	6,454,023.00
UNITED BREWERIES LTD	4,195	696.60	2,922,237.00
UNITED SPIRITS LTD	2,945	2,295.90	6,761,425.50
DABUR INDIA LTD	19,484	194.80	3,795,483.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,666	804.05	5,359,797.30
HINDUSTAN UNILEVER LTD	47,244	629.85	29,756,633.40
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	5,429	1,015.65	5,513,963.85
AUROBINDO PHARMA LTD	6,423	677.90	4,354,151.70
CIPLA LTD	22,105	436.25	9,643,306.25
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,694	1,464.60	3,945,632.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	7,820	2,663.25	20,826,615.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,535	699.75	2,473,616.25
RANBAXY LABORATORIES LTD	7,328	543.30	3,981,302.40
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	44,869	724.40	32,503,103.60
HDFC BANK LTD	30,103	830.30	24,994,520.90
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	93,818	1,015.40	95,262,797.20
ICICI BANK LTD	13,726	1,403.05	19,258,264.30
LIC HOUSING FINANCE LTD	19,565	315.30	6,168,844.50
STATE BANK OF INDIA	9,172	2,582.25	23,684,397.00
YES BANK LTD	12,312	513.15	6,317,902.80
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	255.60	4,145,320.80
POWER FINANCE CORPORATION	19,274	290.25	5,594,278.50
RELIANCE CAPITAL LTD	5,343	591.10	3,158,247.30
RURAL ELECTRIFICATION CORP	22,694	347.80	7,892,973.20
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,407	899.65	7,563,357.55
DLF LTD	24,294	204.00	4,955,976.00

	HCL TECHNOLOGIES LTD	16,552	1,473.20	24,384,406.40	
	INFOSYS LTD	29,042	3,310.35	96,139,184.70	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	29,895	2,398.15	71,692,694.25	
	TECH MAHINDRA LTD	4,330	2,067.35	8,951,625.50	
	WIPRO LTD	38,739	545.30	21,124,376.70	
	BHARTI AIRTEL LTD	43,015	341.50	14,689,622.50	
	IDEA CELLULAR LTD	66,713	133.65	8,916,192.45	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	53,477	130.45	6,976,074.65	
	GAIL INDIA LTD	17,528	459.15	8,047,981.20	
	NTPC LTD	103,917	150.65	15,655,096.05	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	77,903	136.20	10,610,388.60	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,423	749.85	5,566,136.55	
	RELIANCE POWER LTD	55,858	96.30	5,379,125.40	
	TATA POWER CO LTD	91,032	102.85	9,362,641.20	
	インドルピー小計	1,957,331		1,062,584,211.00 (1,817,019,000)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,097	4,489.00	4,924,433.00	
	02 CZECH REPUBLIC AS	10,364	260.50	2,699,822.00	
	CEZ AS	11,848	576.80	6,833,926.40	
	チェココルナ小計	23,309		14,458,181.40 (73,158,397)	
ハンガリー フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	2,292	11,455.00	26,254,860.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	9,198	4,305.00	39,597,390.00	
	OTP BANK NYRT	14,777	4,141.00	61,191,557.00	
	ハンガリーフォリント小計	26,267		127,043,807.00 (56,890,216)	
アラブ首長国連 邦 ディルハム	ARABTEC HOLDING CO	66,132	4.13	273,125.16	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	69,526	8.09	562,465.34	
	DUBAI ISLAMIC BANK	31,286	7.08	221,504.88	
	FIRST GULF BANK	27,750	16.70	463,425.00	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	40,984	14.70	602,464.80	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	127,997	3.16	404,470.52	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	187,596	3.57	669,717.72	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	127,265	9.29	1,182,291.85	
	アラブ首長国連邦ディルハム小計	678,536		4,379,465.27 (121,354,982)	
ポーランド ズロチ	GRUPA LOTOS SA	5,516	36.59	201,830.44	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	20,337	41.32	840,324.84	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	127,348	5.20	662,209.60	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	73.50	204,771.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	5,591	42.50	237,617.50	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	9,719	123.00	1,195,437.00	
	SYNTHOS SA	33,750	4.44	149,850.00	

	CYFROWY POLSAT SA	11,880	22.00	261,360.00	
	EUROCASH SA	5,057	39.30	198,740.10	
	ALIOR BANK SA	2,949	81.00	238,869.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	105.00	211,050.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	7.86	259,513.62	
	BANK PEKAO SA	8,400	166.35	1,397,340.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	1,724	354.75	611,589.00	
	GETIN NOBLE BANK SA	69,829	3.11	217,168.19	
	M BANK SA	946	486.15	459,897.90	
	PKO BANK POLSKI SA	55,873	37.35	2,086,856.55	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,550	430.50	1,528,275.00	
	ORANGE POLSKA SA	36,440	9.32	339,620.80	
	ENEA SA	12,967	15.75	204,230.25	
	ENERGA SA	12,891	20.70	266,843.70	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	47,741	20.45	976,303.45	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	62,618	5.22	326,865.96	
	ポーランドズロチ小計	572,939		13,076,563.90 (439,634,078)	
南アフリカ ランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,884	137.84	1,086,730.56	
	SASOL LTD	34,716	629.51	21,854,069.16	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	5,864	189.60	1,111,814.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,903	480.43	1,875,118.29	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	25,821	192.97	4,982,678.37	
	ASSORE LTD	1,860	365.06	679,011.60	
	GOLD FIELDS LTD	53,925	42.42	2,287,498.50	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	24,219	34.20	828,289.80	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	36,675	109.00	3,997,575.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	4,308	343.36	1,479,194.88	
	NAMPAK LTD	37,852	37.78	1,430,048.56	
	NORTHAM PLATINUM LTD	20,443	45.40	928,112.20	
	PPC LIMITED	48,599	31.71	1,541,074.29	
	SAPPI LIMITED	36,526	42.15	1,539,570.90	
	BARLOWORLD LTD	13,028	101.57	1,323,253.96	
	BIDVEST GROUP LTD	20,760	283.00	5,875,080.00	
	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	105,534	55.65	5,872,967.10	
	NASPERS LTD-N SHS	25,309	1,300.00	32,901,700.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,372	187.20	2,503,238.40	
	MR PRICE GROUP LTD	16,838	187.00	3,148,706.00	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	13,105	114.00	1,493,970.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	26,207	75.38	1,975,483.66	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	52,612	78.59	4,134,777.08	
	MASSMART HOLDINGS LTD	8,389	139.64	1,171,439.96	

	PICK N PAY STORES LTD	18,180	57.59	1,046,986.20	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	28,120	159.45	4,483,734.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	10,016	124.78	1,249,796.48	
	TIGER BRANDS LTD	10,477	304.91	3,194,542.07	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	58,419	42.69	2,493,907.11	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	25,519	85.10	2,171,666.90	
	NETCARE LTD	56,730	30.45	1,727,428.50	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	19,956	286.19	5,711,207.64	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	21,147	163.75	3,462,821.25	
	NEDBANK GROUP LTD	13,232	236.80	3,133,337.60	
	STANDARD BANK GROUP LTD	77,624	146.98	11,409,175.52	
	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	101,518	7.45	756,309.10	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	13,104	94.10	1,233,086.40	
	FIRSTRAND LTD	203,384	41.29	8,397,725.36	
	INVESTEC LTD	15,904	97.00	1,542,688.00	
	REMGRO LTD	30,851	230.60	7,114,240.60	
	RMB HOLDINGS LTD	46,092	53.62	2,471,453.04	
	DISCOVERY LIMITED	21,520	97.00	2,087,440.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	127.40	793,192.40	
	MMI HOLDINGS LTD	67,408	25.69	1,731,711.52	
	RMI HOLDINGS	40,408	32.25	1,303,158.00	
	SANLAM LTD	118,511	63.00	7,466,193.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	124,147	24.51	3,042,842.97	
	MTN GROUP LTD	106,757	224.20	23,934,919.40	
	VODACOM GROUP	23,182	129.39	2,999,518.98	
	南アフリカランド小計	1,896,181		210,980,484.71 (2,008,534,214)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,100	50.80	411,480.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	100,241	4.25	426,024.25	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	3,111	23.85	74,197.35	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	28,492	5.70	162,404.40	
	KOC HOLDING AS	40,002	10.50	420,021.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	32,617	2.92	95,241.64	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	16.95	166,720.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,354	6.68	216,124.72	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	26.55	86,499.90	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	12.80	86,400.00	
	ARCELIK AS	15,358	12.95	198,886.10	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	13,227	49.70	657,381.90	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	12,636	27.35	345,594.60	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	54.00	238,518.00	
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	18.20	175,193.20	

