

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年2月2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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成26年10月10日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前>及び<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新・訂正後>に記載している内容は、当該内容にて原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」及び「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」は原届出書の更新後の内容です。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

< 訂正前 >

(前略)

委託会社の概況（平成26年 7月31日現在）

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

委託会社の概況（平成26年11月28日現在）

(後略)

2 投資方針

(2) 投資対象

(参考) 投資対象ファンドの概要を以下の内容に更新・訂正します。

< 更新・訂正後 >

(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27年2月2日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、約款変更等により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ことで機動的に行います。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。</p> <p>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。</p> <p>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	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0756%（税抜 年0.07%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年2月3日
信託期間	原則として平成26年2月3日から平成35年10月20日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

JPX日経インデックス400とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開

発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。「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.FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本株配当マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式の中から、予想配当利回りが比較的高いと判断される銘柄及び配当増が予想される銘柄群に投資します。</p> <p>株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年2月2日
信託期間	原則として平成27年2月2日から平成37年4月10日
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

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

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</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>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	東証株価指数（TOPIX）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<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（評価益を含みます。）等の全額とします。</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します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.3672%（税抜 年0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年1月30日
信託期間	平成27年1月30日から平成37年2月17日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「東証株価指数（TOPIX）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

5. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、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（）」といいます。）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> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
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。

6.FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	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。 債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。 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。 外貨建資産への投資は行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成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

7. 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> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（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。

8. 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> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	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。

9.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。

10.FOFs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）

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

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
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

11. 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	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
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て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。

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	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の現地通貨建債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、債券の時価総額や流動性等を勘案し、各国への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の現地通貨建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の現地通貨建債券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
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

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ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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券、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p>
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。 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います。
主要投資対象	インデックス マザーファンドMLP受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券
投資態度	主として、インデックス マザーファンドMLP受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券に投資を行ない、別に定めるMLP市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。運用にあたって、対象指数に採用されていないMLP等についても、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は投資を行ないます。また、対象指数に採用されているMLP等の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合があります。 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。 <別に定めるMLP市場の動きをとらえる指数（平成27年2月2日現在）> S&P MLP 指数（円換算ベース）
主な投資制限	株式：制限なし 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 外貨建資産：制限なし デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	S&P MLP 指数（円換算ベース）（平成27年2月2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	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。 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わないこともある。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行なう。
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	<p>主として米ドル建のバンクローンに投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築は、個別銘柄の信用力、割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。</p> <p>米ドル建以外の資産に投資した場合、当該資産については原則として対米ドルでの為替予約取引等を行いません。</p> <p>米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。</p>
主な投資制限	<p>第一順位担保権付のバンクローンへの投資割合は、投資信託財産の純資産総額の80%以上とします。</p> <p>組入比率上位3業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の15%を上限とします。その他の業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の12%を上限とします。</p> <p>組入比率上位10銘柄への投資割合の合計は、投資信託財産の純資産総額の20%を上限とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
ベンチマーク	クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。

信託報酬	<p>年率0.65%</p> <p>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、受託会社・管理事務代行会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。</p> <p>この他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年10月2日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・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、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（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	BNP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）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI総合指数（HFRI Weighted Composite Index）（ ）を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。</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）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。</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と及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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、投資適格未満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、投資適格未満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.

4 手数料等及び税金

(3) 信託報酬等

(参考)各投資対象ファンドの信託報酬等を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

(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%）
FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
F O F s 用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.3672% （税抜 0.34%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
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。
F O F s 用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）	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）

（５）課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

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

（後略）

<訂正後>

（前略）

上記は、平成26年11月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

5 運用状況

以下は、平成26年11月28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	9,544,910,864	49.18
	ケイマン	1,379,612,076	7.11
	小計	10,924,522,940	56.29
投資証券	ルクセンブルク	2,274,365,912	11.72
親投資信託受益証券	日本	6,095,091,492	31.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		113,396,939	0.58
合計(純資産総額)		19,407,377,283	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資信託受益 証券	FOfs用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)	2,185,722,569	1.021	2,231,774,747	1.0161	2,220,912,702	11.44
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)	1,448,128,640	1.0548	1,527,611,654	1.061	1,536,464,487	7.92
ルクセン ブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies A, H, JPY Fund-Class D	818,232.032	1,804.28	1,476,324,418	1,868	1,528,457,435	7.88
日本	親投資信託受 益証券	国内債券インデックス マザーファ ンド	1,052,604,028	1.2960	1,364,186,004	1.3159	1,385,121,640	7.14
ケイマン	投資信託受益 証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	1,330,777.8521	1,032.33	1,373,803,658	1,036.69	1,379,612,076	7.11
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	628,985,824	1.7650	1,110,180,084	2.0358	1,280,489,340	6.60
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	402,576,593	2.5344	1,020,318,595	2.8845	1,161,232,182	5.98
日本	投資信託受益 証券	FOfs用世界ハイインカム入替戦略 ファンド 為替ヘッジあり(適格機関 投資家専用)	1,082,245,919	1.0004	1,082,739,056	1.011	1,094,150,624	5.64
日本	投資信託受益 証券	FOfs用新興国債券セレクトファンド (適格機関投資家専用)	1,017,168,788	1.0264	1,044,033,967	1.0615	1,079,724,668	5.56
日本	親投資信託受 益証券	F R Mシグマ リンク マザーファ ンド	794,547,024	0.8986	714,031,375	1.0249	814,331,244	4.20
日本	投資信託受益 証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	745,430,722	0.985	734,314,456	1.0124	754,674,062	3.89
ルクセン ブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	75,099.043	9,981.15	749,574,813	9,932.33	745,908,477	3.84
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)	645,239,520	1.0479	676,161,864	1.0826	698,536,304	3.60
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)	476,012,938	1.0869	517,394,679	1.1908	566,836,206	2.92
日本	親投資信託受 益証券	A R T テクニカル運用日本株式 マザーファンド	396,719,613	1.3884	550,844,372	1.3904	551,598,949	2.84
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)	522,315,764	1.0179	531,675,764	1.0245	535,112,500	2.76
日本	投資信託受益 証券	FOfs用新興国株式セレクトファンド (適格機関投資家専用)	461,309,835	1.0138	467,699,725	1.0932	504,303,911	2.60
日本	親投資信託受 益証券	J - R E I Tインデックス マザー ファンド	287,281,096	1.2898	370,562,327	1.4941	429,226,685	2.21

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)	420,657,011	0.9709	408,420,494	0.9918	417,207,623	2.15
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	180,577,031	1.3169	237,805,645	1.6008	289,067,711	1.49
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	382,824,510	0.4635	177,442,737	0.4807	184,023,741	0.95
日本	投資信託受益証券	FOFs用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）	126,641,192	0.9754	123,533,635	1.0817	136,987,777	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	56.29
投資証券	11.72
親投資信託受益証券	31.41
合計	99.42

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (平成25年7月10日)	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
8月末日	17,222,861,347		10,303
9月末日	17,266,335,714		10,337
10月末日	18,778,518,821		10,298
11月末日	19,407,377,283		10,651

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1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

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	6,977,023,299	44.75
	ケイマン	551,476,863	3.54
	小計	7,528,500,162	48.29
投資証券	ルクセンブルク	1,338,618,253	8.59
親投資信託受益証券	日本	6,627,281,871	42.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		97,151,841	0.62
合計(純資産総額)		15,591,552,127	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	825,542,215	1.7669	1,458,677,639	2.0358	1,680,638,841	10.78
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	510,908,869	2.5541	1,304,914,357	2.8845	1,473,716,632	9.45
日本	投資信託受益証券	FOFs用新興国債券セレクトファンド (適格機関投資家専用)	1,343,566,558	1.0262	1,378,865,641	1.0615	1,426,195,901	9.15
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)	1,284,290,775	1.0221	1,312,745,205	1.0161	1,304,967,856	8.37
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)	806,628,906	1.1059	892,120,640	1.1908	960,533,701	6.16
日本	親投資信託受益証券	A R T テクニカル運用日本株式 マザーファンド	666,653,231	1.3890	926,047,633	1.3904	926,914,652	5.94
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)	853,143,779	1.0521	897,674,033	1.061	905,185,549	5.81
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies A, H, JPY Fund-Class D	482,096.603	1,812.66	873,878,957	1,868	900,556,454	5.78
日本	親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザー ファンド	446,497,728	1.3023	581,498,507	1.4941	667,112,255	4.28
日本	投資信託受益証券	FOFs用新興国株式セレクトファンド (適格機関投資家専用)	600,531,426	1.018	611,360,150	1.0932	656,500,954	4.21

