

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年10月9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・レポートイング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	分散投資コア戦略ファンドA 10兆円を上限とします。 分散投資コア戦略ファンドS 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

分散投資コア戦略ファンドA

分散投資コア戦略ファンドS

（以下、上記を総称して「分散投資コア戦略ファンド」又は「分散投資コアラップ」ということ、あるいは総称して又は個別に「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

愛称として、分散投資コア戦略ファンドAは「コアラップA」、分散投資コア戦略ファンドSは「コアラップS」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

平成27年10月10日から平成28年 4月 8日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】**< 振替受益権について >**

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

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

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

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

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

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

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他... 上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1) グローバル... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉と

する旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

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

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
 - 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド^{※1}等に投資し、オルタナティブ運用^{※2}を行います。
- ※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
- ※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、MLP、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

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

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資比率も予め定められているものでもありません。従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更する運用を行います。

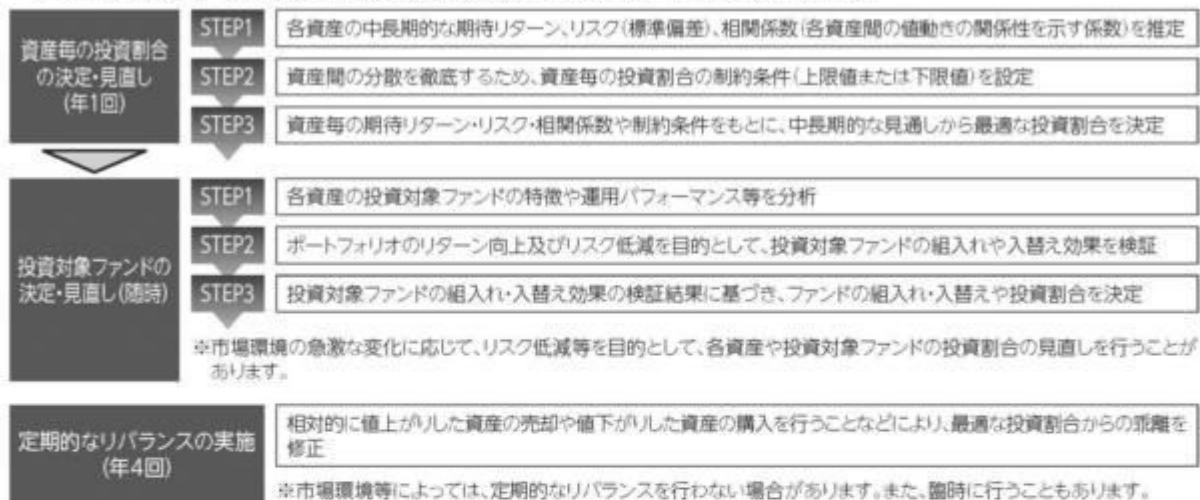
4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

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

- ※3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「投資リスク」の「ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。
- 市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ポートフォリオ構築プロセス

●投資対象ファンドの選定、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の決定は、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針(2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。

? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
 - 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、委託会社が基準価額水準、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。
 - 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

〈ご参考情報〉

MLP

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

バンクローン

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

コモディティ

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

ヘッジファンド

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

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

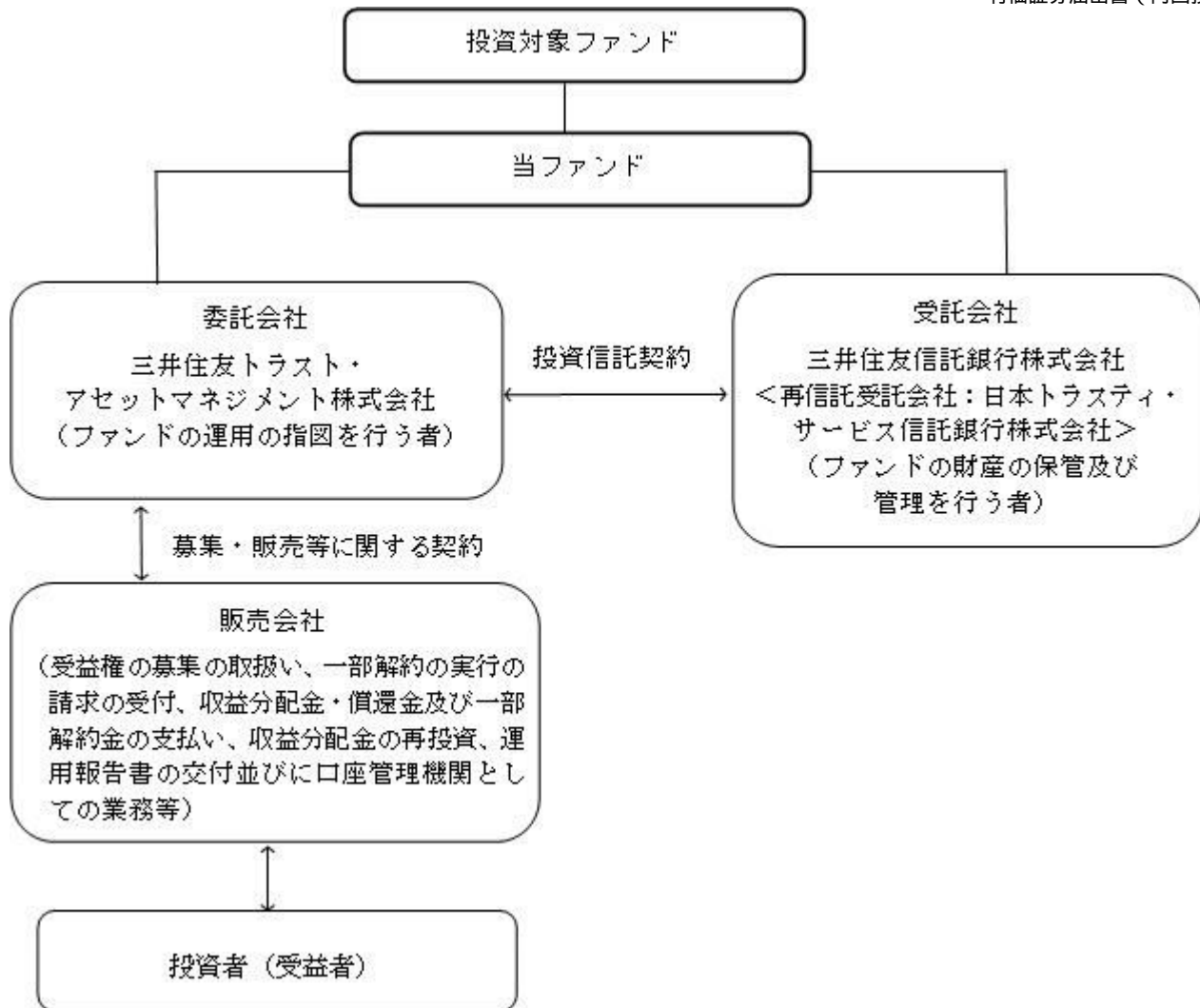
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成25年3月29日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成27年 7月31日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

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

投資対象

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

投資態度

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

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

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

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

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

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

分散投資コア戦略ファンドA	分散投資コア戦略ファンドS
50%未満	75%未満

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

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

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

ヘ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

- ・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、平成27年10月9日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

1.ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてわが国の株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式
投資態度	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。 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、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。 株式以外の資産への投資は、わが国の円建短期公社債等を中心に行います。運用にあたっては、三井住友信託銀行株式会社の投資助言を受けます。 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>	<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、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、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>委託会社は、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。</p> <p>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> <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、委託会社は、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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引およ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：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> <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	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

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

同指数は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所並びに株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P Xグループ及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。同指数を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJ P Xグループ及び日経に帰属しています。

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

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

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

3.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、委託会社は、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	TOPIX（東証株価指数）（ ）
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

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

「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。 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。

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年4月11日
信託期間	原則として平成26年4月11日から平成36年2月14日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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（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（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（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（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>
------	--

<p>主な投資制限</p>	<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、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>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、委託会社は、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	MSCI コクサイ・インデックス（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（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>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、委託会社は、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、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> <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、委託会社は、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	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> <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：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（評価益を含みません。）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・ディバーシファイド（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・ディバーシファイド（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> <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、委託会社は、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、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	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・ディバーシファイド（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・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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> <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	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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。</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。</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>外貨建資産への実質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	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. 大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	大和住銀投信投資顧問株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みます。）への実質的な投資を行います。
主要投資対象	マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みます。）への実質的な投資を行います。</p> <p>中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。</p> <p>世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、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>株式への直接投資は行いません。</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> <p>為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める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こととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の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およびデリバティブ等エクスポージャーの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、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	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。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.7452%以内（税抜：0.69%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月12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

15. 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>

<p>主な投資制限</p>	<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10%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10%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号ロ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> <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、委託会社は、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、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）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	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。

16. 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。

<p>主な投資制限</p>	<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10%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10%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。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の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>
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。

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

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、別に定めるMLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	インデックス マザーファンド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	<p>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。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>< 別に定めるMLP 市場の動きをとらえる指数（平成27年10月 9日現在）> S&P MLP 指数（円換算ベース）</p>
主な投資制限	<p>株式：制限なし 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。</p>
ベンチマーク	S&P MLP 指数（円換算ベース）（平成27年10月 9日現在）
決算日	年1回：11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額。 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。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1512%（税抜 年0.14%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	平成26年10月8日から平成36年11月20日
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「S&P MLP 指数」とはS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、ニューヨーク証券取引所やNASDAQなどに上場するMLP などのうち、GICS（世界産業分類基準）においてエネルギーセクターまたは公益事業セクターのガス産業に属する銘柄を対象とした、浮動株調整後の時価総額加重を基本とする指数です。「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。同指数は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。