	AKBANK T.A.S.	125,162	8.00	1,001,296.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	159,178	8.45	1,345,054.10	
	TURKIYE HALK BANKASI	40,297	15.75	634,677.75	
	TURKIYE IS BANKASI-C	116,418	5.76	670,567.68	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	53,103	4.95	262,859.85	
	YAPI VE KREDI BANKASI	61,418	4.64	284,979.52	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	65,971	9.83	648,494.93	
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	137,355	2.68	368,111.40	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	26,540	5.95	157,913.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	51,719	12.85	664,589.15	
	トルコリラ小計	1,157,186		9,799,230.64 (470,657,047)	
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	10,088	22.99	231,923.12	
	OPAP SA	25,530	12.50	319,125.00	
	FOLLI FOLLIE SA	7,104	32.69	232,229.76	
	JUMBO SA	21,351	11.17	238,490.67	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	33,801	10.48	354,234.48	
	ユーロ小計	97,874		1,376,003.03 (190,714,019)	
カタール リアル	INDUSTRIES QATAR	1,894	180.00	340,920.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	2,623	66.50	174,429.50	
	DOHA BANK QSC	2,020	57.30	115,746.00	
	MASRAF AL RAYAN	22,613	52.80	1,193,966.40	
	QATAR ISLAMIC BANK	3,287	97.10	319,167.70	
	QATAR NATIONAL BANK	2,687	174.80	469,687.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	40.35	154,379.10	
	OOREDOO QSC	4,532	135.00	611,820.00	
	VODAFONE QATAR	19,530	18.78	366,773.40	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	183.30	291,630.30	
	カタールリアル小計	64,603		4,038,520.00 (112,876,634)	
	合計	124,819,949		26,861,512,565 (26,861,512,565)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	メキシコペソ	CONTROLADORA COML MEXIC-UB	23,900.00	1,164,886.00	
		メキシコペソ小計	23,900.00	1,164,886.00 (9,132,706)	
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER SA	57,900.00	857,499.00	
KLABIN SA-UNIT		34,800.00	400,200.00		
SUL AMERICA SA-UNITS		8,518.00	132,880.80		

		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500.00	150,000.00	
		VIA VAREJO SA	6,400.00	161,152.00	
		ブラジルリアル小計	115,118.00	1,701,731.80 (78,126,506)	
	南アフリカランド	REDEFINE PROPERTIES LTD	210,258.00	1,972,220.04	
		南アフリカランド小計	210,258.00	1,972,220.04 (18,775,534)	
		投資信託受益証券合計		106,034,746 (106,034,746)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	126,000.00	5,704,020.00	
		メキシコペソ小計	126,000.00	5,704,020.00 (44,719,516)	
		投資証券合計		44,719,516 (44,719,516)	
		合計		150,754,262 (150,754,262)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 25銘柄	100.0%	7.0%
香港ドル	株式 141銘柄	100.0%	18.3%
マレーシアリングット	株式 43銘柄	100.0%	4.0%
タイバーツ	株式 27銘柄	100.0%	2.3%
フィリピンペソ	株式 20銘柄	100.0%	1.0%
インドネシアルピア	株式 30銘柄	100.0%	2.6%
メキシコペソ	株式 28銘柄	96.2%	5.0%
	投資信託受益証券 1銘柄	0.6%	0.0%
	投資証券 1銘柄	3.2%	0.2%
ブラジルリアル	株式 68銘柄	97.3%	10.6%
	投資信託受益証券 5銘柄	2.7%	0.3%
チリペソ	株式 20銘柄	100.0%	1.6%
韓国ウォン	株式 102銘柄	100.0%	15.3%
新台湾ドル	株式 100銘柄	100.0%	12.3%
インドルピー	株式 68銘柄	100.0%	6.7%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%	0.3%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%	0.2%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	株式 23銘柄	100.0%	1.6%

南アフリカランド	株式	49銘柄	99.1%	7.4%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.9%	0.1%
トルコリラ	株式	25銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	株式	5銘柄	100.0%	0.7%
カタールリアル	株式	10銘柄	100.0%	0.4%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	706,815,187
コール・ローン	386,019,973
国債証券	40,100,301,052
派生商品評価勘定	513,684
未収利息	550,103,208
前払費用	159,139,746
流動資産合計	41,902,892,850
資産合計	41,902,892,850
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	210,583
未払金	859,533,233

未払解約金	961,445
流動負債合計	860,705,261
負債合計	860,705,261
純資産の部	
元本等	
元本	24,202,347,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,839,840,123
元本等合計	41,042,187,589
純資産合計	41,042,187,589
負債純資産合計	41,902,892,850

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	13,151,424,114円
計算期間中の追加設定元本額	12,394,160,993円
計算期間中の一部解約元本額	1,343,237,641円
計算日の元本額	24,202,347,466円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	2,777,140,711円
世界経済インデックスファンド	650,196,580円
DC新興国債券インデックス・オープン	2,218,920,918円
DC世界経済インデックスファンド	624,139,034円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	485,854,148円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,922,805,484円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,441,138,147円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	10,437,200,907円
分散投資コア戦略ファンドA	542,595,125円
分散投資コア戦略ファンドS	519,007,865円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	2,463,996円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	89,964,079円
コア投資戦略ファンド(切替型)	432,304,295円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	27,255,366円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	28,149,053円
新興国債券インデックス・オープン	3,211,758円
2. 計算日における受益権総数	24,202,347,466口
3. 1口当たり純資産額	1.6958円
(1万口当たり純資産額)	(16,958円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等に晒されております。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p> <p>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、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>
--------------------------	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	358,450,957	
合計	358,450,957	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年11月12日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
通貨関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	アメリカドル	142,708,660	-	142,691,800	16,860
	マレーシアリングット	47,254,082	-	47,217,251	36,831
	インドネシアルピア	44,294,363	-	44,725,335	430,972
	メキシコペソ	47,824,000	-	47,763,000	61,000
	ハンガリーフォリント	27,085,850	-	27,085,850	-
	ポーランドズロチ	50,415,000	-	50,415,000	-
	南アフリカランド	53,312,000	-	53,256,000	56,000
	ロシアルーブル	14,800,030	-	14,787,356	12,674
	トルコリラ	52,785,700	-	52,778,000	7,700
	コロンビアペソ	25,384,985	-	25,369,424	15,561
	計	505,864,670	-	506,089,016	224,346
	売 建				
アメリカドル	84,479,378	-	84,400,623	78,755	
計	84,479,378	-	84,400,623	78,755	
合計	590,344,048	-	590,489,639	303,101	