日本	親投資信託受益証券	グローバル E I T インデックス マザーファンド	359,000,537	1.3269	476,388,121	1.6008	574,688,059	3.69
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	531,956.1988	1,031.76	548,851,920	1,036.69	551,476,863	3.54
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	404,941,307	1.2974	525,378,647	1.3159	532,862,265	3.42
日本	親投資信託受益証券	F R M シグマ リンク マザーファ ンド	468,428,167	0.9087	425,664,304	1.0249	480,092,028	3.08
日本	投資信託受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	439,156,553	0.9871	433,493,562	1.0124	444,602,094	2.85
日本	投資信託受益証券	F0Fs用世界ハイインカム入替戦略 ファンド 為替ヘッジあり(適格機関 投資家専用)	435,733,697	1.0004	435,931,223	1.011	440,526,767	2.83
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	44,104.636	9,978.36	440,091,935	9,932.33	438,061,799	2.81
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	605,902,100	0.4606	279,086,390	0.4807	291,257,139	1.87
日本	投資信託受益証券	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)	260,280,248	1.0518	273,763,445	1.0826	281,779,396	1.81
日本	投資信託受益証券	F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適 格機関投資家専用)	192,657,760	1.0176	196,063,238	1.0245	197,377,875	1.27
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 M L P インデックスファ ンド(適格機関投資家専用)	177,316,586	0.9754	172,970,498	1.0817	191,803,351	1.23
日本	投資信託受益証券	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)	168,935,124	0.9713	164,094,406	0.9918	167,549,855	1.07

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	48.29
投資証券	8.59
親投資信託受益証券	42.51
合計	99.38

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 （平成25年 7月10日）	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	
8月末日	11,604,641,476		10,573	
9月末日	11,740,509,229		10,647	
10月末日	14,944,585,320		10,601	
11月末日	15,591,552,127		11,122	

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1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

A R T テクニカル運用日本株式 マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	25,927,608,100	55.98
国債証券	日本	15,002,666,000	32.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,384,845,755	11.63
合計(純資産総額)		46,315,119,855	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第460回国庫短期証券		7,000,000,000	100.02	7,001,582,000	100.02	7,001,428,000		2015/6/22	15.12
日本	国債証券	第474回国庫短期証券		4,000,000,000	100.02	4,001,164,000	100.02	4,001,056,000		2015/8/20	8.64
日本	国債証券	第438回国庫短期証券		2,000,000,000	100.01	2,000,204,000	100.00	2,000,188,000		2015/3/20	4.32
日本	国債証券	第419回国庫短期証券		2,000,000,000	99.99	1,999,994,000	99.99	1,999,994,000		2014/12/22	4.32
日本	株式	川崎汽船	海運業	2,305,000	297.00	684,585,000	311.00	716,855,000			1.55
日本	株式	ソニー	電気機器	245,300	2,582.50	633,487,250	2,600.00	637,780,000			1.38

日本	株式	横浜ゴム	ゴム製品	580,000	1,053.00	610,740,000	1,092.00	633,360,000			1.37
日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	232,300	2,643.00	613,968,900	2,677.50	621,983,250			1.34
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	1,189,000	520.40	618,758,000	522.00	620,658,000			1.34
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	84,200	7,190.00	605,398,000	7,314.00	615,838,800			1.33
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	158,100	3,907.50	617,775,750	3,880.50	613,507,050			1.32
日本	株式	J・フロントリテイリング	小売業	401,000	1,524.00	611,124,000	1,521.00	609,921,000			1.32
日本	株式	信越化学工業	化学	76,000	7,909.78	601,143,728	7,990.00	607,240,000			1.31
日本	株式	デンソー	輸送用機器	107,400	5,496.00	590,270,400	5,543.00	595,318,200			1.29
日本	株式	中部電力	電気・ガス業	422,100	1,394.00	588,407,400	1,388.00	585,874,800			1.26
日本	株式	SUMCO	金属製品	385,200	1,486.21	572,489,054	1,513.00	582,807,600			1.26
日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	899,000	636.70	572,393,300	647.20	581,832,800			1.26
日本	株式	平和不動産	不動産業	305,100	1,838.00	560,773,800	1,803.00	550,095,300			1.19
日本	株式	住友化学	化学	1,072,000	432.00	463,104,000	449.00	481,328,000			1.04
日本	株式	三菱電機	電気機器	480,700	982.00	472,047,400	986.00	473,970,200			1.02
日本	株式	日本郵船	海運業	1,410,000	317.00	446,970,000	335.00	472,350,000			1.02
日本	株式	ジェイ・エフ・イーホールディングス	鉄鋼	186,400	2,494.00	464,881,600	2,525.50	470,753,200			1.02
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	674,500	680.50	458,997,250	686.40	462,976,800			1.00
日本	株式	昭和電工	化学	2,789,000	161.00	449,029,000	164.00	457,396,000			0.99
日本	株式	神戸製鋼所	鉄鋼	2,391,000	188.00	449,508,000	189.00	451,899,000			0.98
日本	株式	北越紀州製紙	パルプ・紙	916,300	496.00	454,484,800	488.00	447,154,400			0.97
日本	株式	クボタ	機械	241,000	1,797.50	433,197,500	1,855.00	447,055,000			0.97
日本	株式	電通	サービス業	100,000	4,375.00	437,500,000	4,460.00	446,000,000			0.96
日本	株式	日本通運	陸運業	781,000	569.00	444,389,000	570.00	445,170,000			0.96
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	108,800	3,973.80	432,350,396	4,079.50	443,849,600			0.96

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.35
		建設業	0.72
		食料品	2.02
		繊維製品	0.74
		パルプ・紙	0.97

	化学	4.96
	ゴム製品	2.33
	ガラス・土石製品	1.78
	鉄鋼	1.99
	非鉄金属	0.94
	金属製品	1.26
	機械	2.59
	電気機器	3.47
	輸送用機器	4.68
	精密機器	0.96
	電気・ガス業	2.88
	陸運業	4.29
	海運業	2.57
	倉庫・運輸関連業	0.36
	情報・通信業	2.11
	卸売業	0.90
	小売業	3.16
	銀行業	5.30
	保険業	1.67
	不動産業	2.05
	サービス業	0.96
	小計	55.98
国債証券		32.39
合計		88.37

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

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	232,625,475,300	79.33
	ポーランド	201,518,000	0.07
	メキシコ	100,557,000	0.03
	小計	232,927,550,300	79.43