18.HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

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

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

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

19. 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>

<p>主な投資制限</p>	<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> <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	ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成20年7月1日
信託期間	原則として無期限
助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）および「ブルームバーグ（Bloomberg^(R)）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ

およびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（BloombergCommodity 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。

20.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>

<p>主な投資制限</p>	<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、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、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> <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、委託会社は、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>
<p>ベンチマーク</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>決算日</p>	<p>6月・12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<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>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>平成22年2月25日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>助言会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

21.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> <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、委託会社は、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：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

22.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	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。 <マザーファンドの投資対象> 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。
投資態度	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。 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。 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。 当ファンドは、原則として対円での為替ヘッジを行います。 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。 <マザーファンドの投資態度> 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。 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。 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。
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於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。

23.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	<ul style="list-style-type: none"> ・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.
------	--

24.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り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</p> <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	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

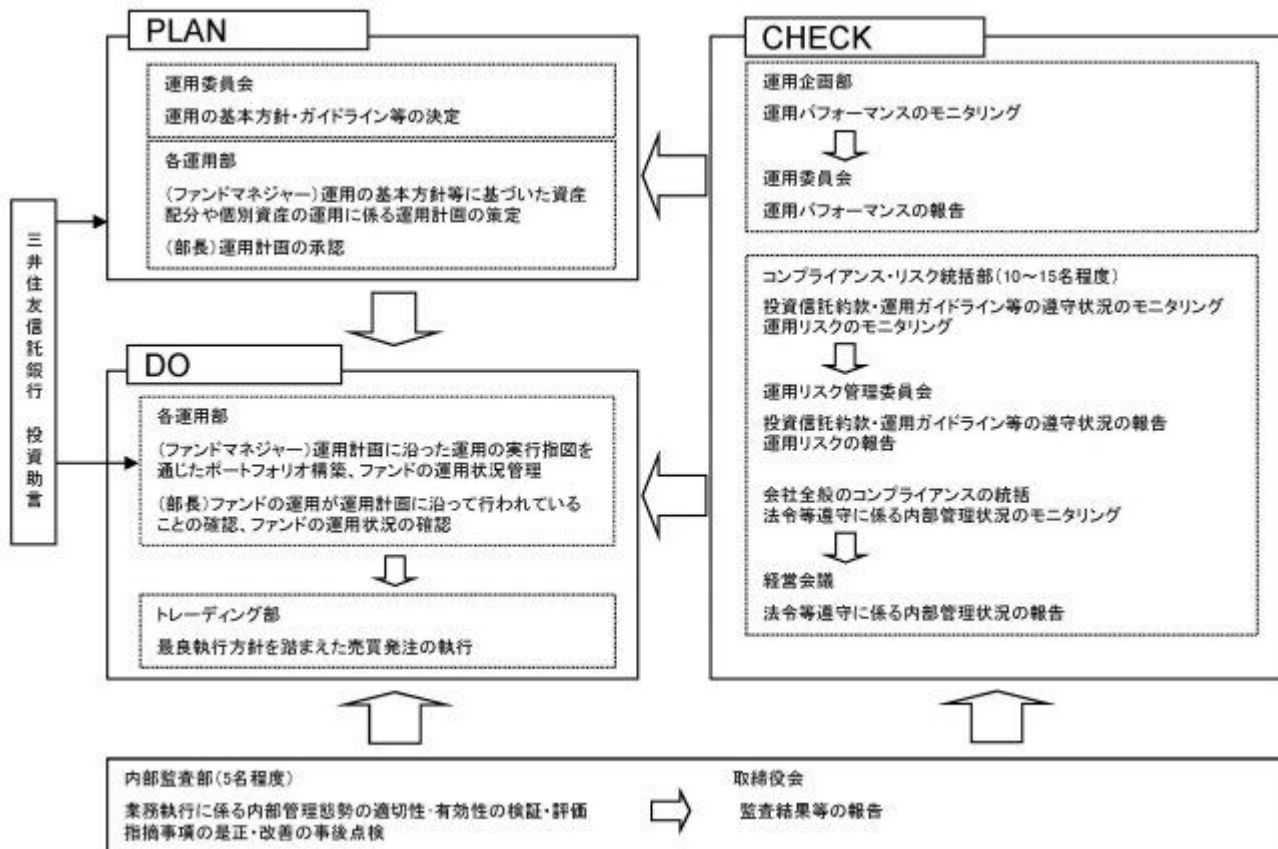
25.BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

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	<p>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。</p> <p>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。</p>
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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>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。</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10%以下とします。</p>
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	<p>年率0.74%</p> <p>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。</p>

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成23年5月24日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・ 投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP ・ 副投資顧問会社 BlueBay Asset Management USA LLC ・ 管理事務代行会社 / 名義書換事務受託会社 / 保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年7月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・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、委託会社が基準価額水準、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、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ．外国為替予約取引の指図

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

リ．資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みません。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

< その他の投資制限 >

イ. 当ファンドでは直接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、新投資口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かかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、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ないものとします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変

化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリーートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

MLPの価格変動リスク

MLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）の多くは、エネルギー、天然資源に関わる事業を主な投資対象とするため、MLPの価格は、事業を取り巻く環境やエネルギー市況の変化、金利変動等の要因により変動し、基準価額の変動要因となります。

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

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

仕組み債券に係るリスク

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

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

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

ブローカーの信用リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

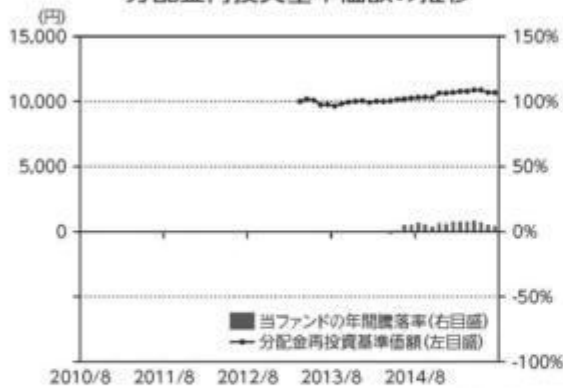
運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守

状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、
監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

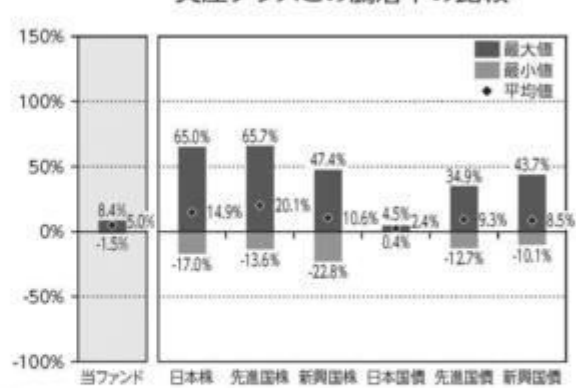
〔参考情報〕

分散投資コア戦略ファンドA

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

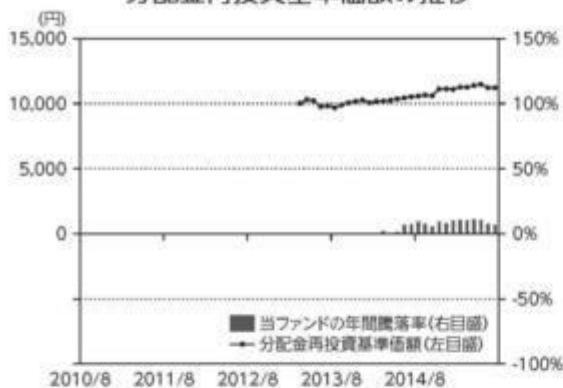


当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

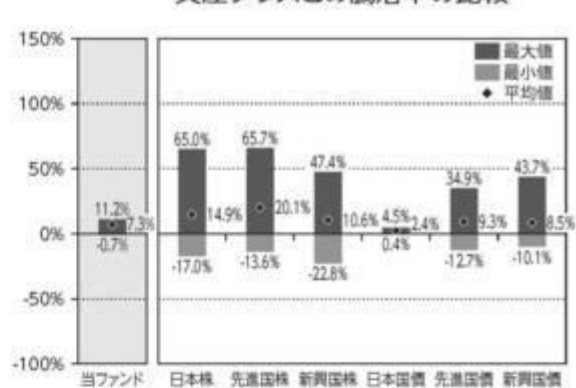


分散投資コア戦略ファンドS

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*当ファンドについては2014年3月～2015年7月の1年5ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2010年8月～2015年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{#1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{#2}

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{#3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{#4}

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{#5}

新興国債… 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・ディバーシファイド(円ベース)^{#6}

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数

を使用しております。

※1～※6については、後掲「各資産クラスの指数の概要」をご覧ください。

【参考情報】

各資産クラスの指数の概要	
※1	TOPIX(東証株価指数)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。「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、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却に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
※2	MSCIロクサイインデックスとは、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。また「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。
※3	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。また「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。
※4	NOMURA-BP国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の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国債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。
※5	シティ世界国債インデックスとは、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却に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
※6	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.296%（税抜 1.2%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.756% (税抜 0.7%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.486% (税抜 0.45%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社	年率 0.054% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の 実行の対価
------	----------------------	-----------------------------

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

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、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%）
大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド（適格 機関投資家専用）	年率 0.7452%以内（税抜 0.69%以内）
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 A, H, JPY D	年率 0.85%
FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%

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

実質的な信託報酬率：年率1.296%～1.78746%程度（税抜 1.2%～1.6645%程度）

（４）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が

適用されます。

上記は、平成27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。

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

5【運用状況】

以下は、平成27年 7月31日現在の状況について記載してあります。

【分散投資コア戦略ファンドA】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	12,699,220,632	53.60
	ケイマン	1,755,579,006	7.41
	小計	14,454,799,638	61.01
投資証券	ルクセンブルク	2,845,379,688	12.01
親投資信託受益証券	日本	6,175,613,769	26.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		216,652,498	0.91
合計(純資産総額)		23,692,445,593	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	F0Fs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,735,430,275	1.0222	2,796,156,827	1.0257	2,805,730,833	11.84
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)	2,739,433,199	1.0138	2,777,492,081	1.0176	2,787,647,223	11.77
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies A, H, JPY Fund-Class D	979,773.462	1,920.04	1,881,207,475	1,939	1,899,780,742	8.02