(注)時価の算定方法

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

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

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

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	9,550,000.00	9,518,341.75	
		MGS 3.197% 10/15/15	1,350,000.00	1,348,717.50	
		MGS 3.26% 03/01/18	6,900,000.00	6,824,548.50	
		MGS 3.314% 10/31/17	10,800,000.00	10,720,620.00	
		MGS 3.394% 03/15/17	1,250,000.00	1,246,481.25	
		MGS 3.418% 08/15/22	7,000,000.00	6,725,950.00	
		MGS 3.48% 03/15/23	2,650,000.00	2,551,340.50	
		MGS 3.492% 03/31/20	7,400,000.00	7,288,038.00	
		MGS 3.58% 09/28/18	7,700,000.00	7,701,232.00	
		MGS 3.654% 10/31/19	4,000,000.00	3,994,640.00	
		MGS 3.741% 02/27/15	7,700,000.00	7,721,714.00	
		MGS 3.835% 08/12/15	3,200,000.00	3,219,680.00	
		MGS 3.844% 04/15/33	4,350,000.00	4,055,309.25	
		MGS 3.889% 07/31/20	7,350,000.00	7,374,291.75	
		MGS 3.892% 03/15/27	6,500,000.00	6,277,050.00	
		MGS 4.012% 09/15/17	2,600,000.00	2,634,645.00	
		MGS 4.048% 09/30/21	5,500,000.00	5,561,600.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	3,250,000.00	3,153,491.25	
		MGS 4.16% 07/15/21	6,500,000.00	6,609,427.50	
		MGS 4.181% 07/15/24	4,400,000.00	4,463,558.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	780,000.00	765,772.80	
		MGS 4.24% 02/07/18	3,900,000.00	3,982,933.50	
		MGS 4.262% 09/15/16	5,900,000.00	6,006,642.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	5,350,000.00	5,515,475.50		
	MGS 4.392% 04/15/26	3,900,000.00	3,995,842.50		
	MGS 5.734% 07/30/19	350,000.00	381,958.50		
	マレーシアリンギット小計			130,130,000.00	129,639,301.55 (4,154,939,614)
タイパーツ	THAIGB 2.8% 10/10/17	35,000,000.00	34,968,150.00		
	THAIGB 3.125% 12/11/15	62,000,000.00	62,737,800.00		
	THAIGB 3.25% 06/16/17	180,000,000.00	183,108,600.00		
	THAIGB 3.45% 03/08/19	58,600,000.00	59,118,903.00		
	THAIGB 3.58% 12/17/27	86,500,000.00	83,835,800.00		
	THAIGB 3.625% 06/16/23	107,000,000.00	106,407,755.00		
	THAIGB 3.65% 12/17/21	100,200,000.00	100,826,250.00		

	THAIGB 3.875% 06/13/19	167,000,000.00	172,144,435.00	
	THAIGB 4.125% 11/18/16	15,700,000.00	16,246,595.50	
	THAIGB 4.75% 12/20/24	12,262,000.00	13,238,852.23	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	36,000,000.00	39,863,520.00	
	THAIGB 5.125% 03/13/18	27,000,000.00	29,004,480.00	
	タイバーツ小計	887,262,000.00	901,501,140.73 (2,848,743,604)	
フィリピンペソ	RPGB 7.375% 03/03/21	19,700,000.00	23,208,176.00	
	RPGB 8% 07/19/31	41,600,000.00	54,864,784.00	
	フィリピンペソ小計	61,300,000.00	78,072,960.00 (183,471,456)	
インドネシア ルピア	INDOGB 10% 02/15/28	5,700,000,000.00	6,348,375,000.00	
	INDOGB 10% 07/15/17	3,600,000,000.00	3,847,644,000.00	
	INDOGB 10.5% 08/15/30	4,600,000,000.00	5,321,625,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	5,850,000,000.00	6,957,843,750.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	9,400,000,000.00	10,851,125,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	3,000,000,000.00	3,763,125,000.00	
	INDOGB 5.25% 05/15/18	14,800,000,000.00	13,690,000,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	27,000,000,000.00	22,848,750,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	13,500,000,000.00	10,892,812,500.00	
	INDOGB 6.25% 04/15/17	12,300,000,000.00	11,938,011,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	63,250,000,000.00	50,837,187,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	12,100,000,000.00	11,351,312,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	26,200,000,000.00	23,137,875,000.00	
	INDOGB 7.375% 09/15/16	16,700,000,000.00	16,704,676,000.00	
	INDOGB 7.875% 04/15/19	20,000,000,000.00	20,112,500,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	29,700,000,000.00	28,344,937,500.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	9,200,000,000.00	9,315,000,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	40,000,000,000.00	40,950,000,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	4,000,000,000.00	3,980,000,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	36,550,000,000.00	37,966,312,500.00	
	INDOGB 9.5% 05/15/41	4,765,000,000.00	5,044,943,750.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	3,400,000,000.00	3,633,750,000.00	
	インドネシアルピア小計	365,615,000,000.00	347,837,806,000.00 (3,060,972,692)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	9,900,000.00	13,855,446.00	
	MBONO 10% 12/05/24	29,000,000.00	38,788,950.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	27,100,000.00	27,407,314.00	
	MBONO 5% 06/15/17	30,500,000.00	31,580,310.00	
	MBONO 6% 06/18/15	12,500,000.00	12,842,750.00	
	MBONO 6.25% 06/16/16	33,200,000.00	35,055,714.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,800,000.00	28,509,036.00	

	MBONO 6.5% 06/10/21	24,400,000.00	26,167,902.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	29,300,000.00	31,823,462.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	24,000,000.00	27,226,800.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,900,000.00	38,614,642.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	25,200,000.00	28,553,742.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,000,000.00	5,708,125.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	40,600,000.00	45,366,237.00	
	MBONO 8% 06/11/20	20,000,000.00	23,040,100.00	
	MBONO 8% 12/07/23	21,500,000.00	25,136,617.50	
	MBONO 8% 12/17/15	11,500,000.00	12,284,645.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	21,300,000.00	25,979,610.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	25,000,000.00	30,542,375.00	
	MBONO 8.5% 12/13/18	16,000,000.00	18,533,920.00	
メキシコペソ小計		466,700,000.00	527,017,698.50 (4,131,818,756)	
ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/16	15,400,000.00	13,155,142.00	
	BLTN 0% 01/01/17	5,000,000.00	3,817,505.00	
	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000.00	9,497,865.25	
	BLTN 0% 07/01/16	6,950,000.00	5,615,558.30	
	BNTNF 10% 01/01/15	3,700,000.00	3,678,806.00	
	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000.00	9,209,336.99	
	BNTNF 10% 01/01/18	9,300,000.00	8,897,839.10	
	BNTNF 10% 01/01/21	8,300,000.00	7,641,950.22	
	BNTNF 10% 01/01/23	6,250,000.00	5,656,149.33	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	7,100,000.00	7,379,491.50	
	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000.00	9,952,722.50	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	2,500,000.00	2,930,312.50	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,400,000.00	1,347,500.00	
ブラジルリアル小計		95,150,000.00	88,780,178.69 (4,075,898,003)	
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	250,000,000.00	263,312,500.00	
チリペソ小計		250,000,000.00	263,312,500.00 (48,396,837)	
コロンビアペソ	COLOM 12% 10/22/15	13,400,000,000.00	14,645,061,000.00	
	COLOM 4.375% 03/21/23	2,950,000,000.00	2,734,222,250.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	11,350,000,000.00	13,035,248,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	7,500,000,000.00	10,009,725,000.00	
コロンビアペソ小計		35,200,000,000.00	40,424,256,250.00 (2,207,164,391)	
ハンガリー フォロント	HGB 4% 04/25/18	213,000,000.00	220,172,775.00	
	HGB 5.5% 02/12/16	239,000,000.00	251,515,235.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	111,000,000.00	122,578,410.00	
	HGB 5.5% 12/20/18	300,000,000.00	328,861,500.00	