地方債証券	日本	18,289,176,096	6.24
特殊債券	日本	24,383,949,358	8.32
	アメリカ	210,266,000	0.07
	スウェーデン	100,798,000	0.03
	韓国	100,468,000	0.03
	小計	24,795,481,358	8.46
社債券	日本	14,698,727,980	5.01
	アメリカ	506,920,000	0.17
	オーストラリア	303,878,000	0.10
	オランダ	204,086,000	0.07
	スウェーデン	202,555,000	0.07
	イギリス	100,927,000	0.03
	フランス	100,169,000	0.03
小計	16,117,262,980	5.50	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,118,767,029	0.38
合計(純資産総額)		293,248,237,763	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,150,000,000	100.62	4,176,085,200	100.95	4,189,674,000	0.300	2018/6/20	1.43
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,810,000,000	100.20	3,817,819,700	100.52	3,829,812,000	0.200	2019/6/20	1.31
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	3,770,000,000	100.29	3,781,081,800	100.47	3,787,982,900	0.200	2019/9/20	1.29
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,670,000,000	100.11	3,674,302,400	100.55	3,690,405,200	0.200	2019/3/20	1.26
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	100.29	3,510,321,500	100.48	3,516,905,000	0.200	2017/6/20	1.20
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,220,000,000	100.16	3,225,450,600	100.58	3,238,837,000	0.200	2018/12/20	1.10
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	102.14	3,064,440,000	0.600	2023/12/20	1.04
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,910,000,000	103.00	2,997,331,300	104.16	3,031,288,800	0.800	2022/9/20	1.03
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	3,000,000,000	100.63	3,019,155,000	100.61	3,018,330,000	0.400	2016/6/20	1.03
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,950,000,000	100.68	2,970,090,300	101.93	3,007,023,500	0.600	2024/6/20	1.03
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	102.02	2,805,577,500	0.600	2024/3/20	0.96
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,760,000,000	100.32	2,769,081,300	100.80	2,782,080,000	0.500	2024/9/20	0.95

日本	国債証券	第106回利付国債（5年）	2,680,000,000	100.30	2,688,049,200	100.53	2,694,230,800	0.200	2017/9/20	0.92
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	100.71	2,618,460,000	0.400	2016/9/20	0.89
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	104.52	2,539,981,800	1.500	2017/12/20	0.87
日本	国債証券	第103回利付国債（5年）	2,500,000,000	100.56	2,514,180,500	100.66	2,516,625,000	0.300	2017/3/20	0.86
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	104.01	2,330,025,600	0.800	2023/9/20	0.79
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	100.59	2,293,543,200	0.300	2016/12/20	0.78
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,160,000,000	106.03	2,290,296,800	106.05	2,290,788,000	1.300	2019/12/20	0.78
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	105.51	2,215,899,000	1.500	2018/9/20	0.76
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,070,000,000	106.06	2,195,628,200	106.45	2,203,597,800	1.200	2020/12/20	0.75
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	104.74	2,189,170,500	1.700	2017/9/20	0.75
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	104.08	2,123,232,000	0.800	2023/6/20	0.72
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	103.89	2,067,430,900	1.700	2017/3/20	0.71
日本	国債証券	第345回利付国債（2年）	2,060,000,000	100.16	2,063,392,200	100.17	2,063,646,200	0.100	2016/10/15	0.70
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	2,010,000,000	100.92	2,028,492,000	102.46	2,059,626,900	0.600	2023/3/20	0.70
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	1,930,000,000	104.62	2,019,304,400	105.63	2,038,813,400	1.000	2022/3/20	0.70
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	100.60	1,971,897,200	0.200	2018/9/20	0.67
日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	1,810,000,000	104.66	1,894,398,000	105.57	1,910,979,900	1.000	2021/9/20	0.65
日本	国債証券	第309回利付国債（10年）	1,780,000,000	105.18	1,872,297,200	105.48	1,877,686,400	1.100	2020/6/20	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	79.43
地方債証券	6.24
特殊債券	8.46
社債券	5.50
合計	99.62

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	128,239,493,938	56.19
	イギリス	18,337,200,230	8.03
	カナダ	9,721,164,974	4.26
	スイス	9,126,315,581	4.00
	ドイツ	8,395,091,960	3.68
	フランス	8,207,189,537	3.60
	オーストラリア	6,191,913,195	2.71
	オランダ	3,369,629,688	1.48
	スペイン	3,286,222,490	1.44
	スウェーデン	2,818,642,724	1.23
	アイルランド	2,793,669,034	1.22
	香港	2,387,076,674	1.05
	イタリア	1,987,499,207	0.87
	デンマーク	1,431,153,376	0.63
	シンガポール	1,416,723,711	0.62
	ジャージー	1,201,932,443	0.53
	ベルギー	1,187,265,094	0.52
	キュラソー	852,365,942	0.37
	バミューダ	839,279,117	0.37
	フィンランド	834,450,402	0.37
	ノルウェー	579,877,603	0.25
	イスラエル	507,735,924	0.22
	ルクセンブルク	355,166,509	0.16
	ケイマン	228,526,668	0.10
	オーストリア	202,899,846	0.09
	ポルトガル	158,132,368	0.07
	ニュージーランド	149,089,962	0.07
	パナマ	119,536,262	0.05
	英ヴァージン諸島	115,169,283	0.05
	リベリア	81,358,944	0.04
	ガーンジー	58,051,888	0.03
	マン島	44,016,825	0.02
モーリシャス	17,700,760	0.01	
	小計	215,241,542,159	94.31
投資信託受益証券	オーストラリア	117,089,626	0.05
	シンガポール	26,644,903	0.01

	香港	19,289,725	0.01
	小計	163,024,254	0.07
投資証券	アメリカ	3,553,886,350	1.56
	オーストラリア	500,503,834	0.22
	イギリス	310,026,360	0.14
	フランス	290,929,467	0.13
	香港	102,117,812	0.04
	シンガポール	95,953,044	0.04
	カナダ	47,088,857	0.02
	オランダ	30,065,907	0.01
	小計	4,930,571,631	2.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,900,038,505	3.46
合計(純資産総額)		228,235,176,549	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,716,404,558	2.07
	買建	カナダ	380,469,700	0.17
	買建	ドイツ	1,378,944,986	0.60
	買建	イギリス	948,560,256	0.42
	買建	オーストラリア	381,670,758	0.17

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		435,029,770	0.19
	売建		47,288,000	0.02

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	359,702	10,723.46	3,857,250,369	14,069.37	5,060,780,528	2.22
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	255,748	11,870.29	3,035,803,438	11,170.37	2,856,799,889	1.25
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	470,161	4,814.32	2,263,508,139	5,645.48	2,654,285,698	1.16
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	169,108	11,916.40	2,015,158,859	12,675.43	2,143,518,020	0.94
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	601,573	3,134.27	1,885,496,598	3,176.84	1,911,101,229	0.84
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	297,365	5,977.70	1,777,561,377	6,417.52	1,908,347,143	0.84
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	193,209	8,551.19	1,652,168,415	8,839.09	1,707,792,996	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	162,325	9,537.61	1,548,193,209	10,508.28	1,705,756,941	0.75
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	225,503	6,606.69	1,489,828,956	7,133.99	1,608,737,996	0.70
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	137,800	9,958.83	1,372,327,863	11,393.43	1,570,014,654	0.69
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	113,841	14,453.61	1,645,414,270	13,609.45	1,549,314,001	0.68
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	42,085	32,662.39	1,374,596,729	35,515.64	1,494,676,088	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	248,485	5,877.21	1,460,399,347	5,916.22	1,470,094,213	0.64
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	380,110	3,498.42	1,329,786,593	3,676.95	1,397,646,605	0.61
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,168,491	1,168.24	1,365,079,912	1,173.44	1,371,156,578	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	297,238	3,282.06	975,554,378	4,362.68	1,296,756,359	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	310,850	4,166.42	1,295,133,273	4,153.41	1,291,090,576	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	630,300	1,810.10	1,140,906,850	2,022.91	1,275,043,514	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	236,591	4,815.50	1,139,305,830	5,236.40	1,238,886,698	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	172,925	6,678.81	1,154,933,686	7,064.24	1,221,584,134	0.54
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	69,298	15,238.11	1,055,970,690	17,520.50	1,214,135,865	0.53
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	181,707	5,664.39	1,029,261,003	6,399.78	1,162,886,623	0.51
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	17,255	66,309.29	1,144,166,894	63,887.94	1,102,386,493	0.48
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	17,006	67,367.45	1,145,650,923	64,758.11	1,101,276,553	0.48

アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	56,900	21,548.59	1,226,115,329	19,147.34	1,089,484,130	0.48
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	118,477	7,753.52	918,614,192	9,177.01	1,087,264,922	0.48
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	90,617	10,067.28	912,267,119	11,858.46	1,074,578,885	0.47
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	97,740	9,950.23	972,536,144	10,867.70	1,062,209,154	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	90,308	10,391.23	938,411,623	11,746.15	1,060,771,359	0.46
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	213,913	4,875.80	1,042,998,118	4,950.29	1,058,931,406	0.46

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.66
		素材	4.99
		資本財	6.97
		商業・専門サービス	0.82
		運輸	2.05
		自動車・自動車部品	1.62
		耐久消費財・アパレル	1.62
		消費者サービス	1.63
		メディア	2.91
		小売	3.08
		食品・生活必需品小売り	2.06
		食品・飲料・タバコ	5.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		ヘルスケア機器・サービス	3.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.60
		銀行	9.34
		各種金融	3.89
		保険	4.11
		不動産	0.68
		ソフトウェア・サービス	6.81
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.44		
電気通信サービス	3.14		
公益事業	3.25		
半導体・半導体製造装置	1.74		
		小計	94.31
投資信託受益証券			0.07

投資証券		2.16
合計		96.54

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	77	アメリカドル	38,843,346.5	4,592,448,856	39,891,775	4,716,404,558	2.07
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	21	カナダドル	3,598,938.5	375,081,370	3,650,640	380,469,700	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	41	スイスフラン	3,622,207	443,756,579	3,740,020	458,189,850	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	193	ユーロ	5,941,148.5	874,537,059	6,255,130	920,755,136	0.40
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	3,794,671	382,161,316	3,789,800	381,670,758	0.17
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	76	イギリスポンド	5,002,995	929,206,261	5,107,200	948,560,256	0.42

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,020,000.00	354,909,796	357,024,400	0.15
	ユーロ	買建	176,000.00	25,852,992	25,905,440	0.01
	イギリスポンド	買建	91,000.00	16,882,775	16,899,610	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	1,016,000.00	16,122,904	16,123,920	0.00
	シンガポールドル	買建	210,000.00	19,006,470	19,076,400	0.00
	アメリカドル	売建	400,000.00	47,291,200	47,288,000	0.02

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	96,346,334,372	38.55
	イタリア	25,193,124,630	10.08
	フランス	24,870,433,320	9.95
	ドイツ	20,465,535,218	8.19
	イギリス	20,364,981,591	8.15
	スペイン	13,662,113,638	5.47
	ベルギー	6,645,637,517	2.66
	オランダ	6,590,216,423	2.64
	カナダ	5,740,263,031	2.30
	オーストリア	4,110,895,690	1.64
	オーストラリア	4,110,889,874	1.64
	メキシコ	2,743,467,314	1.10
	デンマーク	2,084,090,183	0.83
	アイルランド	2,030,748,311	0.81
	フィンランド	1,660,592,050	0.66
	ポーランド	1,594,472,642	0.64
	南アフリカ	1,365,713,185	0.55
	マレーシア	1,265,208,899	0.51
	スウェーデン	1,237,020,744	0.49
	シンガポール	965,171,684	0.39
スイス	846,071,027	0.34	
ノルウェー	706,970,640	0.28	
	小計	244,599,951,983	97.86
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,342,750,975	2.14
合計（純資産総額）		249,942,702,958	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	670,268,962	0.27
	買建	ドイツ	1,070,759,296	0.43

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		2,168,051,600	0.86

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.25% 12/31/15	25,000,000	11,823.35	2,955,838,672	11,831.08	2,957,770,521	0.250	2015/12/31	1.18
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	18,500,000	12,031.08	2,225,750,688	11,966.86	2,213,869,453	1.375	2015/11/30	0.89
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/16	18,000,000	12,099.77	2,177,959,758	12,081.39	2,174,651,500	1.750	2016/5/31	0.87
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	11,807.99	2,125,438,262	11,825.07	2,128,514,084	0.250	2016/4/15	0.85
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/16	17,300,000	11,853.14	2,050,594,716	11,869.87	2,053,488,600	0.625	2016/8/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/18	15,600,000	11,770.62	1,836,217,361	11,804.52	1,841,506,144	1.250	2018/10/31	0.74
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	11,877.26	1,579,676,335	11,875.41	1,579,430,638	0.625	2016/7/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	11,866.18	1,423,941,794	11,865.25	1,423,830,960	0.750	2017/1/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.5% 07/31/17	12,000,000	11,674.97	1,400,997,125	11,718.85	1,406,262,725	0.500	2017/7/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/16	11,000,000	11,841.39	1,302,552,915	11,846.78	1,303,146,302	0.375	2016/3/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	11,514.72	1,266,619,694	11,598.54	1,275,840,257	1.250	2020/2/29	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/44	9,900,000	11,912.43	1,179,331,481	12,786.85	1,265,898,311	3.375	2044/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	13,123.99	1,286,151,196	12,912.47	1,265,422,158	4.500	2017/5/15	0.51
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 08/01/18	7,500,000	16,585.54	1,243,915,661	16,694.76	1,252,107,120	4.500	2018/8/1	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	12,169.37	1,253,445,832	12,071.69	1,243,384,965	2.000	2016/1/31	0.50
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	7,150,000	16,982.24	1,214,230,389	17,253.45	1,233,622,333	3.500	2020/4/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.125% 06/30/21	10,000,000	11,744.73	1,174,473,174	11,983.48	1,198,348,800	2.125	2021/6/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	11,899.66	1,189,966,483	11,891.12	1,189,112,082	0.875	2017/1/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	10,000,000	11,871.72	1,187,172,365	11,884.19	1,188,419,325	1.500	2019/1/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/28/19	10,000,000	11,862.48	1,186,248,693	11,879.80	1,187,980,585	1.500	2019/2/28	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	10,000,000	11,835.42	1,183,542,008	11,842.39	1,184,239,717	0.625	2016/12/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	12,577.87	1,194,897,734	12,449.71	1,182,722,576	3.000	2017/2/28	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	11,674.51	1,179,126,498	11,705.69	1,182,275,066	0.750	2018/2/28	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	10,200,000	11,253.78	1,147,886,296	11,465.76	1,169,508,534	1.750	2023/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/18	10,000,000	11,640.99	1,164,099,230	11,692.53	1,169,253,130	0.750	2018/3/31	0.47
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	17,329.63	1,143,755,923	17,361.28	1,145,844,691	4.250	2019/4/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/18	9,400,000	11,768.04	1,106,195,900	11,791.13	1,108,366,534	1.250	2018/11/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 3% 08/31/16	8,700,000	12,501.89	1,087,665,202	12,357.34	1,075,088,940	3.000	2016/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	9,100,000	10,903.02	992,175,076	11,614.94	1,056,959,800	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,510.10	1,035,909,558	11,569.91	1,041,292,252	1.000	2019/6/30	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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.86
合計	97.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	23	アメリカドル	2,736,552.88	323,542,647	2,743,648.38	324,381,548	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	13	アメリカドル	1,640,192.66	193,919,977	1,647,546.94	194,789,474	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	9	アメリカドル	1,265,754.73	149,650,182	1,278,000	151,097,940	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	14	ユーロ	1,553,266	228,640,755	1,552,740	228,563,328	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	16	ユーロ	2,050,414	301,820,941	2,052,320	302,101,504	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	24	ユーロ	3,637,836	535,489,459	3,669,120	540,094,464	0.22

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,040,000.00	934,661,320	950,247,600	0.38
	カナダドル	買建	930,000.00	95,180,440	96,850,200	0.03
	ユーロ	買建	6,280,000.00	910,350,490	924,164,800	0.36
	イギリスポンド	買建	1,060,000.00	193,806,800	196,789,000	0.07