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)	1,808,201,887	1.034	1,869,790,769	1.042	1,884,146,366	7.95
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	1,655,879,1828	1,058.32	1,752,457,203	1,060.2	1,755,579,006	7.41
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	1,267,600,926	1.3214	1,675,015,738	1.3247	1,679,190,946	7.09
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	656,594,284	2.0745	1,362,157,347	2.1699	1,424,743,936	6.01
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	384,174,746	2.8083	1,078,906,927	2.8753	1,104,617,647	4.66
日本	投資信託受益証券	F0Fs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用)	1,126,540,553	0.9658	1,088,051,932	0.9785	1,102,319,931	4.65
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	900,151,991	1.0353	931,931,946	1.0513	946,329,788	3.99
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	95,431.374	9,922.62	946,929,592	9,908.68	945,598,946	3.99
日本	投資信託受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	950,494,888	0.9916	942,525,664	0.9929	943,746,374	3.98
日本	投資信託受益証券	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	569,201,036	1.3538	770,599,514	1.4092	802,118,099	3.39
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)	687,573,690	0.9969	685,450,672	1.0022	689,086,352	2.91
日本	投資信託受益証券	F0Fs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用)	552,013,334	1.0236	565,084,187	1.0563	583,091,684	2.46
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	320,502,515	1.3753	440,806,963	1.4757	472,965,561	2.00
日本	投資信託受益証券	F0Fs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)	348,797,107	1.1247	392,325,756	1.1674	407,185,742	1.72
日本	投資信託受益証券	大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)	379,209,467	1.0308	390,900,000	1.0338	392,026,746	1.65
日本	親投資信託受益証券	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	187,105,798	1.6262	304,281,800	1.6861	315,479,086	1.33
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	584,222,349	0.4160	243,047,449	0.3976	232,286,805	0.98
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)	174,843,950	0.899	157,200,882	0.906	158,408,618	0.67
日本	投資信託受益証券	F0Fs用日本株配当オープン(適格機関投資家専用)	118,604,163	1.1344	134,551,864	1.2117	143,712,664	0.61

(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。

□ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	61.01
投資証券	12.01
親投資信託受益証券	26.07
合計	99.09

(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
第3期計算期間末 (平成27年 7月10日)	23,204,975,199	23,204,975,199	10,550	10,550
平成26年 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	
12月末日	19,741,421,713		10,641	
平成27年 1月末日	20,580,704,832		10,681	
2月末日	20,769,799,121		10,768	
3月末日	21,297,913,026		10,779	
4月末日	21,530,807,105		10,877	
5月末日	22,121,174,982		10,880	
6月末日	22,191,276,307		10,680	

7月末日	23,692,445,593		10,678	
------	----------------	--	--------	--

【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
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27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
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	3.4

(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	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
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	6,829,705,615	1,125,034,771	21,994,421,398

(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	13,539,129,258	53.40
	ケイマン	956,675,911	3.77
	小計	14,495,805,169	57.18
投資証券	ルクセンブルク	2,274,815,892	8.97
親投資信託受益証券	日本	8,349,287,289	32.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		232,709,191	0.92
合計(純資産総額)		25,352,617,541	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、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	1,155,024,164	2.0771	2,399,133,054	2.1699	2,506,286,933	9.89
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)	2,163,350,929	1.0223	2,211,806,230	1.0257	2,218,949,047	8.75
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	692,421,864	2.8108	1,946,268,498	2.8753	1,990,920,585	7.85
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)	2,002,506,039	0.9661	1,934,700,045	0.9785	1,959,452,159	7.73
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)	1,311,793,822	1.3553	1,778,003,864	1.4092	1,848,579,853	7.29
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)	1,507,269,787	1.0139	1,528,326,067	1.0176	1,533,797,735	6.05
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies A, H, JPY Fund-Class D	782,420.818	1,920.65	1,502,764,323	1,939	1,517,113,966	5.98
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)	1,450,264,684	1.0343	1,500,049,410	1.042	1,511,175,800	5.96
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)	979,871,803	1.0267	1,006,061,106	1.0563	1,035,038,585	4.08
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	692,032,962	1.3745	951,208,057	1.4757	1,021,233,042	4.03
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	902,346.019	1,058.38	955,032,501	1,060.2	956,675,911	3.77
日本	投資信託受益証券	FOfs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)	790,969,503	1.1259	890,629,580	1.1674	923,377,797	3.64
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	689,964,094	1.3214	911,754,215	1.3247	913,995,435	3.61
日本	投資信託受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	763,661,478	0.9916	757,283,802	0.9929	758,239,481	2.99

ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	76,468,503	9,922.09	758,727,516	9,908.68	757,701,926	2.99
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	715,356,910	1.0358	740,998,921	1.0513	752,054,719	2.97
日本	投資信託受益証券	大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	674,936,800	1.0314	696,150,000	1.0338	697,749,663	2.75
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	400,261,089	1.6280	651,642,565	1.6861	674,880,222	2.66
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	1,232,183,988	0.4158	512,451,633	0.3976	489,916,353	1.93
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）	374,057,808	0.997	372,951,853	1.0022	374,880,735	1.48
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）	383,227,335	0.8963	343,504,610	0.906	347,203,965	1.37
日本	投資信託受益証券	FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	272,909,498	1.1362	310,096,192	1.2117	330,684,438	1.30

(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	57.18
投資証券	8.97
親投資信託受益証券	32.93
合計	99.08

(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
第3期計算期間末（平成27年 7月10日）	23,718,308,897	23,718,308,897	11,013	11,013
平成26年 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	
12月末日	16,661,856,314		11,117	
平成27年 1月末日	18,043,234,887		11,105	
2月末日	18,387,102,156		11,259	
3月末日	19,604,602,121		11,249	
4月末日	19,903,957,596		11,403	
5月末日	21,509,632,198		11,486	
6月末日	22,612,954,813		11,222	
7月末日	25,352,617,541		11,223	

【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
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27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
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27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
第3期計算期間	平成26年 7月11日～平成27年 7月10日	13,807,316,695	1,419,809,778	21,535,767,306

(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)

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	262,952,326,550	80.26
	ポーランド	201,626,000	0.06
	メキシコ	101,120,000	0.03
	小計	263,255,072,550	80.35
地方債証券	日本	19,426,312,713	5.93
特殊債券	日本	26,504,972,820	8.09
	アメリカ	208,922,000	0.06
	小計	26,713,894,820	8.15
社債券	日本	15,083,493,490	4.60
	アメリカ	505,629,000	0.15
	オーストラリア	503,046,000	0.15
	オランダ	404,874,000	0.12
	スウェーデン	302,241,000	0.09
	フランス	100,313,000	0.03
	小計	16,899,596,490	5.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,350,666,891	0.41
合計(純資産総額)		327,645,543,464	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	日本	147,550,000	0.05

(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	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	4,880,000,000	100.62	4,910,548,800	100.58	4,908,304,000	0.200	2019/6/20	1.50
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	4,900,000,000	100.13	4,906,664,000	100.13	4,906,370,000	0.100	2019/12/20	1.50
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	4,640,000,000	100.06	4,643,193,600	100.09	4,644,268,800	0.100	2020/3/20	1.42
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	4,520,000,000	100.64	4,549,108,800	100.57	4,546,170,800	0.200	2019/3/20	1.39
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	100.93	4,430,827,000	100.81	4,425,954,100	0.300	2018/6/20	1.35
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	4,240,000,000	100.62	4,266,372,800	100.57	4,264,422,400	0.200	2019/9/20	1.30
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	4,200,000,000	100.67	4,228,174,800	100.57	4,224,066,000	0.200	2018/12/20	1.29
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,680,000,000	100.08	3,683,050,600	100.13	3,685,115,200	0.400	2025/3/20	1.12
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	100.42	3,514,700,000	100.37	3,513,125,000	0.200	2017/6/20	1.07
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	3,260,000,000	100.47	3,275,354,600	100.41	3,273,529,000	0.200	2017/9/20	1.00
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	3,010,000,000	104.35	3,141,085,500	104.32	3,140,242,700	0.800	2022/9/20	0.96
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,040,000,000	101.28	3,079,137,400	101.37	3,081,678,400	0.500	2024/9/20	0.94
日本	国債証券	第355回利付国債(2年)	3,030,000,000	100.18	3,035,570,600	100.18	3,035,726,700	0.100	2017/8/15	0.93
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,950,000,000	102.32	3,018,646,500	102.32	3,018,676,000	0.600	2024/6/20	0.92
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	102.39	2,815,862,500	102.43	2,816,990,000	0.600	2024/3/20	0.86
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,700,000,000	102.50	2,767,500,000	102.53	2,768,445,000	0.600	2023/12/20	0.84
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	100.53	2,613,858,000	100.45	2,611,726,000	0.400	2016/9/20	0.80
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,540,000,000	102.75	2,609,977,000	102.77	2,610,408,800	0.600	2023/3/20	0.80
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	2,490,000,000	103.83	2,585,591,100	103.54	2,578,195,800	1.500	2017/12/20	0.79
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	100.55	2,513,925,000	100.48	2,512,175,000	0.300	2017/3/20	0.77
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	2,460,000,000	100.66	2,476,236,000	100.56	2,473,825,200	0.200	2018/9/20	0.76
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	2,330,000,000	105.75	2,464,068,200	105.57	2,459,897,500	1.000	2022/3/20	0.75
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,300,000,000	104.25	2,397,911,000	104.24	2,397,704,000	0.800	2023/6/20	0.73
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	104.21	2,334,483,200	104.21	2,334,416,000	0.800	2023/9/20	0.71
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,170,000,000	105.98	2,299,852,800	105.85	2,297,053,500	1.200	2020/12/20	0.70
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	100.48	2,290,944,000	100.41	2,289,416,400	0.300	2016/12/20	0.70