	HGB 5.5% 12/22/16	208,000,000.00	222,401,920.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	644,000,000.00	734,678,420.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	507,000,000.00	580,426,275.00	
	HGB 6.75% 02/24/17	295,000,000.00	325,483,825.00	
	HGB 6.75% 11/24/17	486,000,000.00	546,664,950.00	
	HGB 7% 06/24/22	358,000,000.00	431,395,370.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	315,000,000.00	382,838,400.00	
	HGB 7.75% 08/24/15	240,000,000.00	254,854,800.00	
	HGB 8% 02/12/15	500,000,000.00	517,142,500.00	
ハンガリーフォリント小計		4,416,000,000.00	4,919,014,380.00 (2,202,734,639)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.2% 09/12/23	750,000.00	747,738.75	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	4,250,000.00	4,516,220.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	1,800,000.00	1,959,156.00	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	4,850,000.00	5,587,466.75	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,650,000.00	3,255,909.25	
	PERUGB 8.6% 08/12/17	1,150,000.00	1,304,514.00	
	PERUGB 9.91% 05/05/15	910,000.00	955,195.15	
ペルーヌエボソル小計		16,360,000.00	18,326,199.90 (669,456,082)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/16	6,350,000.00	6,122,892.25	
	POLGB 0% 07/25/15	1,500,000.00	1,464,652.50	
	POLGB 0% 07/25/16	1,500,000.00	1,428,427.50	
	POLGB 2.5% 07/25/18	8,750,000.00	8,650,512.50	
	POLGB 3.25% 07/25/19	1,300,000.00	1,319,012.50	
	POLGB 3.75% 04/25/18	7,300,000.00	7,560,683.00	
	POLGB 4% 10/25/23	10,100,000.00	10,593,839.50	
	POLGB 4.75% 04/25/17	8,400,000.00	8,890,140.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000.00	9,296,571.00	
	POLGB 5% 04/25/16	5,650,000.00	5,902,018.25	
	POLGB 5.25% 10/25/17	9,250,000.00	9,999,573.75	
	POLGB 5.25% 10/25/20	5,400,000.00	6,063,876.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	9,000,000.00	9,219,195.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	8,900,000.00	9,997,281.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,550,000.00	12,373,251.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	6,600,000.00	7,671,774.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	4,500,000.00	4,718,475.00	
ポーランドズロチ小計		113,900,000.00	121,272,174.75 (4,077,170,515)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	66,200,000.00	77,462,606.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	24,000,000.00	25,805,520.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	35,000,000.00	26,150,075.00	

	SAGB 6.5% 02/28/41	22,000,000.00	16,523,870.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	41,900,000.00	39,382,019.50	
	SAGB 7% 02/28/31	35,200,000.00	29,832,000.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	45,500,000.00	44,489,672.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	29,000,000.00	28,356,200.00	
	SAGB 8% 12/21/18	42,100,000.00	42,833,592.50	
	SAGB 8.25% 09/15/17	56,500,000.00	58,076,632.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	40,500,000.00	39,287,835.00	
	南アフリカランド小計	437,900,000.00	428,200,023.00 (4,076,464,218)	
ロシアルーブル	RFLB 6.8% 12/11/19	1,000,000.00	943,770.00	
	RFLB 6.9% 08/03/16	10,000,000.00	9,827,950.00	
	RFLB 7% 06/03/15	140,000,000.00	139,629,000.00	
	RFLB 7% 08/16/23	38,000,000.00	35,044,170.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	1,000,000.00	892,660.00	
	RFLB 7.4% 06/14/17	21,000,000.00	20,696,235.00	
	RFLB 7.5% 03/15/18	1,000,000.00	984,430.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	305,500,000.00	297,237,752.50	
	RFLB 7.6% 07/20/22	43,000,000.00	41,521,660.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	256,500,000.00	252,342,135.00	
	RUSSIA 7.85% 03/10/18	420,000,000.00	416,255,700.00	
	ロシアルーブル小計	1,237,000,000.00	1,215,375,462.50 (3,633,972,632)	
ナイジェリア ナイラ	NIGB 15.1% 04/27/17	499,000,000.00	541,424,980.00	
	NIGB 7% 10/23/19	689,000,000.00	570,436,880.00	
	ナイジェリアナイラ小計	1,188,000,000.00	1,111,861,860.00 (695,136,034)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,600,000.00	2,778,165.00	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	7,000,000.00	7,571,025.00	
	TURKGB 6.3% 02/14/18	7,050,000.00	6,627,423.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	12,200,000.00	10,897,955.00	
	TURKGB 8.3% 06/20/18	8,500,000.00	8,460,135.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	6,347,965.00	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	5,500,000.00	5,469,722.50	
	TURKGB 8.8% 11/14/18	9,500,000.00	9,593,860.00	
	TURKGB 9% 01/27/16	7,200,000.00	7,282,548.00	
	TURKGB 9% 03/08/17	13,150,000.00	13,385,911.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	5,400,000.00	5,573,664.00	
	トルコリラ小計	84,600,000.00	83,988,373.50 (4,033,961,579)	
	国債証券合計		40,100,301,052 (40,100,301,052)	

合計		40,100,301,052 (40,100,301,052)	
----	--	------------------------------------	--

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
マレーシアリングット	国債証券 26銘柄	100.0%	10.4%
タイバーツ	国債証券 12銘柄	100.0%	7.1%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.5%
インドネシアルピア	国債証券 22銘柄	100.0%	7.6%
メキシコペソ	国債証券 20銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルリアル	国債証券 13銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	5.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	5.5%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.7%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	10.2%
ロシアルーブル	国債証券 11銘柄	100.0%	9.1%
ナイジェリアナイラ	国債証券 2銘柄	100.0%	1.7%
トルコリラ	国債証券 11銘柄	100.0%	10.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	342,520,555
投資証券	28,580,001,690
派生商品評価勘定	9,947,100
未収入金	459,216,400
未収配当金	205,979,316
未収利息	444
差入委託証拠金	11,821,500
流動資産合計	29,609,487,005
資産合計	29,609,487,005
負債の部	
流動負債	
前受金	10,692,600
未払金	252,140,532
未払解約金	429,681,821
流動負債合計	692,514,953
負債合計	692,514,953
純資産の部	
元本等	
元本	22,536,630,858
剰余金	
剰余金又は欠損金()	6,380,341,194
元本等合計	28,916,972,052
純資産合計	28,916,972,052
負債純資産合計	29,609,487,005

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	13,901,728,523円
計算期間中の追加設定元本額	12,045,258,416円
計算期間中の一部解約元本額	3,410,356,081円
計算日の元本額	22,536,630,858円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	819,294,806円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,589,146円
SMT J-REITインデックス・オープン	6,000,917,235円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	11,941,429,517円
コア投資戦略ファンド(安定型)	902,791,182円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,958,965,643円
分散投資コア戦略ファンドA	258,467,435円
分散投資コア戦略ファンドS	295,117,795円
コア投資戦略ファンド(切替型)	249,265,831円
J-REITインデックス・オープン	100,792,268円

2. 計算日における受益権総数	22,536,630,858口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2831円 (12,831円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(リートの価格変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	2,312,394,698	
合計	2,312,394,698	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「J-REITインデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年11月12日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
投資証券関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買 建	326,699,400	-	336,646,500	9,947,100
	合計	326,699,400	-	336,646,500	9,947,100

(注)1. 時価の算定方法

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

- 2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,570	595,030,000	
	M I Dリート投資法人	625	150,000,000	
	森ヒルズリート投資法人	4,712	708,213,600	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	547	303,585,000	
	産業ファンド投資法人	563	508,952,000	
	大和ハウスリート投資法人	999	448,051,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,423	1,098,673,200	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	822	196,704,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	854	759,206,000	
	G L P投資法人	7,138	808,735,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	343	259,994,000	
	日本プロロジスリート投資法人	5,321	1,266,398,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	5,666	689,552,200	
	星野リゾート・リート投資法人	146	127,166,000	
	S I A不動産投資法人	256	108,800,000	
	イオンリート投資法人	3,233	434,515,200	
	ヒューリックリート投資法人	2,219	353,708,600	
	日本リート投資法人	517	133,075,800	
	日本ビルファンド投資法人	4,805	2,777,290,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,259	2,457,443,000	
	日本リテールファンド投資法人	7,854	1,777,360,200	
	オリックス不動産投資法人	6,690	937,938,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,807	1,004,906,000	
	プレミア投資法人	744	303,552,000	
	東急リアル・エステート投資法人	3,326	471,294,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	659	199,677,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,268	594,692,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	8,507	1,377,283,300	
	森トラスト総合リート投資法人	4,492	760,944,800	
	インヴィンシブル投資法人	5,353	138,267,990	
	フロンティア不動産投資法人	1,688	936,840,000	
	平和不動産リート投資法人	2,999	254,015,300	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,824	671,829,600		
福岡リート投資法人	2,348	414,187,200		
ケネディクス・オフィス投資法人	1,208	676,480,000		
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	3,114	319,807,800		