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	韓国	3,233,907,433	13.97
	台湾	2,683,084,664	11.59
	中国	2,377,269,311	10.27
	ブラジル	2,099,025,070	9.07
	南アフリカ	1,707,792,929	7.38
	インド	1,629,286,722	7.04
	メキシコ	1,100,637,369	4.75
	ケイマン	986,099,526	4.26
	香港	976,518,080	4.22
	ロシア	912,127,154	3.94
	マレーシア	822,223,531	3.55
	インドネシア	579,924,486	2.50
	タイ	555,389,797	2.40
	トルコ	389,572,835	1.68
	ポーランド	381,444,035	1.65
	チリ	315,695,727	1.36
	フィリピン	269,329,066	1.16
	バミューダ	254,103,068	1.10
	カタール	209,612,845	0.91
	コロンビア	206,136,699	0.89
	アラブ首長国連邦	187,836,678	0.81
	ギリシャ	113,339,077	0.49
	エジプト	48,231,236	0.21
	チェコ	43,196,092	0.19
	ハンガリー	38,756,481	0.17
	アメリカ	25,543,989	0.11
	ペルー	20,196,486	0.09
	マルタ共和国	15,453,033	0.07
スペイン	5,880,011	0.03	
	小計	22,187,613,430	95.83
投資信託受益証券	ブラジル	59,411,497	0.26
	メキシコ	7,707,909	0.03
	小計	67,119,406	0.29
投資証券	南アフリカ	55,385,763	0.24
	メキシコ	45,275,824	0.20
	トルコ	9,947,507	0.04
	小計	110,609,094	0.48

現金・預金・その他の資産（負債控除後）		788,393,839	3.41
合計（純資産総額）		23,153,735,769	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	782,174,211	3.38

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建		130,042,000	0.56

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,216	129,253.62	674,186,913	135,627.19	707,431,475	3.06
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,167,389	501.55	585,509,743	534.79	624,319,637	2.70
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	243,400	1,887.23	459,352,432	1,907.77	464,352,435	2.01
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	288,000	1,471.66	423,838,938	1,447.98	417,020,400	1.80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,426,620	86.29	295,711,210	88.45	303,084,539	1.31
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	18,872	15,102.91	285,022,223	15,564.33	293,730,224	1.27
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,522,515	76.37	269,019,132	78.99	278,261,072	1.20
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	132,609	1,684.76	223,415,103	1,808.77	239,859,260	1.04
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,573,340	139.54	219,557,504	142.00	223,421,989	0.96

中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,793,200	56.15	213,015,803	58.86	223,286,718	0.96
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	598,314	368.06	220,215,587	370.92	221,927,826	0.96
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	282,184	737.24	208,038,067	714.10	201,510,190	0.87
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	78,792	2,436.85	192,004,988	2,429.82	191,450,630	0.83
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	103,000	1,684.43	173,496,947	1,855.46	191,112,442	0.83
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	21,686	8,046.91	174,505,336	8,426.18	182,730,291	0.79
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	225,500	765.62	172,648,294	773.18	174,353,533	0.75
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	70,538	2,125.45	149,925,571	2,224.51	156,913,051	0.68
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	853,000	179.46	153,080,445	183.00	156,099,000	0.67
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	361,000	347.33	125,388,025	411.75	148,641,750	0.64
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	26,482	5,846.13	154,817,322	5,412.28	143,327,999	0.62
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	7,359	17,533.17	129,026,665	19,367.64	142,526,536	0.62
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	25,046	5,388.64	134,964,057	5,675.04	142,137,052	0.61
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	27,333	5,100.02	139,398,980	5,134.30	140,335,959	0.61
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,016,000	139.37	141,609,218	132.67	134,797,800	0.58
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	200,340	662.40	132,705,763	627.51	125,716,075	0.54
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	68,804	1,640.36	112,863,943	1,776.29	122,216,545	0.53
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,227,400	97.97	120,257,177	98.05	120,355,776	0.52
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	61,278	1,891.48	115,906,242	1,908.09	116,924,215	0.50
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	22,177	4,967.32	110,160,333	5,120.86	113,565,512	0.49
韓国	株式	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	銀行	20,131	5,289.33	106,479,609	5,322.07	107,138,792	0.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.78
		素材	7.35
		資本財	4.43
		商業・専門サービス	0.16
		運輸	1.67
		自動車・自動車部品	3.19
		耐久消費財・アパレル	1.09
		消費者サービス	0.96
		メディア	2.06

	小売	1.57
	食品・生活必需品小売り	1.88
	食品・飲料・タバコ	4.91
	家庭用品・パーソナル用品	1.13
	ヘルスケア機器・サービス	0.66
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.48
	銀行	18.62
	各種金融	2.75
	保険	3.65
	不動産	1.99
	ソフトウェア・サービス	4.88
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.11
	電気通信サービス	7.37
	公益事業	3.27
	半導体・半導体製造装置	4.89
	小計	95.83
投資信託受益証券		0.29
投資証券		0.48
合計		96.59

(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有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	130	アメリカドル	6,475,378	765,583,941	6,615,700	782,174,211	3.38

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,100,000.00	129,271,340	130,042,000	0.56

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	トルコ	1,414,691,644	10.06
	マレーシア	1,405,849,615	10.00
	ポーランド	1,404,054,220	9.98
	南アフリカ	1,389,274,077	9.88
	ブラジル	1,387,493,228	9.87
	メキシコ	1,363,056,618	9.69
	インドネシア	1,125,203,640	8.00
	コロンビア	1,080,190,848	7.68
	タイ	919,837,537	6.54
	ロシア	766,624,157	5.45
	ハンガリー	707,218,032	5.03
	ナイジェリア	255,586,482	1.82
	ペルー	237,294,282	1.69
	フィリピン	54,271,588	0.39
	チリ	10,381,069	0.07
	小計	13,521,027,037	96.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		542,646,898	3.86
合計(純資産総額)		14,063,673,935	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		284,207,794	2.02
	売建		118,220,000	0.84

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	6,700,000,000	6.04	405,192,370	6.15	412,473,500	7.750	2021/4/14	2.93
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	6,500,000,000	4.90	318,715,020	4.99	324,970,922	4.375	2023/3/21	2.31
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	20,950,000	1,278.55	267,857,480	1,311.74	274,810,832	10.500	2026/12/21	1.95
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	3,800,000,000	5.81	220,830,464	5.79	220,225,591	12.000	2015/10/22	1.57
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	4,500,000	4,450.95	200,293,096	4,499.86	202,494,081	10.000	2017/1/1	1.44
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	4,000,000	4,781.98	191,279,592	4,837.94	193,517,911	12.500	2016/1/5	1.38
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	85,000,000	223.39	189,884,305	222.94	189,499,336	7.850	2018/3/10	1.35
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	47,000,000	380.43	178,802,154	382.98	180,001,728	3.875	2019/6/13	1.28
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	320,000,000	53.73	171,967,439	52.16	166,940,368	7.000	2019/10/23	1.19
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/17	4,350,000	3,615.97	157,295,037	3,678.55	160,017,172	0.000	2017/1/1	1.14
トルコ	国債証券	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000	5,714.86	154,301,371	5,890.09	159,032,432	10.400	2019/3/27	1.13
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/16	4,000,000	3,843.57	153,742,875	3,886.55	155,462,386	0.000	2016/7/1	1.11
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	14,900,000,000	1.00	150,289,664	1.02	152,713,557	8.375	2024/3/15	1.09
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	40,500,000	368.96	149,429,591	369.80	149,769,405	3.250	2017/6/16	1.06
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.625% 05/15/33	17,500,000,000	0.81	143,199,560	0.83	146,653,080	6.625	2033/5/15	1.04
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	13,100,000	1,073.76	140,663,866	1,088.14	142,546,689	7.250	2020/1/15	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.75% 03/31/21	13,500,000	1,037.19	140,020,713	1,053.53	142,227,697	6.750	2021/3/31	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	12,500,000	1,116.24	139,530,300	1,124.02	140,502,735	8.250	2017/9/15	1.00
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	2,750,000	4,852.12	133,433,387	5,099.51	140,236,783	7.100	2023/3/8	1.00
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/19	3,100,000	4,303.19	133,399,178	4,406.53	136,602,735	10.000	2019/1/1	0.97
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	12,000,000	1,110.58	133,270,465	1,122.07	134,648,918	8.000	2018/12/21	0.96
トルコ	国債証券	TURKGB 8.8% 11/14/18	2,350,000	5,407.13	127,067,665	5,566.42	130,811,055	8.800	2018/11/14	0.93
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	3,250,000	3,930.08	127,727,600	4,003.82	130,124,280	4.000	2023/10/25	0.93
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	2,900,000	4,201.71	121,849,677	4,320.78	125,302,880	10.000	2021/1/1	0.89
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	1,700,000,000	7.09	120,686,914	7.20	122,520,835	9.850	2027/6/28	0.87
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.25% 03/31/36	14,000,000	827.01	115,781,904	853.55	119,498,193	6.250	2036/3/31	0.85
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	10,500,000	1,123.67	117,985,504	1,131.65	118,823,843	10.000	2024/12/5	0.84
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	31,000,000	378.24	117,254,510	381.99	118,417,086	3.650	2021/12/17	0.84
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	2,150,000	5,416.22	116,448,816	5,505.06	118,358,945	9.000	2017/3/8	0.84
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	30,700,000	377.93	116,026,497	381.85	117,229,669	3.625	2023/6/16	0.83