日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,160,000,000	105.60	2,281,024,800	105.36	2,275,948,800	1.300	2019/12/20	0.69
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	104.93	2,203,614,000	104.61	2,196,831,000	1.500	2018/9/20	0.67
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	103.92	2,172,011,600	103.60	2,165,386,300	1.700	2017/9/20	0.66
日本	国債証券	第324回利付国債（10年）	2,020,000,000	104.41	2,109,161,200	104.35	2,107,930,600	0.800	2022/6/20	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。

□.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	80.35
地方債証券	5.93
特殊債券	8.15
社債券	5.16
合計	99.59

(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（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1円		147,580,324	147,550,000	0.05

(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。

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	146,672,988,440	57.17
	イギリス	20,634,230,908	8.04
	スイス	10,633,686,006	4.14
	フランス	9,658,965,530	3.76
	ドイツ	9,469,396,595	3.69
	カナダ	9,225,731,133	3.60

	オーストラリア	6,368,186,069	2.48
	アイルランド	4,366,309,995	1.70
	オランダ	4,286,629,230	1.67
	スペイン	3,744,562,659	1.46
	スウェーデン	3,052,040,750	1.19
	香港	2,390,736,594	0.93
	イタリア	2,339,723,554	0.91
	デンマーク	1,815,291,930	0.71
	シンガポール	1,560,848,504	0.61
	ベルギー	1,387,809,314	0.54
	ジャージー	1,330,242,619	0.52
	バミューダ	1,019,739,564	0.40
	フィンランド	884,995,064	0.34
	キュラソー	858,010,718	0.33
	イスラエル	721,692,256	0.28
	ケイマン	669,630,470	0.26
	ノルウェー	609,861,697	0.24
	ルクセンブルク	386,366,902	0.15
	オーストリア	201,337,260	0.08
	パナマ	170,751,469	0.07
	ポルトガル	163,841,892	0.06
	ニュージーランド	141,668,950	0.06
	リベリア	114,433,226	0.04
	英ヴァージン諸島	72,725,942	0.03
	マン島	34,171,105	0.01
	モーリシャス	12,112,787	0.00
	小計	244,998,719,132	95.49
投資信託受益証券	オーストラリア	153,588,388	0.06
	香港	28,603,520	0.01
	シンガポール	24,281,450	0.01
	小計	206,473,358	0.08
投資証券	アメリカ	4,280,234,469	1.67
	オーストラリア	547,073,253	0.21
	イギリス	382,189,929	0.15
	フランス	366,925,450	0.14
	香港	105,362,800	0.04
	シンガポール	100,935,617	0.04
	カナダ	45,931,830	0.02
	小計	5,828,653,348	2.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,544,122,932	2.16
合計(純資産総額)		256,577,968,770	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	10,111,539,235	3.94
	買建	カナダ	725,963,427	0.28
	買建	ドイツ	2,763,074,104	1.08
	買建	イギリス	1,575,818,337	0.61
	買建	オーストラリア	813,895,264	0.32

(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		10,937,418,990	4.26

(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	379,610	16,328.62	6,198,509,564	15,178.77	5,762,014,702	2.25
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	507,712	5,879.49	2,985,090,673	5,814.99	2,952,342,843	1.15
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	272,393	10,554.56	2,874,989,243	10,296.56	2,804,710,977	1.09
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	317,787	6,974.76	2,216,490,980	7,212.92	2,292,174,115	0.89
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	180,521	12,536.72	2,263,141,737	12,384.15	2,235,599,792	0.87
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	653,433	3,424.74	2,237,841,008	3,239.92	2,117,073,782	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	242,036	8,217.64	1,988,967,135	8,563.72	2,072,728,921	0.81
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	209,439	9,437.53	1,976,588,542	9,346.50	1,957,523,498	0.76

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	149,393	12,604.32	1,882,997,940	12,821.00	1,915,367,653	0.75
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	397,780	4,269.45	1,698,304,526	4,431.94	1,762,940,753	0.69
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	395,093	4,288.70	1,694,436,959	4,316.59	1,705,455,283	0.66
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	25,614	52,915.46	1,355,376,695	66,579.71	1,705,372,702	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	175,279	9,842.57	1,725,196,528	9,599.45	1,682,582,978	0.66
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	45,623	36,151.37	1,649,334,122	35,732.12	1,630,206,830	0.64
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	20,011	66,914.61	1,339,028,429	78,466.46	1,570,192,403	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	269,667	6,136.25	1,654,746,502	5,788.94	1,561,087,917	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	104,774	13,712.62	1,436,726,257	14,888.52	1,559,929,920	0.61
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	131,010	9,946.76	1,303,126,023	11,809.84	1,547,208,239	0.60
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	18,676	68,711.95	1,283,264,527	82,432.02	1,539,500,450	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	682,616	2,070.22	1,413,170,483	2,248.84	1,535,097,715	0.60
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	196,847	6,772.58	1,333,162,843	7,303.47	1,437,667,183	0.56
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,266,187	1,203.19	1,523,472,146	1,116.34	1,413,498,030	0.55
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	96,637	14,020.24	1,354,874,049	14,624.31	1,413,250,025	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	121,993	12,792.24	1,560,564,368	11,539.44	1,407,731,050	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	269,118	5,099.28	1,372,309,219	5,031.06	1,353,949,451	0.53
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	184,132	7,397.74	1,362,161,693	7,258.82	1,336,581,192	0.52
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	74,941	17,934.94	1,344,062,608	17,719.11	1,327,888,122	0.52
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	85,480	13,908.60	1,188,907,572	14,445.69	1,234,818,299	0.48
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	61,107	21,281.54	1,300,451,236	19,965.47	1,220,030,489	0.48
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	127,762	8,624.50	1,101,883,522	9,474.17	1,210,439,572	0.47

(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	7.27
		素材	4.55
		資本財	6.82
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.78
		消費者サービス	1.76
		メディア	3.15
		小売	3.66
		食品・生活必需品小売り	2.15
		食品・飲料・タバコ	5.75
		家庭用品・パーソナル用品	2.07
		ヘルスケア機器・サービス	3.54
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.46
		銀行	9.41
		各種金融	4.11
		保険	4.29
		不動産	0.71
		ソフトウェア・サービス	7.55
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.27
		電気通信サービス	3.12
公益事業	3.01		
半導体・半導体製造装置	1.61		
	小計	95.49	
投資信託受益証券		0.08	
投資証券		2.27	
合計		97.84	

(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	155	アメリカドル	81,084,247.5	10,057,690,060	81,518,375	10,111,539,235	3.94
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	45	カナダドル	7,593,902.5	724,989,872	7,604,100	725,963,427	0.28

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	65	スイスフラン	6,024,315	772,377,426	6,094,400	781,363,024	0.30
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	408	ユーロ	14,439,096	1,960,107,282	14,598,240	1,981,711,080	0.77
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	64	オーストラリアドル	8,916,473	807,921,619	8,982,400	813,895,264	0.32
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	123	イギリス債券	8,110,416.25	1,568,878,919	8,146,290	1,575,818,337	0.61

(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	56,600,000.00	7,020,198,000	7,020,098,000	2.73
	カナダドル	買建	3,527,000.00	336,659,204	336,687,420	0.13
	ユーロ	買建	10,400,000.00	1,411,874,100	1,411,800,000	0.55
	イギリス債券	買建	4,876,000.00	943,116,988	943,115,920	0.36
	スイスフラン	買建	3,448,000.00	442,062,340	442,101,160	0.17
	スウェーデンクローナ	買建	9,330,000.00	134,370,660	134,352,000	0.05
	ノルウェークローネ	買建	2,114,000.00	32,162,396	32,153,940	0.01
	デンマーククローネ	買建	4,877,000.00	88,765,815	88,712,630	0.03
	オーストラリアドル	買建	3,467,000.00	314,027,275	314,040,860	0.12
	香港ドル	買建	9,158,000.00	146,528,000	146,436,420	0.05
	シンガポールドル	買建	752,000.00	67,912,368	67,920,640	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	93,422,739,014	41.77
	イタリア	21,299,456,551	9.52
	フランス	21,000,633,545	9.39
	イギリス	18,905,181,804	8.45
	ドイツ	16,594,260,337	7.42
	スペイン	11,563,283,309	5.17

オランダ	5,644,301,935	2.52
ベルギー	5,583,947,825	2.50
カナダ	4,643,482,342	2.08
オーストラリア	3,517,581,574	1.57
オーストリア	3,506,199,410	1.57
メキシコ	2,152,348,688	0.96
アイルランド	1,729,464,338	0.77
デンマーク	1,517,430,950	0.68
フィンランド	1,278,803,778	0.57
ポーランド	1,255,182,590	0.56
マレーシア	1,169,767,149	0.52
南アフリカ	1,131,801,783	0.51
スウェーデン	1,046,346,693	0.47
シンガポール	842,469,653	0.38
スイス	688,092,454	0.31
ノルウェー	628,902,618	0.28
小計	219,121,678,340	97.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	4,544,853,111	2.03
合計(純資産総額)	223,666,531,451	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	550,857,763	0.25
	買建	ドイツ	857,257,177	0.38