いちご不動産投資法人	3,492	243,043,200	
大和証券オフィス投資法人	1,487	717,477,500	
阪急リート投資法人	407	229,548,000	
スタートプロシード投資法人	493	87,113,100	
トップリート投資法人	599	269,550,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,272	606,744,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,919	487,869,300	
日本賃貸住宅投資法人	5,019	350,326,200	
ジャパンエクセレント投資法人	4,127	564,160,900	
投資証券 小計	130,714	28,580,001,690	
合計	130,714	28,580,001,690	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	305,722,225
コール・ローン	83,326,175
投資証券	34,534,546,580
未収入金	1
未収配当金	132,155,905
未収利息	108
流動資産合計	35,055,750,994

資産合計	35,055,750,994
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	165,889
未払解約金	373,467,546
流動負債合計	373,633,435
負債合計	373,633,435
純資産の部	
元本等	
元本	26,455,882,725
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,226,234,834
元本等合計	34,682,117,559
純資産合計	34,682,117,559
負債純資産合計	35,055,750,994

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	17,897,561,846円
計算期間中の追加設定元本額	11,880,443,122円
計算期間中の一部解約元本額	3,322,122,243円
計算日の元本額	26,455,882,725円
計算日の元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	481,282,541円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	818,424,190円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,354,369円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	6,289,031,924円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	15,219,609,159円
コア投資戦略ファンド(安定型)	889,680,297円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,929,576,768円
分散投資コア戦略ファンドA	253,292,171円
分散投資コア戦略ファンドS	291,556,446円
コア投資戦略ファンド(切替型)	258,443,929円
グローバルREITインデックス・オープン	15,630,931円
2. 計算日における受益権総数	26,455,882,725口
3. 1口当たり純資産額	1.3109円
(1万口当たり純資産額)	(13,109円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	<p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>
--------------------	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	2,861,308,871	
合計	2,861,308,871	

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年11月12日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
通貨関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	アメリカドル	60,940,800	-	60,936,000	4,800
	イギリスポンド	3,486,200	-	3,486,000	200
	ユーロ	8,315,988	-	8,315,400	588
	計	72,742,988	-	72,737,400	5,588
	売 建				
	アメリカドル	208,174,425	-	208,198,000	23,575
	オーストラリアドル	15,290,080	-	15,323,200	33,120
	イギリスポンド	12,177,340	-	12,201,700	24,360
	香港ドル	10,479,200	-	10,480,000	800
	シンガポールドル	7,351,020	-	7,368,300	17,280
	ユーロ	23,499,134	-	23,560,300	61,166
	計	276,971,199	-	277,131,500	160,301
合計	349,714,187	-	349,868,900	165,889	

(注) 時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	22,680.00	640,256.40	
		AGREE REALTY CORP	5,400.00	162,918.00	
		ALEXANDER'S INC	790.00	298,335.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,730.00	2,148,797.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,103.00	456,115.43	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	40,910.00	1,602,035.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,500.00	299,805.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	343,800.00	4,276,872.00	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	3,800.00	69,578.00	
		AMREIT INC	5,000.00	96,000.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	55,790.00	1,834,933.10	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	5,500.00	52,800.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	8,000.00	139,840.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	26,630.00	315,299.20	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	21,400.00	389,908.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	46,290.00	6,643,077.90	
		AVIV REIT INC	10,900.00	304,328.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	72,240.00	1,570,497.60	
		BOSTON PROPERTIES	58,130.00	6,895,961.90	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	59,070.00	911,450.10	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	28,840.00	669,664.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	32,880.00	2,349,933.60	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	20,800.00	180,128.00	
		CARETRUST REIT INC	7,400.00	140,600.00	
CBL & ASSOCIATES PRYS	65,260.00	1,261,475.80			

CEDAR REALTY TRUST INC	20,000.00	127,800.00	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	92,270.00	740,928.10	
CHATHAM LODGING TRUST	9,000.00	197,730.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	18,800.00	564,376.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	46,830.00	1,196,974.80	
COMMONWEALTH REIT	47,610.00	1,233,575.10	
CORESITE REALTY CORP	8,000.00	269,600.00	
CORPORATE OFFICE PPTYS	32,940.00	925,943.40	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	44,650.00	1,494,435.50	
COUSINS PROPERTIES INC	72,860.00	907,835.60	
CUBESMART	52,270.00	968,040.40	
CYRUSONE INC	13,900.00	339,577.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	125,780.00	1,016,302.40	
DDR CORPORATION	110,930.00	1,977,881.90	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	72,420.00	934,218.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	52,110.00	3,089,080.80	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	49,160.00	1,409,908.80	
DUKE REALTY CORP	125,240.00	2,249,310.40	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	23,600.00	628,940.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	11,540.00	742,252.80	
EDUCATION REALTY TRUST INC	55,000.00	592,350.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	27,400.00	456,484.00	
EPR PROPERTIES	20,440.00	1,138,916.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,650.00	1,309,937.00	
EQUITY ONE INC	24,240.00	578,366.40	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	127,460.00	8,105,181.40	
ESSEX PROPERTY TRUST	23,970.00	4,472,562.30	
EXCEL TRUST INC	24,570.00	320,638.50	
EXTRA SPACE STORAGE INC	42,350.00	2,243,279.50	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	25,740.00	3,161,386.80	
FELCOR LODGING TRUST INC	39,200.00	406,504.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	39,470.00	750,324.70	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	24,820.00	326,134.80	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	31,530.00	392,233.20	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	198,590.00	4,746,301.00	
GEO GROUP INC/THE	26,740.00	954,618.00	
GETTY REALTY CORP	11,500.00	218,270.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,800.00	86,112.00	
GLIMCHER REALTY TRUST	54,506.00	590,845.04	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	20,620.00	523,335.60	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	37,000.00	229,030.00	
HCP INC	174,010.00	7,191,833.30	

HEALTH CARE REIT INC	115,990.00	7,267,933.40	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	37,800.00	951,804.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	70,980.00	863,826.60	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	77,198.00	525,718.38	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	35,200.00	1,474,176.00	
HOME PROPERTIES INC	22,330.00	1,434,255.90	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	55,820.00	1,692,462.40	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	287,590.00	6,433,388.30	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	19,800.00	504,306.00	
INLAND REAL ESTATE CORP	32,600.00	345,560.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	38,200.00	336,924.00	
KILROY REALTY CORPORATION	30,900.00	1,916,727.00	
KIMCO REALTY CORP	155,050.00	3,587,857.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	48,534.00	313,529.64	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	38,960.00	1,394,378.40	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	77,000.00	851,620.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	56,790.00	2,126,785.50	
LTC PROPERTIES INC	14,000.00	545,020.00	
MACERICH CO/THE	53,140.00	3,557,191.60	
MACK-CALI REALTY CORP	33,720.00	716,212.80	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	68,100.00	885,981.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	28,180.00	2,059,676.20	
MONMOUTH REIT -CL A	21,500.00	219,515.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	47,880.00	1,795,021.20	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,600.00	717,344.00	
NEW YORK REIT INC	60,000.00	644,400.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	48,180.00	1,795,186.80	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,100.00	89,708.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	27,840.00	581,856.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,380.00	866,930.40	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	26,100.00	504,513.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	12,300.00	179,826.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,490.00	1,101,951.60	
POST PROPERTIES	20,750.00	1,118,840.00	
PROLOGIS INC	189,660.00	7,785,543.00	
PS BUSINESS PARKS INC	7,670.00	643,436.30	
PUBLIC STORAGE	54,960.00	9,373,428.00	
QTS REALTY TRUST INC	3,800.00	110,010.00	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	24,600.00	414,018.00	
REALTY INCOME CORP	85,030.00	3,811,044.60	
REGENCY CENTERS CORP	34,750.00	1,924,802.50	