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	96.14
合計	96.14

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	メキシコペソ	買建	7,400,000.00	63,414,300	63,344,000	0.45
	トルコリラ	買建	300,000.00	15,945,000	16,041,000	0.11
	ハンガリーフォリント	買建	111,400,000.00	53,379,538	53,360,600	0.37
	ポーランドズロチ	買建	800,000.00	28,143,040	28,152,000	0.20
	マレーシアリングgit	買建	2,622,692.70	92,004,059	92,135,194	0.65
	南アフリカランド	買建	2,900,000.00	31,090,900	31,175,000	0.22
	アメリカドル	売建	1,000,000.00	117,520,000	118,220,000	0.84

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

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

Ｊ-ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	43,462,016,500	99.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		358,843,380	0.82
合計(純資産総額)		43,820,859,880	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

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

不動産投信指数先物取引	買建	日本		358,092,000	0.82
-------------	----	----	--	-------------	------

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6,135	577,805.65	3,544,837,701	598,000	3,668,730,000	8.37
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5,438	562,720.38	3,060,073,477	585,000	3,181,230,000	7.26
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	10,559	218,186.84	2,303,834,943	247,000	2,608,073,000	5.95
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	10,916	182,616.03	1,993,436,639	190,700	2,081,681,200	4.75
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	7,520	254,420.86	1,913,244,908	258,700	1,945,424,000	4.44
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	5,648	273,661.22	1,545,638,572	290,000	1,637,920,000	3.74
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	3,585	398,078.8	1,427,112,508	430,500	1,543,342,500	3.52
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	9,215	155,985.16	1,437,403,330	164,800	1,518,632,000	3.47
日本	投資証券	G L P 投資法人	10,388	134,118.58	1,393,223,835	136,800	1,421,078,400	3.24
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	5,735	191,402.53	1,097,693,565	224,700	1,288,654,500	2.94
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	2,155	499,226.94	1,075,834,076	550,000	1,185,250,000	2.70
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	1,750	605,629.82	1,059,852,191	655,000	1,146,250,000	2.62
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,916	587,426.54	1,125,509,251	598,000	1,145,768,000	2.61
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	6,822	155,345.12	1,059,764,444	166,100	1,133,134,200	2.59
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	7,235	146,279.28	1,058,330,619	153,900	1,113,466,500	2.54
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	1,091	933,161.23	1,018,078,903	981,000	1,070,271,000	2.44
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	3,606	250,851.44	904,570,314	266,600	961,359,600	2.19
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,005	394,892.45	791,759,363	469,000	940,345,000	2.15
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	12,128	71,646.15	868,924,591	77,200	936,281,600	2.14
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,624	484,792.11	787,302,402	541,000	878,584,000	2.00
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	5,269	143,582.32	756,535,246	155,900	821,437,100	1.87
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,619	469,566.06	760,227,460	495,500	802,214,500	1.83
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	719	1,010,327.3	726,425,330	1,053,000	757,107,000	1.73
日本	投資証券	イオンリート投資法人	4,128	153,859.98	635,134,026	171,200	706,713,600	1.61
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	4,248	149,454.37	634,882,187	159,800	678,830,400	1.55
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,275	532,070.71	678,390,156	528,000	673,200,000	1.54
日本	投資証券	福岡リート投資法人	2,998	199,158.64	597,077,624	220,000	659,560,000	1.51
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	3,366	165,424.88	556,820,151	182,100	612,948,600	1.40
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	6,409	75,392.58	483,191,052	84,800	543,483,200	1.24
日本	投資証券	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	4,423	110,156.08	487,220,375	122,300	540,932,900	1.23

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.18
合計	99.18

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
不動産投資指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	196	円	337,164,400	358,092,000	0.82

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	29,124,942,390	69.63
	オーストラリア	3,451,770,381	8.25
	イギリス	2,768,828,076	6.62
	フランス	1,872,918,233	4.48
	シンガポール	1,454,202,087	3.48
	カナダ	1,009,851,077	2.41
	香港	754,575,032	1.80
	オランダ	428,268,097	1.02
	ベルギー	211,680,797	0.51
	ニュージーランド	133,648,216	0.32
	スペイン	106,317,275	0.25
	アイルランド	95,969,101	0.23
	ドイツ	56,467,255	0.14
	イタリア	39,313,406	0.09
	マン島	29,402,638	0.07

	ガンジー	25,922,451	0.06
	イスラエル	15,392,035	0.04
	小計	41,579,468,547	99.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		245,867,605	0.59
合計(純資産総額)		41,825,336,152	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		204,795,900	0.48

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	112,460	21,217.01	2,386,064,997	21,362.97	2,402,480,585	5.74
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	52,300	22,025.62	1,151,940,331	22,065.26	1,154,013,354	2.76
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	130,510	8,194.67	1,069,487,388	8,399.05	1,096,161,216	2.62
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	35,310	29,672.09	1,047,721,808	31,029.75	1,095,660,825	2.62
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	117,600	8,356.10	982,678,358	8,627.24	1,014,563,789	2.43
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	47,640	18,604.55	886,321,031	18,965.27	903,505,668	2.16
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	181,570	4,896.96	889,142,483	4,965.65	901,614,886	2.16
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	106,890	8,075.21	863,160,061	8,394.33	897,269,934	2.15
アメリカ	投資証券	HCP INC	166,650	5,109.66	851,524,958	5,257.68	876,193,722	2.09
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	55,610	15,113.99	840,489,336	15,277.68	849,591,818	2.03
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	63,400	12,893.67	817,459,043	13,129.44	832,406,591	1.99
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	272,170	2,679.47	729,273,829	2,739.38	745,579,531	1.78
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	225,730	3,021.74	682,098,687	3,172.11	716,040,593	1.71
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,921,750	358.16	688,301,624	348.45	669,646,471	1.60
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	280,840	2,052.52	576,429,959	2,219.47	623,316,938	1.49
香港	投資証券	LINK REIT	834,500	703.40	586,988,713	742.67	619,762,288	1.48
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	693,100	810.32	561,633,883	824.81	571,679,207	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	23,000	23,712.71	545,392,330	23,907.28	549,867,631	1.31
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	371,010	1,352.20	501,681,697	1,423.62	528,177,423	1.26

アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	51,060	8,117.44	414,476,619	9,347.26	477,271,290	1.14
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	34,690	13,488.65	467,921,611	13,699.31	475,229,067	1.14
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	149,290	2,931.19	437,598,520	3,001.85	448,147,635	1.07
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	80,850	5,539.64	447,879,950	5,489.41	443,819,518	1.06
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	49,540	8,020.63	397,342,387	8,263.09	409,353,711	0.98
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,770	15,713.74	389,229,519	15,718.67	389,351,666	0.93
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	324,210	1,038.80	336,792,449	1,118.45	362,614,555	0.87
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	830,390	422.85	351,132,702	417.94	347,058,594	0.83
アメリカ	投資証券	UDR INC	89,930	3,569.04	320,964,174	3,628.47	326,309,089	0.78
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	279,260	1,126.45	314,573,499	1,158.95	323,649,829	0.77
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	553,810	568.59	314,892,775	553.90	306,758,128	0.73