(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		2,003,844,600	0.89

(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 0.75% 01/15/17	12,000,000	12,452.45	1,494,294,375	12,439.61	1,492,753,560	0.750	2017/1/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/30/17	11,600,000	12,456.96	1,445,007,949	12,451.48	1,444,372,157	0.875	2017/4/30	0.65
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	10,250,000	12,767.91	1,308,711,425	12,812.45	1,313,277,136	3.125	2044/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	12,475.95	1,247,595,288	12,461.90	1,246,190,150	0.875	2017/1/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	10,000,000	12,429.92	1,242,992,238	12,419.74	1,241,974,725	0.625	2016/12/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	12,275.24	1,227,524,648	12,283.83	1,228,383,625	0.625	2018/4/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	10,000,000	12,276.04	1,227,604,034	12,281.65	1,228,165,586	1.375	2020/4/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	12,933.59	1,228,691,298	12,874.23	1,223,052,574	3.000	2017/2/28	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	13,011.60	1,184,055,804	12,961.21	1,179,470,200	2.750	2017/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	9,100,000	13,087.78	1,190,988,452	12,948.12	1,178,279,704	2.750	2024/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	9,300,000	12,309.72	1,144,804,852	12,206.55	1,135,209,474	2.875	2043/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3% 08/31/16	8,700,000	12,806.88	1,114,199,233	12,752.86	1,109,499,037	3.000	2016/8/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	12,254.27	1,102,885,188	12,235.86	1,101,228,086	1.000	2019/6/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.875% 08/15/17	8,800,000	12,448.57	1,095,474,765	12,433.79	1,094,174,279	0.875	2017/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	12,684.05	1,078,145,025	12,545.96	1,066,407,248	2.375	2024/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	12,824.33	1,077,243,793	12,689.63	1,065,929,014	2.500	2024/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	8,520,000	12,288.43	1,046,975,023	12,249.43	1,043,651,819	1.250	2020/1/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	8,000,000	12,928.02	1,034,241,640	12,870.84	1,029,667,670	2.750	2017/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	12,267.22	1,030,447,140	12,127.33	1,018,695,940	2.000	2025/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	8,150,000	12,535.55	1,021,647,345	12,404.72	1,010,985,229	2.250	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/44	7,500,000	13,558.15	1,016,861,513	13,431.44	1,007,358,637	3.375	2044/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	7,900,000	12,721.61	1,005,007,210	12,688.17	1,002,366,032	1.875	2017/8/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.5% 05/31/19	8,000,000	12,472.59	997,807,530	12,471.59	997,727,370	1.500	2019/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	7,900,000	12,500.42	987,533,317	12,483.70	986,212,724	1.000	2016/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	12,543.54	940,765,875	12,506.47	937,985,878	1.625	2019/8/31	0.42
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 03/01/20	5,800,000	15,619.61	905,937,738	15,723.85	911,983,568	4.250	2020/3/1	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/16	7,300,000	12,440.33	908,144,810	12,431.37	907,490,447	0.625	2016/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	6,900,000	13,108.02	904,453,646	12,971.14	895,008,927	2.750	2023/11/15	0.40
イギリス	国債証券	UKT 4.75% 03/07/20	3,950,000	22,491.26	888,405,118	22,260.68	879,297,189	4.750	2020/3/7	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/31/17	7,000,000	12,377.59	866,431,510	12,366.69	865,668,379	0.625	2017/8/31	0.39

(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。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.97
合計	97.97

(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	19	アメリカドル	2,267,943.19	281,315,673	2,269,906.25	281,559,171	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	11	アメリカドル	1,390,794.01	172,514,089	1,395,281.25	173,070,686	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	5	アメリカドル	753,082.5	93,412,353	775,781.25	96,227,906	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	11	ユーロ	1,224,219	166,187,729	1,224,410	166,213,657	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	13	ユーロ	1,687,872	229,128,624	1,694,420	230,017,515	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	22	ユーロ	3,355,468	455,504,781	3,396,140	461,026,005	0.21

(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	7,870,000.00	974,297,079	976,037,400	0.43
	カナダドル	買建	900,000.00	86,266,298	85,896,000	0.03
	ユーロ	買建	5,400,000.00	732,214,031	733,050,000	0.32
	イギリスポンド	買建	1,080,000.00	208,727,635	208,861,200	0.09

(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 - R E I T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	58,617,744,000	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		592,849,069	1.00
合計(純資産総額)		59,210,593,069	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	587,673,000	0.99

(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	7,928	578,564.8	4,586,861,757	554,000	4,392,112,000	7.42
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	7,352	566,100.21	4,161,968,771	556,000	4,087,712,000	6.90
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	13,645	226,917.88	3,096,294,567	243,000	3,315,735,000	5.60
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	14,847	183,746.4	2,728,082,925	180,000	2,672,460,000	4.51
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	9,718	253,557.41	2,464,070,976	244,500	2,376,051,000	4.01
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	12,553	161,344.11	2,025,352,663	168,800	2,118,946,400	3.58
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	7,299	280,329.46	2,046,124,742	270,500	1,974,379,500	3.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	4,902	401,996.86	1,970,588,635	401,500	1,968,153,000	3.32
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	7,412	205,594	1,523,862,734	230,300	1,706,983,600	2.88
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,718	602,364.27	1,637,226,097	612,000	1,663,416,000	2.81
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,556	974,503.94	1,516,328,135	1,042,000	1,621,352,000	2.74
日本	投資証券	GLP投資法人	13,423	131,342.04	1,763,004,210	119,300	1,601,363,900	2.70
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	2,785	517,010.75	1,439,874,961	540,000	1,503,900,000	2.54
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	17,632	75,053.12	1,323,336,713	80,200	1,414,086,400	2.39
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	9,350	147,824.25	1,382,156,817	148,900	1,392,215,000	2.35
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,273	619,163.64	1,407,358,974	574,000	1,304,702,000	2.20
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	8,815	157,756.63	1,390,624,721	145,300	1,280,819,500	2.16
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,720	418,678.03	1,138,804,242	440,500	1,198,160,000	2.02
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	17,792	47,748.81	849,546,996	66,000	1,174,272,000	1.98
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	2,092	498,443.04	1,042,742,858	530,000	1,108,760,000	1.87
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4,198	251,172.63	1,054,422,723	261,500	1,097,777,000	1.85
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,980	524,136.43	1,037,790,133	552,000	1,092,960,000	1.85
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	4,660	251,310.2	1,171,105,560	233,500	1,088,110,000	1.84

日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,969	533,870.42	1,051,190,874	489,000	962,841,000	1.63
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	7,073	145,624.56	1,030,002,534	135,800	960,513,400	1.62
日本	投資証券	プレミアム投資法人	1,479	539,392.49	797,761,506	649,000	959,871,000	1.62
日本	投資証券	イオンリート投資法人	6,121	157,703.31	965,302,000	149,000	912,029,000	1.54
日本	投資証券	福岡リート投資法人	4,194	206,068.86	864,252,836	208,500	874,449,000	1.48
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	5,489	151,200.18	829,937,822	143,200	786,024,800	1.33
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	9,209	79,145.77	728,853,457	82,100	756,058,900	1.28

(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	99.00
合計	99.00

(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 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	334円		599,601,200	587,673,000	0.99

(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	39,769,037,653	69.89
	オーストラリア	4,473,671,569	7.86
	イギリス	4,127,856,786	7.25
	フランス	2,791,485,419	4.91
	シンガポール	1,850,647,463	3.25
	カナダ	1,118,121,789	1.96
	香港	965,620,960	1.70

	オランダ	322,156,864	0.57
	ベルギー	299,017,312	0.53
	スペイン	286,749,244	0.50
	ニュージーランド	248,160,539	0.44
	アイルランド	140,882,962	0.25
	ドイツ	95,905,751	0.17
	イタリア	57,940,491	0.10
	マン島	42,405,926	0.07
	イスラエル	25,620,420	0.05
	小計	56,615,281,148	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		286,958,596	0.50
合計(純資産総額)		56,902,239,744	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		202,684,700	0.35

(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	142,530	22,466.52	3,202,154,277	23,088.80	3,290,847,462	5.78
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	66,270	23,314.49	1,545,051,901	25,182.60	1,668,850,955	2.93
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	166,090	8,779.72	1,458,224,957	9,214.93	1,530,507,989	2.69
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	44,940	28,596.40	1,285,122,432	33,197.66	1,491,902,953	2.62
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	160,300	8,895.63	1,425,970,103	8,535.19	1,368,191,342	2.40
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	60,720	19,861.80	1,206,008,614	21,239.36	1,289,654,498	2.27
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	152,050	8,628.58	1,311,976,713	8,231.29	1,251,568,314	2.20
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	239,470	5,147.39	1,232,645,656	4,986.40	1,194,095,124	2.10
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	70,120	16,009.49	1,122,585,925	15,299.09	1,072,772,443	1.89
アメリカ	投資証券	HCP INC	211,180	5,307.90	1,120,923,800	4,744.52	1,001,949,845	1.76
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	287,910	3,251.97	936,276,299	3,336.67	960,662,387	1.69
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	80,060	12,423.47	994,623,452	11,961.17	957,611,847	1.68

イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	366,640	2,217.54	813,039,188	2,481.83	909,940,058	1.60
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,437,420	327.54	798,361,321	358.81	874,584,320	1.54
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	346,770	2,772.10	961,282,365	2,424.98	840,911,008	1.48
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	29,920	25,583.69	765,464,293	27,757.67	830,509,522	1.46
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	876,040	760.20	665,969,936	905.19	792,986,064	1.39
香港	投資証券	LINK REIT	1,055,000	746.42	787,479,027	719.20	758,756,000	1.33
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	469,060	1,455.92	682,917,871	1,604.58	752,646,546	1.32
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	45,220	14,423.13	652,214,166	14,166.60	640,614,032	1.13
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	106,180	5,873.59	623,657,837	5,905.54	627,050,704	1.10
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	64,290	8,972.66	576,852,791	9,685.04	622,651,427	1.09
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	187,780	3,095.67	581,305,864	3,032.77	569,495,053	1.00
フランス	投資証券	KLEPIERRE	97,100	5,150.98	500,160,311	5,675.70	551,111,198	0.97
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	31,420	16,635.22	522,678,722	16,938.90	532,220,313	0.94
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	62,860	8,398.97	527,959,855	8,017.94	504,008,060	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	119,990	3,822.42	458,652,830	4,145.41	497,408,562	0.87
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	50,950	7,466.57	380,422,237	9,033.83	460,273,802	0.81
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	357,720	1,196.33	427,953,746	1,267.03	453,242,687	0.80
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	410,470	1,099.29	451,226,340	1,066.74	437,866,410	0.77