	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	34,200.00	540,360.00	
	RETAIL PROPRTISE OF AME-A	68,700.00	1,071,033.00	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	4,500.00	63,720.00	
	RLJ LODGING TRUST	50,940.00	1,475,731.80	
	ROUSE PROPERTIES INC	13,100.00	229,774.00	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18,980.00	930,020.00	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	19,350.00	555,538.50	
	SAUL CENTERS INC	5,500.00	271,095.00	
	SELECT INCOME REIT	13,200.00	395,736.00	
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	76,850.00	1,840,557.50	
	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	14,100.00	227,010.00	
	SIMON PROPERTY GROUP	118,270.00	19,829,148.20	
	SL GREEN REALTY CORP	36,400.00	3,953,404.00	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	12,240.00	946,764.00	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	141,860.00	1,603,018.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	19,550.00	463,921.50	
	STARWOOD WAYPOINT RESIDE	15,600.00	412,308.00	
	STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	90,830.00	1,067,252.50	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31,500.00	336,105.00	
	SUN COMMUNITIES INC	14,860.00	749,984.20	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	79,240.00	1,175,129.20	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	36,010.00	1,265,391.40	
	TAUBMAN CENTERS INC	24,010.00	1,837,725.40	
	TERRENO REALTY CORP	12,400.00	236,592.00	
	UDR INC	95,290.00	2,702,424.40	
	UMH PROPERTIES INC	7,500.00	75,600.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,600.00	242,144.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	7,960.00	165,806.80	
	VENTAS INC	111,780.00	7,191,925.20	
	VORNADO REALTY TRUST	66,190.00	7,040,630.30	
	WASHINGTON PRIME GROUP	60,695.00	1,184,766.40	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	25,540.00	658,676.60	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	42,690.00	1,419,869.40	
	WHITESTONE REIT	7,600.00	114,836.00	
	WINTHROP REALTY TRUST	10,500.00	160,650.00	
	WP CAREY INC	22,910.00	1,476,320.40	
	アメリカドル小計	6,669,276.00	230,893,644.29 (23,451,867,450)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	12,780.00	438,481.80	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	26,100.00	403,506.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,760.00	633,521.60	

	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	6,587.00	179,232.27	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	25,220.00	654,963.40	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	20,500.00	468,425.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	12,336.00	554,749.92	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	32,300.00	342,703.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	15,300.00	162,180.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	23,730.00	443,513.70	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,200.00	188,292.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,300.00	127,238.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	17,294.00	163,947.12	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	7,600.00	73,264.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	19,770.00	575,307.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,800.00	351,560.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	52,400.00	1,206,772.00	
	HEALTHLEASE PROPERTIES REAL	3,600.00	38,412.00	
	INVEST REAL ESTATE INVESTME	17,200.00	90,472.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000.00	63,800.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	11,000.00	116,600.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	4,000.00	41,400.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	12,100.00	211,266.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	5,203.00	149,326.10	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	9,500.00	94,525.00	
	PLAZA RETAIL REIT	13,000.00	52,000.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	39,000.00	180,180.00	
	RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,650.00	62,107.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	57,980.00	1,550,965.00	
	カナダドル小計	513,210.00	9,618,710.41 (916,951,663)	
オーストラリア ドル	360 CAPITAL OFFICE FUND	22,000.00	43,780.00	
	ABACUS PROPERTY GROUP	118,150.00	293,012.00	
	ALE PROPERTY GROUP	67,500.00	199,125.00	
	ASPEN GROUP	26,259.00	32,429.86	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	24,000.00	99,120.00	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	177,200.00	792,084.00	
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	32,000.00	64,320.00	
	BWP TRUST	180,000.00	448,200.00	

	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	921,410.00	1,879,676.40	
	CHARTER HALL GROUP	104,500.00	436,810.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	114,010.00	443,498.90	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	527,200.00	519,292.00	
	DEXUS PROPERTY GROUP	2,092,580.00	2,375,078.30	
	FEDERATION CENTRES	532,820.00	1,316,065.40	
	GDI PROPERTY GROUP	167,000.00	155,310.00	
	GOODMAN GROUP	589,000.00	2,998,010.00	
	GPT GROUP	639,530.00	2,487,771.70	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	71,000.00	176,080.00	
	INDUSTRIA REIT	36,000.00	71,820.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	200,000.00	101,000.00	
	INVESTA OFFICE FUND	233,700.00	808,602.00	
	MIRVAC GROUP	1,402,700.00	2,496,806.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	77,000.00	103,180.00	
	SCENTRE GROUP	1,961,440.00	6,296,222.40	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	238,000.00	410,550.00	
	STOCKLAND	881,710.00	3,447,486.10	
	WESTFIELD CORP	730,820.00	5,349,602.40	
	オーストラリアドル小計	12,167,529.00	33,844,932.46 (3,241,667,631)	
イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	48,100.00	238,576.00	
	BRITISH LAND CO PLC	391,930.00	2,672,962.60	
	DERWENT LONDON PLC	32,210.00	850,344.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	127,700.00	803,871.50	
	HAMMERSON PLC	273,300.00	1,581,040.50	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	280,530.00	285,299.01	
	INTU PROPERTIES PLC	349,730.00	1,081,365.16	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	296,900.00	2,995,721.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	217,600.00	301,376.00	
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	19,000.00	80,750.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	33,240.00	114,511.80	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	309,000.00	158,517.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	70,000.00	151,200.00	
	SEGRO PLC	279,020.00	965,967.24	
	SHAFTESBURY PLC	104,320.00	671,820.80	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	86,000.00	90,945.00	
WORKSPACE GROUP PLC	42,000.00	240,660.00		
	イギリスポンド小計	2,960,580.00	13,284,927.61 (2,315,828,580)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,021,000.00	3,706,230.00	
	FORTUNE REIT	481,000.00	3,386,240.00	

	LINK REIT	880,000.00	36,828,000.00	
	PROSPERITY REIT	452,000.00	1,130,000.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	354,000.00	736,320.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	146,000.00	493,480.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	313,000.00	1,014,120.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	651,000.00	2,473,800.00	
	香港ドル小計	4,298,000.00	49,768,190.00 (652,460,970)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	199,000.00	287,555.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	253,000.00	191,015.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	792,266.00	1,814,289.14	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	293,000.00	369,180.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	305,000.00	372,100.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	390,000.00	296,400.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	853,000.00	1,407,450.00	
	CAPITAMALL TRUST	995,500.00	1,921,315.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	231,560.00	349,655.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	272,000.00	471,920.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	349,000.00	307,120.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	178,000.00	211,820.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	195,000.00	359,775.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	185,600.00	256,128.00	
	KEPPEL REIT	283,000.00	359,410.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	603,000.00	247,230.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	526,000.00	712,730.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	696,000.00	615,960.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	485,160.00	686,501.40	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	533,920.00	616,677.60	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	140,000.00	112,000.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	120,000.00	290,400.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	218,000.00	227,810.00	
SAIZEN REIT	80,000.00	76,000.00		
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	263,000.00	210,400.00		
STARHILL GLOBAL REIT	539,000.00	450,065.00		
SUNTEC REIT	935,000.00	1,673,650.00		
	シンガポールドル小計	10,914,006.00	14,894,556.74 (1,219,566,305)	
ニュージーランドドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	104,159.00	170,299.96	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	381,000.00	409,575.00	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	397,000.00	468,460.00	

	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	162,000.00	217,080.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	95,800.00	131,725.00	
	ニュージーランドドル小計	1,139,959.00	1,397,139.96 (125,281,540)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	40,000.00	362,080.00	
	イスラエルシェケル小計	40,000.00	362,080.00 (10,728,430)	
ユーロ	AEDIFICA	3,648.00	187,142.40	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	28,100.00	270,350.10	
	ALTAREA	1,270.00	177,800.00	
	ANF IMMOBILIER	3,270.00	76,845.00	
	BEFIMMO S.C.A.	6,630.00	377,644.80	
	BENI STABILI SPA	312,000.00	204,984.00	
	COFINIMMO	6,250.00	569,437.50	
	CORIO NV	38,090.00	1,391,046.80	
	EUROBANK PROPERTIES REAL ESTATE	10,000.00	88,800.00	
	EUROCOMMERCIAL	13,900.00	502,276.50	
	FONCIERE DES REGIONS	16,980.00	1,344,306.60	
	GECINA SA	10,200.00	1,078,650.00	
	GREEN REIT PLC	262,000.00	330,906.00	
	HAMBORNER REIT AG	17,200.00	136,533.60	
	HIBERNIA REIT PLC	150,000.00	166,500.00	
	ICADE	12,910.00	986,453.10	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	52,169.00	63,854.85	
	KLEPIERRE	37,050.00	1,376,407.50	
	MERCIALYS	21,900.00	365,401.50	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	41,400.00	196,525.80	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	1,780.00	103,489.20	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	37,040.00	7,665,428.00	
	VASTNED RETAIL	7,340.00	277,782.30	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,350.00	242,077.50	
	WERELDHAVE NV	8,550.00	579,775.50	
	ユーロ小計	1,104,027.00	18,760,418.55 (2,600,194,011)	
	投資証券合計		34,534,546,580 (34,534,546,580)	
	合計		34,534,546,580 (34,534,546,580)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 144銘柄	100.0%	67.9%
カナダドル	投資証券 29銘柄	100.0%	2.7%
オーストラリアドル	投資証券 27銘柄	100.0%	9.4%
イギリスポンド	投資証券 17銘柄	100.0%	6.7%
香港ドル	投資証券 8銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 27銘柄	100.0%	3.5%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
ユーロ	投資証券 25銘柄	100.0%	7.5%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	245,641,895
コール・ローン	243,514,341