(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。

□. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.41
合計	99.41

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,300,000.00	153,059,020	153,686,000	0.36
	ユーロ	買建	120,000.00	17,648,740	17,662,800	0.04
	イギリスポンド	買建	50,000.00	9,280,210	9,285,500	0.02
	オーストラリアドル	買建	240,000.00	24,153,440	24,161,600	0.05

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

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

投資状況

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

社債券	イギリス	16,460,494,901	77.89
	ジャージー	3,201,509,498	15.15
	アメリカ	821,806,326	3.89
	小計	20,483,810,725	96.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		650,335,984	3.08
合計(純資産総額)		21,134,146,709	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		299,979,699	1.41

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	225,280,000	1,619.23	3,647,802,440	1,421.12	3,201,509,498	0.000	9999/99/99	15.15
イギリス	社債券	UBS USD COM 008 09/25/15	20,000,000	11,449.57	2,289,914,109	11,308.69	2,261,739,900	0.000	2015/9/25	10.70
イギリス	社債券	BAR USD COM 030 07/31/15	20,000,000	11,451.69	2,290,339,737	10,711.75	2,142,351,248	0.000	2015/7/31	10.14
イギリス	社債券	UBS USD COM 007 08/12/15	17,000,000	11,818.54	2,009,153,328	10,877.16	1,849,117,200	0.000	2015/8/12	8.75
イギリス	社債券	CS USD COM 010 10/27/15	14,000,000	11,880.93	1,663,330,578	11,846.64	1,658,530,440	0.000	2015/10/27	7.85
イギリス	社債券	CS USD COM 009 08/28/15	15,000,000	11,460.42	1,719,064,200	11,048.59	1,657,289,025	0.000	2015/8/28	7.84
イギリス	社債券	BAR USD COM 031 10/30/15	10,000,000	11,823.00	1,182,300,000	11,860.83	1,186,083,360	0.000	2015/10/30	5.61
イギリス	社債券	CS USD COM 008 07/31/15	10,000,000	11,839.19	1,183,919,751	10,766.02	1,076,602,380	0.000	2015/7/31	5.09
イギリス	社債券	BAR USD COM 029 06/26/15	10,000,000	11,794.15	1,179,415,188	10,580.99	1,058,099,385	0.000	2015/6/26	5.01
イギリス	社債券	CS USD COM 007 05/29/15	10,000,000	11,671.90	1,167,190,206	10,366.40	1,036,640,640	0.000	2015/5/29	4.91
イギリス	社債券	BAR USD COM 028 05/29/15	10,000,000	11,681.47	1,168,147,869	10,229.73	1,022,973,252	0.000	2015/5/29	4.84
イギリス	社債券	UBS USD COM 006 04/30/15	10,000,000	11,561.47	1,156,147,524	10,054.27	1,005,427,920	0.000	2015/4/30	4.76

アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	20,480,000	4,575.36	937,034,745	4,012.72	821,806,326	0.000	2036/6/12	3.89
イギリス	社債券	BAR USD COM 027 03/27/15	5,000,000	11,639.89	581,994,740	10,112.80	505,640,151	0.000	2015/3/27	2.39

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	96.92
合計	96.92

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,537,469.97	300,000,000	299,979,699	1.41

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

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

F R Mシグマ リンク マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ケイマン	9,279,435,600	94.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		559,772,412	5.69
合計(純資産総額)		9,839,208,012	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ケイマン	社債券	QUARTIX 0% 03/31/22	9,090,000,000	101.06	9,186,535,800	102.08	9,279,435,600	0.000	2022/3/31	94.31

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	94.31
合計	94.31

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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11月28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	10,651円
純資産総額	194.07億円

※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)

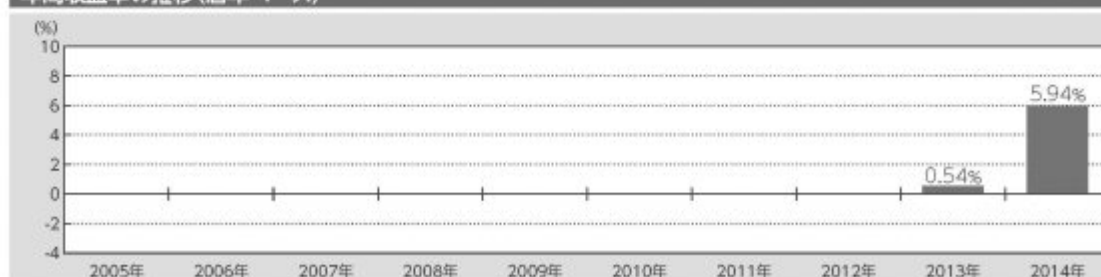
設定来分配金合計額:0円

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)	11.4%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7.9%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{^H, PF}	7.9%
国内債券インデックス マザーファンド	7.1%
HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス	7.1%
外国株式インデックス マザーファンド	6.6%
外国債券インデックス マザーファンド	6.0%
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)	5.6%
FOFs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用)	5.6%
FRM シグマ リンク マザーファンド	4.2%

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11月28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 11,122円

純資産総額 155.92億円

※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)

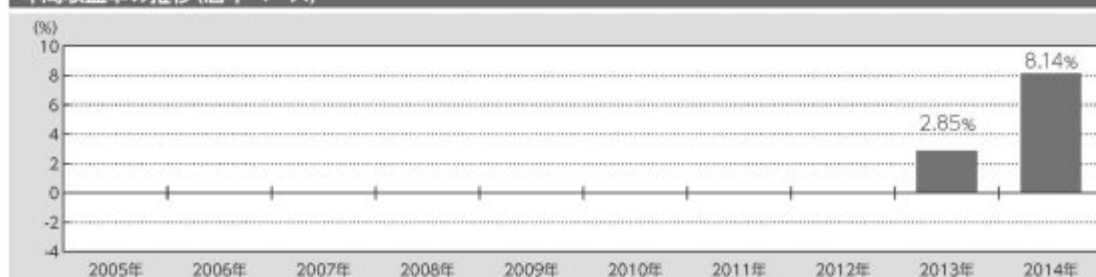
設定来分配金合計額:0円

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
外国株式インデックス マザーファンド	10.8%
外国債券インデックス マザーファンド	9.5%
FOFs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用)	9.1%
FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	8.4%
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)	6.2%
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	5.9%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	5.8%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{A,H,JPY}	5.8%
J-REITインデックス マザーファンド	4.3%
FOFs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用)	4.2%

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。

※本ファンドには、ベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】**3 資産管理等の概要****(5) その他**

<訂正前>

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

（中略）

(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

（中略）

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、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。

（中略）

<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>

（中略）

(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

（中略）

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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

（中略）

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、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。

（中略）

<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、販売会社を經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。

（後略）

<訂正後>

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

（中略）

(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

（中略）

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

（中略）

<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>

（中略）

(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

（中略）

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

（中略）

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

（中略）

<運用報告書>

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

（後略）

第3【ファンドの経理状況】

2 ファンドの現況

分散投資コア戦略ファンドA

純資産額計算書

(平成26年11月28日現在)

資産総額	19,507,865,439円
負債総額	100,488,156円
純資産総額(-)	19,407,377,283円
発行済口数	18,221,495,438口
1口当たり純資産額(/)	1.0651円
(1万口当たり純資産額)	(10,651円)

分散投資コア戦略ファンドS

純資産額計算書

(平成26年11月28日現在)