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.50
合計	99.50

(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	990,000.00	122,826,200	122,789,700	0.21
	ユーロ	買建	70,000.00	9,501,730	9,502,500	0.01
	イギリスポンド	買建	170,000.00	32,880,210	32,881,400	0.05
	オーストラリアドル	買建	200,000.00	18,115,000	18,116,000	0.03
	ニュージーランドドル	買建	40,000.00	3,279,880	3,280,000	0.00
	香港ドル	買建	330,000.00	5,280,000	5,276,700	0.00
	シンガポールドル	買建	120,000.00	10,837,080	10,838,400	0.01

(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	13,805,776,040	47.04
	アイルランド	10,241,275,772	34.90
	ジャージー	3,730,065,759	12.71
	アメリカ	1,157,865,520	3.95
	小計	28,934,983,091	98.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		412,237,811	1.40
合計(純資産総額)		29,347,220,902	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(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 001 04/18/16	91,000,000	12,256.47	11,153,391,508	11,254.14	10,241,275,772	0.000	2016/4/18	34.90
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	320,250,000	1,290.01	4,131,276,240	1,164.73	3,730,065,759	0.000	9999/99/99	12.71
イギリス	社債券	CS USD COM 011 01/29/16	18,000,000	12,505.71	2,251,028,304	11,305.00	2,034,901,008	0.000	2016/1/29	6.93
イギリス	社債券	BAR USD COM 031 10/30/15	20,000,000	10,884.75	2,176,951,616	9,845.79	1,969,159,808	0.000	2015/10/30	6.71
イギリス	社債券	CS USD COM 010 10/27/15	20,000,000	10,855.98	2,171,196,160	9,814.04	1,962,808,960	0.000	2015/10/27	6.69
イギリス	社債券	UBS USD COM 008 09/25/15	20,000,000	10,338.73	2,067,746,800	9,343.93	1,868,786,640	0.000	2015/9/25	6.37
イギリス	社債券	UBS USD COM 009 11/27/15	17,000,000	11,417.88	1,941,039,940	10,321.36	1,754,632,628	0.000	2015/11/27	5.98
イギリス	社債券	UBS USD COM 007 08/12/15	17,000,000	9,948.00	1,691,161,360	8,990.41	1,528,371,264	0.000	2015/8/12	5.21
イギリス	社債券	CS USD COM 009 08/28/15	15,000,000	10,125.38	1,518,807,780	9,152.91	1,372,936,740	0.000	2015/8/28	4.68
イギリス	社債券	BAR USD COM 032 2/26/16	12,000,000	12,101.09	1,452,131,319	10,951.49	1,314,178,992	0.000	2016/2/26	4.48
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	35,930,000	3,614.52	1,298,699,047	3,222.55	1,157,865,520	0.000	2036/6/12	3.95

(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	98.60
合計	98.60

(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。

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	16,543,642,500	96.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		612,870,879	3.57
合計(純資産総額)		17,156,513,379	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	SIGNUM SIGMA2 0% 05/12/25	15,750,000,000	107.71	16,964,928,800	105.03	16,543,642,500	0.000	2025/5/12	96.43

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
社債券	96.43
合計	96.43

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

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：2015年7月31日

分散投資コア戦略ファンドA**基準価額・純資産の推移**

基準価額 10,678円

純資産総額 236.92億円

※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)

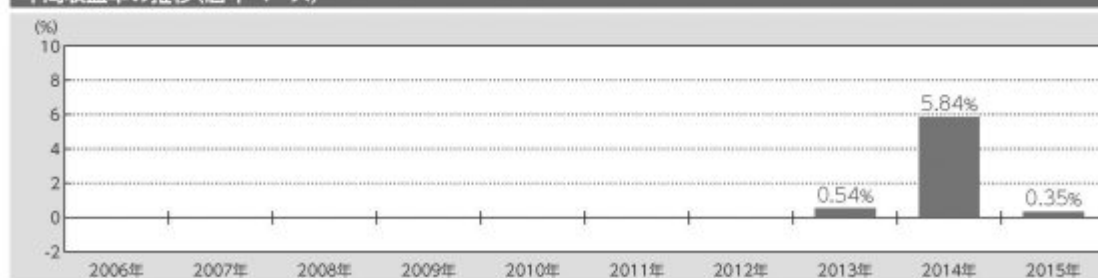
設定来分配金合計額:0円

決算期	2013年7月	2014年7月	2015年7月	—	—
分配金	0円	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)	11.8%
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)	11.8%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{HL} JPY	8.0%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	8.0%
HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス	7.4%
国内債券インデックス マザーファンド	7.1%
外国株式インデックス マザーファンド	6.0%
外国債券インデックス マザーファンド	4.7%
FOFs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用)	4.7%
FRM シグマリンク マザーファンド	4.0%

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、2015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：2015年7月31日

分散投資コア戦略ファンドS

基準価額・純資産の推移



※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

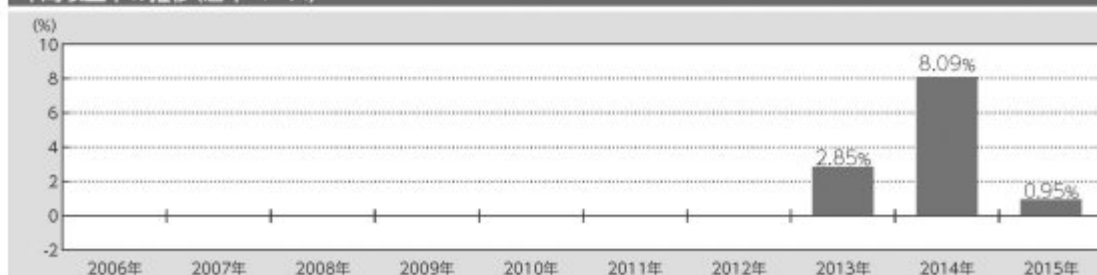
決算期	2013年7月	2014年7月	2015年7月	—	—
分配金	0円	0円	0円	—	—

※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	9.9%
FOFs用FRM ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	8.8%
外国債券インデックス マザーファンド	7.9%
FOFs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用)	7.7%
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)	7.3%
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)	6.0%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{A.H.} JPY	6.0%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6.0%
FOFs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用)	4.1%
J-REITインデックス マザーファンド	4.0%

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、2015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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係

とします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

イ．内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

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

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

ハ．外国投資信託証券

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

ニ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ホ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

（ロ）外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

（ハ）公社債等（仕組債を含みます。）

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

（ニ）信用取引

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

ヘ．外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（平成25年 3月29日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

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

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

上記の書面決議は議決権を行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。

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（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は除きます。）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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

上記 の書面決議は議決権を行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。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 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れている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【分散投資コア戦略ファンドA】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(平成26年7月11日から平成27年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成26年7月10日現在)	第3期 (平成27年7月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	184,536,443	333,581,579
投資信託受益証券	8,637,205,406	14,043,414,126
投資証券	1,478,218,280	2,814,637,067
親投資信託受益証券	6,361,329,058	6,193,145,407
未収入金	2,710,963	5,785,148
未収利息	239	519
流動資産合計	16,664,000,389	23,390,563,846
資産合計	16,664,000,389	23,390,563,846
負債の部		
流動負債		
未払金	1,200,000	-
未払解約金	10,735,209	47,832,052
未払受託者報酬	958,321	5,716,045
未払委託者報酬	22,041,318	131,469,002
その他未払費用	95,771	571,548
流動負債合計	35,030,619	185,588,647
負債合計	35,030,619	185,588,647
純資産の部		
元本等		
元本	16,289,750,554	21,994,421,398
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	339,219,216	1,210,553,801
(分配準備積立金)	114,680,242	602,825,087
元本等合計	16,628,969,770	23,204,975,199
純資産合計	16,628,969,770	23,204,975,199
負債純資産合計	16,664,000,389	23,390,563,846

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日	自	平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日
営業収益				
受取配当金		-		20,675,700
受取利息		27,613		100,460
有価証券売買等損益		144,718,691		774,572,143
営業収益合計		144,746,304		795,348,303
営業費用				
受託者報酬		1,201,312		10,667,022
委託者報酬		27,630,076		245,341,437
その他費用		120,010		1,066,585
営業費用合計		28,951,398		257,075,044
営業利益又は営業損失（ ）		115,794,906		538,273,259
経常利益又は経常損失（ ）		115,794,906		538,273,259
当期純利益又は当期純損失（ ）		115,794,906		538,273,259
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,499,335		43,613,945
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,994,868		339,219,216
剰余金増加額又は欠損金減少額		230,918,513		405,753,523
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,140,547		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		227,777,966		405,753,523
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		29,078,252
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		29,078,252
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		339,219,216		1,210,553,801

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 (平成26年 7月10日現在)	第3期 (平成27年 7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	16,289,750,554口	21,994,421,398口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.0208円 (1万口当たり純資産額) (10,208円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.0550円 (1万口当たり純資産額) (10,550円)</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日	第3期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日													
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="172 1966 754 2058"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>17,125,870円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	17,125,870円	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="834 1966 1417 2058"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>90,008,579円</td> </tr> </tbody> </table>		項目			費用控除後の配当等収益額	A	90,008,579円
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	17,125,870円												
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	90,008,579円												