社債券	13,454,073,419
派生商品評価勘定	22,649
未収利息	315
流動資産合計	13,943,252,619
資産合計	13,943,252,619
負債の部	
流動負債	
未払金	201,015,377
未払解約金	30,000
流動負債合計	201,045,377
負債合計	201,045,377
純資産の部	
元本等	
元本	29,543,676,863
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,801,469,621
元本等合計	13,742,207,242
純資産合計	13,742,207,242
負債純資産合計	13,943,252,619

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p> <p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
---	---

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
<p>1. 計算期間の期首元本額</p> <p>計算期間中の追加設定元本額</p> <p>計算期間中の一部解約元本額</p> <p>計算日の元本額</p>	<p>15,958,419,477円</p> <p>16,424,069,526円</p> <p>2,838,812,140円</p> <p>29,543,676,863円</p>
<p>計算日の元本額の内訳</p> <p>コモディティ・オープン(SMA専用)</p> <p>コア投資戦略ファンド(安定型)</p> <p>コア投資戦略ファンド(成長型)</p> <p>分散投資コア戦略ファンドA</p> <p>分散投資コア戦略ファンドS</p> <p>コア投資戦略ファンド(切替型)</p> <p>SMTAMコモディティ・オープン</p> <p>コモディティ・オープン</p>	<p>24,596,993,853円</p> <p>1,181,815,438円</p> <p>2,570,482,425円</p> <p>340,079,302円</p> <p>387,963,017円</p> <p>328,324,107円</p> <p>76,796,697円</p> <p>61,222,024円</p>
<p>2. 計算日における受益権総数</p> <p>3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額</p>	<p>29,543,676,863口</p> <p>元本の欠損</p> <p>15,801,469,621円</p>
<p>4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)</p>	<p>0.4651円 (4,651円)</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(商品(コモディティ)の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)社債券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券	425,125,931	
合計	425,125,931	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成26年5月27日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
通貨関連

区分	種類	平成26年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建				
	アメリカドル	200,000,000	-	200,022,649	22,649
	計	200,000,000	-	200,022,649	22,649
合計		200,000,000	-	200,022,649	22,649

(注)時価の算定方法

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

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

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

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 024 07/25/14	10,000,000.00	10,187,000.00	
		BAR USD COM 025 08/29/14	8,500,000.00	8,596,900.00	
		BAR USD COM 026 11/28/14	10,000,000.00	10,453,000.00	
		BAR USD COM 027 03/27/15	5,000,000.00	4,779,900.00	
		BAR USD COM 028 05/29/15	6,000,000.00	5,802,720.00	
		CS USD COM 005 08/11/14	11,000,000.00	11,467,500.00	
		CS USD COM 006 10/24/14	15,000,000.00	15,433,500.00	
		CS USD COM 007 05/29/15	5,000,000.00	4,904,000.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	178,070,000.00	24,057,257.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	11,180,000.00	4,305,418.00	
		UBS USD COM 004 08/11/14	13,000,000.00	13,577,200.00	
		UBS USD COM 005 11/05/14	10,000,000.00	10,335,000.00	
		UBS USD COM 006 04/30/15	9,000,000.00	8,561,700.00	
	アメリカドル小計		291,750,000.00	132,461,095.00 (13,454,073,419)	
	社債券合計			13,454,073,419 (13,454,073,419)	
	合計			13,454,073,419 (13,454,073,419)	

(注) 有価証券明細表注記

(1) 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2) 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3) 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4) 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 13銘柄	100.0%	100.0%

(注) 組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

「FRM シグマ リンク マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	613,474,884
社債券	8,893,044,200
未収利息	796
流動資産合計	9,506,519,880
資産合計	9,506,519,880
負債の部	
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	10,641,147,645
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,134,627,765
元本等合計	9,506,519,880
純資産合計	9,506,519,880
負債純資産合計	9,506,519,880

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
--	---------------

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額 計算期間中の追加設定元本額 計算期間中の一部解約元本額 計算日の元本額	4,054,411,391円 8,777,870,975円 2,191,134,721円 10,641,147,645円
計算日の元本額の内訳 コア投資戦略ファンド(安定型) コア投資戦略ファンド(成長型) 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 コア投資戦略ファンド(切替型)	4,538,059,385円 3,803,935,818円 1,248,463,385円 571,364,027円 479,325,030円
2. 計算日における受益権総数	10,641,147,645口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,134,627,765円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8934円 (8,934円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク、先物取引を利用した運用手法に係るリスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありせん。
2. 時価の算定方法	<p>(1)社債券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券	185,328,450	
合計	185,328,450	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「FRM シグマ リンク マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年11月26日から平成26年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在	
該当事項はありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 7月10日現在

該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成26年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	QUART X 0% 03/31/22	10,055,000,000	8,893,044,200	
	社債券 小計	10,055,000,000	8,893,044,200	
	合計	10,055,000,000	8,893,044,200	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成26年7月31日現在）

分散投資コア戦略ファンドA

資産総額	16,979,389,717 円
負債総額	58,046,614 円
純資産総額(-)	16,921,343,103 円
発行済口数	16,496,115,857 口
1口当たり純資産額(/)	1.0258 円
1万口当たり純資産額	10,258 円

分散投資コア戦略ファンドS

資産総額	10,919,711,408 円
負債総額	166,122,084 円
純資産総額(-)	10,753,589,324 円
発行済口数	10,223,279,231 口
1口当たり純資産額(/)	1.0519 円
1万口当たり純資産額	10,519 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	41,426,522,442 円
負債総額	2,538,788,884 円
純資産総額(-)	38,887,733,558 円
発行済口数	27,791,775,978 口
1口当たり純資産額(/)	1.3993 円
1万口当たり純資産額	13,993 円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	271,290,967,274 円
負債総額	4,691,538,560 円
純資産総額(-)	266,599,428,714 円
発行済口数	205,539,757,552 口
1口当たり純資産額(/)	1.2971 円
1万口当たり純資産額	12,971 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	177,776,755,753 円
負債総額	296,630,057 円

純資産総額(-)	177,480,125,696 円
発行済口数	101,581,690,517 口
1口当たり純資産額(/)	1.7472 円
1万口当たり純資産額	17,472 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	234,778,489,367 円
負債総額	604,247,339 円
純資産総額(-)	234,174,242,028 円
発行済口数	92,195,224,518 口
1口当たり純資産額(/)	2.5400 円
1万口当たり純資産額	25,400 円

新興国株式インデックス マザーファンド

資産総額	29,581,370,186 円
負債総額	12,795,444 円
純資産総額(-)	29,568,574,742 円
発行済口数	12,173,338,232 口
1口当たり純資産額(/)	2.4290 円
1万口当たり純資産額	24,290 円