資産総額	15,675,439,418円
負債総額	83,887,291円
純資産総額(-)	15,591,552,127円
発行済口数	14,018,429,208口
1口当たり純資産額(/)	1.1122円
(1万口当たり純資産額)	(11,122円)

(参考)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

純資産額計算書

(平成26年11月28日現在)

資産総額	49,166,416,526円
負債総額	2,851,296,671円
純資産総額(-)	46,315,119,855円
発行済口数	33,311,617,702口
1口当たり純資産額(/)	1.3904円
(1万口当たり純資産額)	(13,904円)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成26年11月28日現在)

資産総額	302,761,254,163円
負債総額	9,513,016,400円
純資産総額(-)	293,248,237,763円
発行済口数	222,851,952,028口
1口当たり純資産額(/)	1.3159円
(1万口当たり純資産額)	(13,159円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成26年11月28日現在)

資産総額	230,155,662,952円
負債総額	1,920,486,403円
純資産総額(-)	228,235,176,549円
発行済口数	112,112,237,513口
1口当たり純資産額(/)	2.0358円
(1万口当たり純資産額)	(20,358円)

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成26年11月28日現在)

資産総額	250,826,994,441円
負債総額	884,291,483円
純資産総額(-)	249,942,702,958円
発行済口数	86,651,026,404口
1口当たり純資産額(/)	2.8845円
(1万口当たり純資産額)	(28,845円)

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成26年11月28日現在）

資産総額	23,194,653,573円
負債総額	40,917,804円
純資産総額（ - ）	23,153,735,769円
発行済口数	8,820,538,834口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6250円
（1万口当たり純資産額）	（26,250円）

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成26年11月28日現在）

資産総額	14,822,091,794円
負債総額	758,417,859円
純資産総額（ - ）	14,063,673,935円
発行済口数	7,574,294,405口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8568円
（1万口当たり純資産額）	（18,568円）

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成26年11月28日現在）

資産総額	44,397,489,856円
負債総額	576,629,976円
純資産総額（ - ）	43,820,859,880円
発行済口数	29,330,036,836口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4941円
（1万口当たり純資産額）	（14,941円）

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成26年11月28日現在）

資産総額	42,115,089,707円
負債総額	289,753,555円
純資産総額（ - ）	41,825,336,152円

発行済口数	26,128,505,758口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6008円
（1万口当たり純資産額）	（16,008円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

純資産額計算書

（平成26年11月28日現在）

資産総額	21,369,444,644円
負債総額	235,297,935円
純資産総額（ - ）	21,134,146,709円
発行済口数	43,963,219,681口
1口当たり純資産額（ / ）	0.4807円
（1万口当たり純資産額）	（4,807円）

FRMシグマ リンク マザーファンド

純資産額計算書

（平成26年11月28日現在）

資産総額	9,985,747,912円
負債総額	146,539,900円
純資産総額（ - ）	9,839,208,012円
発行済口数	9,599,785,832口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0249円
（1万口当たり純資産額）	（10,249円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 訂正前 >

(1) 資本金の額（平成26年 7月31日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は平成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。

< 訂正後 >

(1) 資本金の額（平成26年11月28日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は平成27年 2月 2日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 事業の内容及び営業の概況

< 訂正前 >

（前略）

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

< 訂正後 >

（前略）

平成26年11月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	393	5,857,717

追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	6	38,402
単位型公社債投資信託	0	0
合計	399	5,896,118

3 委託会社等の経理状況

<更新・訂正後>

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度（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。

また、第29期事業年度の中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成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	1 257,947	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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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
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
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 其他有価証券	47,112	47,112	-
（4）未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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 其他有価証券	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	〃
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・リアルコース）	2,429,898千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

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・リアルコース）	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す。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成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(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導 料の支払	97,199	-	-

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

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(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導 料の支払	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いません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成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

中間貸借対照表

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		10,736,816
未収委託者報酬		3,496,458
繰延税金資産		85,943
その他流動資産		131,122
流動資産合計		14,450,340

固定資産

有形固定資産

建物	1	62,410
器具備品	1	116,552
有形固定資産合計		178,963

無形固定資産

193,575

投資その他の資産

投資有価証券		58,781
長期貸付金		27,338
会員権		25,000
その他の投資		20,550
繰延税金資産		122,025
貸倒引当金		27,338
投資その他の資産合計		226,357

固定資産合計

598,896

資産合計

15,049,237

負債の部

流動負債

未払金		2,137,961
未払費用		69,372
未払法人税等		681,263
賞与引当金		93,828
その他流動負債	2	185,306
流動負債合計		3,167,732

固定負債

退職給付引当金		328,845
資産除去債務		12,599
固定負債合計		341,445

負債合計

3,509,177

(単位：千円)

		第29期中間会計期間末 (平成26年9月30日)
純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		65,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		8,721,600
利益剰余金合計		10,887,100
株主資本合計		11,537,100
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		2,959
評価・換算差額等合計		2,959
純資産合計		11,540,060
負債・純資産合計		15,049,237

中間損益計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		13,096,655
運用受託報酬		8,732
営業収益合計		13,105,387
営業費用		
一般管理費	1	1,514,728
営業利益		2,039,658
営業外収益	2	9,123
営業外費用		24,340
経常利益		2,024,441
税引前中間純利益		2,024,441
法人税、住民税及び事業税		668,312
法人税等調整額		53,822
法人税等合計		722,134

中間純利益

1,302,307

中間株主資本等変動計算書

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,302,307	1,302,307	1,302,307
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,269,307	1,272,307	1,272,307
当中間期末残高	65,500	2,100,000	8,721,600	10,887,100	11,537,100

	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	2,715	2,715	10,267,508
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,302,307
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	244	244	244
当中間期変動額合計	244	244	1,272,551
当中間期末残高	2,959	2,959	11,540,060

重要な会計方針

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1．資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p> その他有価証券</p> <p> 時価のあるもの</p> <p> 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p> 時価のないもの</p> <p> 移動平均法による原価法によっております。</p>
2．固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p> 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p> 定額法によっております。</p> <p> ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
3．引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金</p> <p> 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。</p> <p>(2) 賞与引当金</p> <p> 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p> 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p>
4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理</p> <p> 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。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第29期中間会計期間末 (平成26年9月30日)

1	有形固定資産の減価償却累計額	
	建物	40,466千円
	器具備品	187,949千円
	計	228,416千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産
	無形固定資産
2	営業外収益の主要項目
	受取利息

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

(リ・ス取引関係)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末(平成26年9月30日)

平成26年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)を参照
ください。)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
--	-------------	-------	----

(1)現金及び預金	10,736,816	10,736,816	-
(2)未収委託者報酬	3,496,458	3,496,458	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,778	58,778	-
(4)未払金	(2,137,961)	(2,137,961)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額3千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第29期中間会計期間末(平成26年9月30日)

その他有価証券

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原 価を超えるもの			
その他	56,226	51,514	4,711
小計	56,226	51,514	4,711
貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの			
その他	2,552	2,665	113
小計	2,552	2,665	113
合計	58,778	54,180	4,598

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額3千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

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

（関連情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	1,703,639千円
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	1,456,865千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

<p>第29期中間会計期間 （自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）</p>
--

1株当たり純資産額	3,846,686円70銭
1株当たり中間純利益	434,102円38銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。</p>	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 （自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）
中間純利益	1,302,307千円
普通株式に係る中間純利益	1,302,307千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

5 その他

< 訂正前 >

（前略）

(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。

< 訂正後 >

（前略）

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成27年 2月 2日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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

< 訂正前 >

(1) 受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（平成26年3月末日現在）

（中略）

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年3月末日現在）	事業の内容
----	-----------------------------	-------

（後略）

<訂正後>

(1)受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（平成26年9月末日現在）

（中略）

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年9月末日現在）	事業の内容
----	-----------------------------	-------

（後略）

3 資本関係

<訂正前>

（前略）

(参考)再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成26年3月末日現在）

（後略）

<訂正後>

（前略）

(参考)再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成26年9月末日現在）

（後略）

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。