第2期 自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日			第3期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日		
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	96,169,701円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	404,650,735円
収益調整金額	C	224,538,974円	収益調整金額	C	607,728,714円
分配準備積立金額	D	1,384,671円	分配準備積立金額	D	108,165,773円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	339,219,216円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,210,553,801円
当ファンドの期末残存口数	F	16,289,750,554口	当ファンドの期末残存口数	F	21,994,421,398口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	208円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	550円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第3期 (平成27年 7月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	第3期 (平成27年 7月10日現在)
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第2期 自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日	第3期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	263,825,167円	16,289,750,554円
期中追加設定元本額	16,300,810,769円	6,829,705,615円
期中一部解約元本額	274,885,382円	1,125,034,771円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 (平成26年 7月10日現在)	第3期 (平成27年 7月10日現在)
		計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

投資信託受益証券	59,969,768	53,208,824
投資証券	10,593,898	89,462,790
親投資信託受益証券	67,840,884	423,590,050
合計	138,404,550	566,261,664

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	F0Fs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)	358,554,030	403,265,717	
	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)	163,120,287	146,840,882	
	TCAファンド(適格機関投資家専用)	928,152,143	920,355,664	
	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)	1,794,449,487	1,855,460,769	
	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)	2,684,032,434	2,721,072,081	
	F0Fs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投 資家専用)	1,302,586,416	1,258,037,960	
	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格 機関投資家専用)	581,581,426	787,286,776	
	F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資 家専用)	685,977,202	683,850,672	

	FOfs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用)	550,687,952	563,684,187
	FOfs用日本株配当オープン(適格機関投資家専用)	126,925,576	143,971,680
	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)	2,735,430,275	2,796,156,827
	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	1,666,244.533	1,763,430,911
投資信託受益証券合計		11,913,163,472.533	14,043,414,126
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund- Class D ^{A, H, JPY}	977,540.352	1,876,877,475
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	94,505.923	937,759,592
投資証券合計		1,072,046.275	2,814,637,067
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	306,079,606	419,726,963
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	186,680,893	303,561,800
	外国株式インデックス マザーファンド	664,284,641	1,377,527,060
	国内債券インデックス マザーファンド	1,264,572,225	1,671,005,738
	外国債券インデックス マザーファンド	453,884,735	1,274,054,451
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	557,839,370	232,507,449
	FRMシグマ リンク マザーファンド	883,827,968	914,761,946
親投資信託受益証券合計		4,317,169,438	6,193,145,407
合計			23,051,196,600

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【分散投資コア戦略ファンドS】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(平成26年7月11日から平成27年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成26年7月10日現在)	第3期 (平成27年7月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	124,206,548	370,598,755
投資信託受益証券	3,422,939,833	13,247,319,991
投資証券	660,126,180	2,171,081,839
親投資信託受益証券	5,393,695,327	8,084,221,389
未収利息	161	577
流動資産合計	9,600,968,049	23,873,222,551
資産合計	9,600,968,049	23,873,222,551
負債の部		
流動負債		
未払金	850,000	12,800,000
未払解約金	9,252,151	13,871,208
未払受託者報酬	1,254,037	5,321,268
未払委託者報酬	28,842,644	122,389,118
その他未払費用	125,345	532,060
流動負債合計	40,324,177	154,913,654
負債合計	40,324,177	154,913,654
純資産の部		
元本等		
元本	9,148,260,389	21,535,767,306
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	412,383,483	2,182,541,591
(分配準備積立金)	205,444,005	651,855,327
元本等合計	9,560,643,872	23,718,308,897
純資産合計	9,560,643,872	23,718,308,897
負債純資産合計	9,600,968,049	23,873,222,551

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日	自	平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日
営業収益				
受取配当金		-		14,335,865
受取利息		22,736		101,666
有価証券売買等損益		244,401,614		737,563,446
営業収益合計		244,424,350		752,000,977
営業費用				
受託者報酬		1,494,304		8,969,566
委託者報酬		34,368,599		206,299,833
その他費用		149,315		896,826
営業費用合計		36,012,218		216,166,225
営業利益又は営業損失（ ）		208,412,132		535,834,752
経常利益又は経常損失（ ）		208,412,132		535,834,752
当期純利益又は当期純損失（ ）		208,412,132		535,834,752
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		3,190,730		71,793,131
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		463,281		412,383,483
剰余金増加額又は欠損金減少額		208,845,900		1,392,896,731
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		208,845,900		1,392,896,731
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,220,538		86,780,244
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,220,538		86,780,244
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		412,383,483		2,182,541,591

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 (平成26年 7月10日現在)	第3期 (平成27年 7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,148,260,389口	21,535,767,306口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.0451円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (10,451円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.1013円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (11,013円)</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日	第3期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日													
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="172 1966 754 2060"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>39,849,365円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	39,849,365円	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="834 1966 1417 2060"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>113,429,299円</td> </tr> </tbody> </table>		項目			費用控除後の配当等収益額	A	113,429,299円
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	39,849,365円												
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	113,429,299円												

第2期 自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日			第3期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日		
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	165,372,037円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	350,612,322円
収益調整金額	C	206,939,478円	収益調整金額	C	1,530,686,264円
分配準備積立金額	D	222,603円	分配準備積立金額	D	187,813,706円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	412,383,483円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,182,541,591円
当ファンドの期末残存口数	F	9,148,260,389口	当ファンドの期末残存口数	F	21,535,767,306口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	450円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,013円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第3期 (平成27年 7月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	第3期 (平成27年 7月10日現在)
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第2期	第3期
	自 平成25年 7月11日 至 平成26年 7月10日	自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	54,750,331円	9,148,260,389円
期中追加設定元本額	9,258,266,615円	13,807,316,695円
期中一部解約元本額	164,756,557円	1,419,809,778円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 (平成26年 7月10日現在)	第3期 (平成27年 7月10日現在)
		計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

投資信託受益証券	55,406,351	78,649,588
投資証券	9,555,483	47,793,772
親投資信託受益証券	172,020,163	408,263,876
合計	236,981,997	534,707,236

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	F0Fs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)	767,359,812	863,049,580	
	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)	336,874,706	303,254,610	
	TCAファンド(適格機関投資家専用)	715,181,326	709,173,802	
	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)	1,381,827,283	1,428,809,410	
	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)	1,416,695,667	1,436,246,067	
	F0Fs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投 資家専用)	2,187,911,344	2,113,084,776	
	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格 機関投資家専用)	1,271,828,222	1,721,673,864	
	F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資 家専用)	362,294,968	361,171,853	

	FOfs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用)	913,805,301	935,371,106
	FOfs用日本株配当オープン(適格機関投資家専用)	265,437,885	301,086,192
	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)	2,102,138,750	2,148,806,230
	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	874,581.156	925,592,501
投資信託受益証券合計		11,722,229,845.156	13,247,319,991
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund- Class D ^{A, H, JPY}	754,960.585	1,449,524,323
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	72,717.421	721,557,516
投資証券合計		827,678.006	2,171,081,839
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	649,025,055	890,008,057
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	388,095,791	631,082,565
	外国株式インデックス マザーファンド	1,120,541,028	2,323,665,929
	国内債券インデックス マザーファンド	667,711,681	882,314,215
	外国債券インデックス マザーファンド	773,145,732	2,170,220,069
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	1,161,328,295	484,041,633
	FRMシグマ リンク マザーファンド	679,119,731	702,888,921
親投資信託受益証券合計		5,438,967,313	8,084,221,389
合計			23,502,623,219

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「分散投資コア戦略ファンドA」、「分散投資コア戦略ファンドS」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」、「グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド」、「FRM シグマ リンク マザーファンド」の受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成27年 7月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,108,554,129
国債証券	261,215,411,250
地方債証券	19,530,961,390
特殊債証券	26,261,717,773
社債証券	16,689,342,400
派生商品評価勘定	799,352
未収入金	104,159,000
未収利息	731,091,062
前払費用	26,954,658
差入委託証拠金	160,000
流動資産合計	325,669,151,014
資産合計	325,669,151,014
負債の部	
流動負債	
前受金	800,000
未払金	300,366,000
未払解約金	304,336,298
流動負債合計	605,502,298
負債合計	605,502,298
純資産の部	
元本等	
元本	246,004,897,539
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	79,058,751,177
元本等合計	325,063,648,716
純資産合計	325,063,648,716
負債純資産合計	325,669,151,014

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成27年 7月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成27年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	246,004,897,539口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 105,918,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3214円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,214円)</p>

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

平成27年 7月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 7月11日
期首元本額	203,089,216,360円
期中追加設定元本額	64,854,245,461円
期中一部解約元本額	21,938,564,282円
期末元本額	246,004,897,539円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,163,133,984円
S B I 資産設計オープン（分配型）	18,971,947円
S M T 国内債券インデックス・オープン	6,860,071,670円
世界経済インデックスファンド	407,032,300円
マイセレクション2 5	79,995,825円
マイセレクション5 0	87,954,578円
マイセレクション7 5	26,371,191円
D C マイセレクション2 5	13,964,068,254円
D C マイセレクション5 0	17,348,004,741円
D C マイセレクション7 5	4,966,912,044円
D C 日本債券インデックス・オープン	416,867,951円
D C 日本債券インデックス・オープン S	56,587,815,142円
D C 日本債券インデックス・オープン P	21,531,708,785円
D C マイセレクション S 2 5	5,624,723,964円
D C マイセレクション S 5 0	6,463,518,036円
D C マイセレクション S 7 5	1,263,603,664円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 1 5	11,207,686円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,224,121,061円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	676,399,360円