新興国債券インデックス マザーファンド

資産総額	43,347,536,073 円
負債総額	230,703,013 円
純資産総額(-)	43,116,833,060 円
発行済口数	25,402,936,813 口
1口当たり純資産額(/)	1.6973 円
1万口当たり純資産額	16,973 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	31,322,533,221 円
負債総額	442,105,079 円
純資産総額(-)	30,880,428,142 円
発行済口数	23,606,145,986 口
1口当たり純資産額(/)	1.3082 円
1万口当たり純資産額	13,082 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	37,572,894,195 円
負債総額	360,538,419 円
純資産総額(-)	37,212,355,776 円
発行済口数	27,718,149,602 口
1口当たり純資産額(/)	1.3425 円
1万口当たり純資産額	13,425 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	17,444,576,176 円
負債総額	2,347,302,455 円
純資産総額(-)	15,097,273,721 円
発行済口数	32,886,177,458 口
1口当たり純資産額(/)	0.4591 円
1万口当たり純資産額	4,591 円

FRM シグマ リンク マザーファンド

資産総額	6,746,615,702 円
負債総額	円
純資産総額(-)	6,746,615,702 円
発行済口数	7,391,428,627 口
1口当たり純資産額(/)	0.9128 円
1万口当たり純資産額	9,128 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成26年 7月31日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の経路を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

[DO（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

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

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

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した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10月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。

また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成26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	379	5,192,634
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	1	2,714
単位型公社債投資信託	0	0
合計	380	5,195,348

3【委託会社等の経理状況】

(1)委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「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）に基づいて作成しております。

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

(2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成25年4月1日至平成26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。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	8,192,444	10,457,599
前払費用	81,751	114,325
未収委託者報酬	2,210,605	2,735,763
未収運用受託報酬	31,051	15,268
未収入金	676	-
繰延税金資産	61,743	144,183
その他	19,263	3,448
流動資産合計	10,597,535	13,470,589
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 79,281	1 67,359
器具備品	1 103,209	1 87,378
有形固定資産合計	182,491	154,737
無形固定資産		
ソフトウェア	168,561	203,360
その他	1,770	4,686
無形固定資産合計	170,332	208,046
投資その他の資産		
投資有価証券	47,112	69,583
長期前払費用	-	34,773
長期貸付金	31,838	28,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	-	117,743
その他	633	553
貸倒引当金	31,838	28,838
投資その他の資産合計	72,746	247,653
固定資産合計	425,570	610,437
資産合計	11,023,105	14,081,027

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	19,992	13,353
未払金	1,459,757	1,723,999
未払手数料	942,503	1,169,997
その他未払金	517,254	554,001
未払費用	82,209	44,167
未払法人税等	204,363	1,467,469

未払消費税等	11,940	129,007
賞与引当金	92,832	94,659
その他	21,231	14,376
流動負債合計	1,892,326	3,487,033
固定負債		
資産除去債務	12,281	12,492
退職給付引当金	268,531	313,992
繰延税金負債	303,555	-
固定負債合計	584,368	326,485
負債合計	2,476,694	3,813,518
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	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	59,500	62,500
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	5,731,912	7,452,293
利益剰余金合計	7,891,412	9,614,793
株主資本合計	8,541,412	10,264,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	4,998	2,715
評価・換算差額等合計	4,998	2,715
純資産合計	8,546,410	10,267,508
負債・純資産合計	11,023,105	14,081,027

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	19,128,296	22,773,831
運用受託報酬	94,659	55,511
営業収益合計	19,222,955	22,829,342
営業費用		
支払手数料	9,030,246	10,451,296
広告宣伝費	73,287	76,961
公告費	2,244	-
調査費	4,132,154	5,091,105
調査費	207,030	259,236
委託調査費	3,922,394	4,830,390
図書費	2,729	1,479

営業雑経費	1,294,879		1,264,334
通信費	21,905		17,246
印刷費	330,735		327,214
協会費	21,939		22,524
諸会費	757		773
情報機器関連費	874,151		837,859
その他営業雑経費	45,391		58,716
営業費用合計	14,532,812		16,883,698
一般管理費			
給料	2,259,238		2,201,964
役員報酬	78,205		102,330
給料・手当	1,967,177		1,846,450
賞与	213,855		253,183
退職給付費用	64,787		72,029
役員退職慰労金	-		1,070
福利費	190,716		207,122
交際費	879		2,758
旅費交通費	45,160		45,973
租税公課	25,420		42,862
不動産賃借料	129,096		130,938
寄付金	-		3,385
減価償却費	129,966		119,445
諸経費	1	1	219,615
一般管理費合計	3,103,213		3,047,165
営業利益	1,586,929		2,898,479

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,919	-
受取利息	6,475	7,464
収益分配金	-	3,234
投資有価証券売却益	924	553
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	2,552	1,775
営業外収益合計	14,873	16,027
営業外費用		
長期前払費用償却	-	1 23,222
支払補償費	-	14,648
投資有価証券売却損	14,182	284
その他	361	2,112
営業外費用合計	14,544	40,268
経常利益	1,587,257	2,874,238
特別利益		
投資有価証券売却益	30,000	-
特別利益合計	30,000	-

特別損失

統合関連損失	484,725	-
特別損失合計	484,725	-
税引前当期純利益	1,132,532	2,874,238
法人税、住民税及び事業税	369,828	1,623,332
法人税等調整額	56,358	502,474
法人税等合計	426,187	1,120,857
当期純利益	706,344	1,753,381

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	-	-
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
合併による増加		350,000	350,000
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	350,000	350,000
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	56,500	2,100,000	2,516,273	4,672,773	4,972,773
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			706,344	706,344	706,344
合併による増加			2,542,294	2,542,294	2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,215,638	3,218,638	3,568,638
当期末残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859	9,859	4,962,913
当期変動額			
剰余金の配当			30,000

当期純利益			706,344
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）	14,857	14,857	14,857
当期変動額合計	14,857	14,857	3,583,496
当期末残高	4,998	4,998	8,546,410

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381
当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

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。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

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25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
建 物	23,594	千円	35,517	千円
器具備品	235,212	"	188,630	"
計	258,807	"	224,147	"

(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24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
諸経費	97,199	千円	73,276	千円
長期前払費用償却	-	"	23,222	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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

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26年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30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 その他有価証券	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。

当事業年度（平成26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	10,457,599	10,457,599	-
(2) 未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	69,583	69,583	-
(4) 未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
(5) 未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

(*) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（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	-	-	-

当事業年度（平成26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	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	61,633	57,226	4,406
小計	61,633	57,226	4,406
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	7,950	8,138	188
小計	7,950	8,138	188
合計	69,583	65,365	4,218

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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
23,757	553	284

(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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(1) 退職給付債務	268,531	313,992
(2) 退職給付引当金	268,531	313,992

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位:千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(1) 退職給付費用	64,787	72,029

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	16,142 千円	102,368 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	11,347 "	10,277 "
賞与引当金損金算入限度超過額	35,285 "	33,736 "

			有価証券届出書（内国投資信託受益証券）	
退職給付引当金損金算入限度超過額	95,704	"	111,906	"
減価償却超過額	1,067	"	-	"
その他	11,680	"	13,094	"
繰延税金資産 小計	171,228	"	271,384	"
評価性引当額	11,347	"	-	"
繰延税金資産 合計	159,881	"	271,384	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	2,767	"	1,503	"
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925	"	7,953	"
繰延税金負債 合計	401,693	"	9,457	"
繰延税金資産（負債）の純額	241,812	"	261,926	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」（平成26年政令第151号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が9,649千円減少し、当事業年度に費用計上された法人税等の金額が9,649千円増加しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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・レアルコース）	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いません。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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・レアルコース）	3,172,592千円

（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
おりません。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（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 の所有 （被所有） 割合（%）	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディング ス㈱	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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又 は出資金 （百万円）	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 （被所有） 割合（%）	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディング ス㈱	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	73,276	-	-

（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 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟 会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上の 取引 役員の 兼任	投信販売 代行手数料等 の支払	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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟 会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上の 取引 役員の 兼任	投信販売 代行手数料等 の支払	6,745,672	未払手数料	794,830
							投資助言費用 の支払	2,631,233	その他 未払金	239,120

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成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）

当事業年度（平成26年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(企業結合等関係)

前事業年度（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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49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金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成26年10月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成26年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成26年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (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26年 6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川 芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

佐藤智治

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの平成25年7月11日から平成26年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドAの平成26年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- 1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤智治 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの平成25年7月11日から平成26年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドSの平成26年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- 1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。