区分	平成27年 7月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	175,103,711円
DC世界経済インデックスファンド	347,342,830円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,170,697,606円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	22,981,804円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	203,385,953円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	30,107,179円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	975,740円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	787,291,493円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,099,004,977円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	1,182,702,154円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	341,748,163円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	12,448,609,398円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,653,854,113円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	6,106,130,805円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,505,919,819円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,463,942,322円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,273,936,658円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,970,360,955円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,479,674,683円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,376,732,185円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	236,847,942円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,865,165,942円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,218,585,942円
コア投資戦略ファンド（安定型）	8,523,027,332円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,784,252,741円
分散投資コア戦略ファンドA	1,264,572,225円
分散投資コア戦略ファンドS	667,711,681円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	8,551,458円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	124,680,526円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	33,171,543,890円
コア投資戦略ファンド（切替型）	879,369,821円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	36,621,543円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	28,764,072円
SMT インデックスバランス・オープン	45,030,954円
債券コア戦略ファンド	91,061円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	784,868,438円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

国債証券	336,337,250
地方債証券	33,426,603
特殊債券	41,454,981
社債券	23,944,020
合計	435,162,854

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成27年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	293,660,648	-	294,460,000	799,352
	合計	293,660,648	-	294,460,000	799,352

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第343回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,301,404,000	
	第344回利付国債(2年)	1,560,000,000	1,561,825,200	
	第345回利付国債(2年)	2,060,000,000	2,062,575,000	
	第346回利付国債(2年)	590,000,000	590,784,700	
	第349回利付国債(2年)	1,850,000,000	1,852,941,500	
	第350回利付国債(2年)	1,030,000,000	1,031,709,800	
	第351回利付国債(2年)	130,000,000	130,227,500	
	第353回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,603,072,000	
	第354回利付国債(2年)	200,000,000	200,378,000	
	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	2,612,324,000	

第100回利付国債（5年）	490,000,000	491,739,500	
第101回利付国債（5年）	950,000,000	955,453,000	
第102回利付国債（5年）	2,280,000,000	2,289,804,000	
第103回利付国債（5年）	2,500,000,000	2,512,600,000	
第104回利付国債（5年）	810,000,000	812,721,600	
第105回利付国債（5年）	3,500,000,000	3,513,510,000	
第106回利付国債（5年）	3,260,000,000	3,273,529,000	
第107回利付国債（5年）	1,120,000,000	1,125,040,000	
第108回利付国債（5年）	590,000,000	591,215,400	
第109回利付国債（5年）	1,190,000,000	1,192,546,600	
第110回利付国債（5年）	700,000,000	705,250,000	
第111回利付国債（5年）	1,590,000,000	1,606,186,200	
第112回利付国債（5年）	900,000,000	909,891,000	
第113回利付国債（5年）	4,390,000,000	4,425,383,400	
第114回利付国債（5年）	1,210,000,000	1,220,393,900	
第115回利付国債（5年）	2,660,000,000	2,674,390,600	
第116回利付国債（5年）	4,200,000,000	4,223,772,000	
第117回利付国債（5年）	4,520,000,000	4,545,718,800	
第118回利付国債（5年）	4,880,000,000	4,907,767,200	
第119回利付国債（5年）	700,000,000	701,232,000	
第120回利付国債（5年）	4,240,000,000	4,262,980,800	
第121回利付国債（5年）	530,000,000	530,662,500	
第122回利付国債（5年）	4,900,000,000	4,904,312,000	
第123回利付国債（5年）	4,640,000,000	4,642,134,400	
第124回利付国債（5年）	760,000,000	760,000,000	
第1回利付国債（40年）	150,000,000	185,086,500	
第2回利付国債（40年）	300,000,000	354,933,000	
第3回利付国債（40年）	420,000,000	497,280,000	
第4回利付国債（40年）	530,000,000	627,901,600	
第5回利付国債（40年）	490,000,000	553,205,100	
第6回利付国債（40年）	690,000,000	758,268,600	
第7回利付国債（40年）	1,090,000,000	1,132,270,200	
第8回利付国債（40年）	550,000,000	521,400,000	
第282回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,285,401,600	
第283回利付国債（10年）	280,000,000	285,978,000	
第284回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,239,524,000	
第285回利付国債（10年）	1,990,000,000	2,046,894,100	
第286回利付国債（10年）	870,000,000	900,284,700	
第287回利付国債（10年）	540,000,000	559,845,000	
第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,167,204,600	
第289回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,580,013,500	
第290回利付国債（10年）	470,000,000	487,385,300	

第291回利付国債(10年)	840,000,000	868,820,400	
第292回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,159,983,300	
第293回利付国債(10年)	370,000,000	389,254,800	
第294回利付国債(10年)	180,000,000	188,839,800	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	104,324,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,198,259,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	586,224,800	
第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,732,044,000	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,370,430,300	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	874,388,400	
第301回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,310,332,800	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	210,560,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,467,158,900	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	504,643,200	
第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,276,467,200	
第306回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,453,665,900	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	739,487,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,048,073,400	
第309回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,866,935,200	
第310回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,663,394,400	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	631,862,400	
第312回利付国債(10年)	2,170,000,000	2,298,420,600	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,760,368,500	
第314回利付国債(10年)	760,000,000	802,256,000	
第315回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,180,441,500	
第316回利付国債(10年)	720,000,000	761,572,800	
第317回利付国債(10年)	620,000,000	656,902,400	
第318回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,906,635,900	
第319回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,220,414,500	
第320回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,215,185,000	
第321回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,459,384,900	
第322回利付国債(10年)	950,000,000	996,474,000	
第323回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,217,199,600	
第324回利付国債(10年)	2,020,000,000	2,105,769,200	
第325回利付国債(10年)	3,010,000,000	3,135,697,600	
第326回利付国債(10年)	530,000,000	548,009,400	
第327回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,874,304,000	
第328回利付国債(10年)	2,540,000,000	2,605,024,000	
第329回利付国債(10年)	2,300,000,000	2,392,828,000	
第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	2,329,488,000	
第331回利付国債(10年)	680,000,000	696,299,600	
第332回利付国債(10年)	2,900,000,000	2,966,671,000	

第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	2,811,462,500
第334回利付国債(10年)	2,950,000,000	3,012,569,500
第335回利付国債(10年)	3,040,000,000	3,073,744,000
第336回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,323,113,100
第337回利付国債(10年)	1,990,000,000	1,972,786,500
第338回利付国債(10年)	3,680,000,000	3,676,540,800
第339回利付国債(10年)	810,000,000	807,683,400
第1回利付国債(30年)	40,000,000	51,004,400
第2回利付国債(30年)	160,000,000	195,523,200
第3回利付国債(30年)	120,000,000	145,045,200
第4回利付国債(30年)	110,000,000	142,561,100
第5回利付国債(30年)	50,000,000	59,720,000
第6回利付国債(30年)	190,000,000	232,449,800
第7回利付国債(30年)	180,000,000	217,344,600
第8回利付国債(30年)	50,000,000	56,333,000
第9回利付国債(30年)	240,000,000	255,009,600
第10回利付国債(30年)	160,000,000	161,675,200
第11回利付国債(30年)	90,000,000	99,504,000
第12回利付国債(30年)	190,000,000	222,330,400
第13回利付国債(30年)	290,000,000	334,100,300
第14回利付国債(30年)	300,000,000	364,962,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	419,519,200
第16回利付国債(30年)	370,000,000	456,036,100
第17回利付国債(30年)	330,000,000	400,616,700
第18回利付国債(30年)	445,000,000	531,823,950
第19回利付国債(30年)	280,000,000	334,112,800
第20回利付国債(30年)	420,000,000	515,848,200
第21回利付国債(30年)	370,000,000	441,136,200
第22回利付国債(30年)	400,000,000	491,456,000
第23回利付国債(30年)	420,000,000	516,100,200
第24回利付国債(30年)	330,000,000	405,546,900
第25回利付国債(30年)	350,000,000	417,063,500
第26回利付国債(30年)	730,000,000	883,759,900
第27回利付国債(30年)	730,000,000	898,637,300
第28回利付国債(30年)	530,000,000	653,421,100
第29回利付国債(30年)	940,000,000	1,141,498,400
第30回利付国債(30年)	660,000,000	788,792,400
第31回利付国債(30年)	770,000,000	905,004,100
第32回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,268,735,200
第33回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,462,718,100
第34回利付国債(30年)	1,180,000,000	1,388,482,400
第35回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,360,104,000
第36回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,404,994,400

第 3 7 回利付国債（ 3 0 年）	1,110,000,000	1,232,632,800	
第 3 8 回利付国債（ 3 0 年）	950,000,000	1,033,020,500	
第 3 9 回利付国債（ 3 0 年）	740,000,000	820,060,600	
第 4 0 回利付国債（ 3 0 年）	720,000,000	780,573,600	
第 4 1 回利付国債（ 3 0 年）	580,000,000	615,385,800	
第 4 2 回利付国債（ 3 0 年）	710,000,000	752,813,000	
第 4 3 回利付国債（ 3 0 年）	940,000,000	997,039,200	
第 4 4 回利付国債（ 3 0 年）	680,000,000	720,024,800	
第 4 5 回利付国債（ 3 0 年）	680,000,000	687,010,800	
第 4 6 回利付国債（ 3 0 年）	1,060,000,000	1,070,992,200	
第 4 7 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	103,346,000	
第 3 3 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	146,309,800	
第 3 4 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	52,939,000	
第 3 5 回利付国債（ 2 0 年）	10,000,000	10,554,200	
第 3 6 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	74,558,400	
第 3 7 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	74,711,000	
第 3 8 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	21,434,000	
第 3 9 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	534,510,000	
第 4 0 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	107,243,000	
第 4 1 回利付国債（ 2 0 年）	330,000,000	347,648,400	
第 4 2 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	87,513,600	
第 4 3 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	156,602,600	
第 4 4 回利付国債（ 2 0 年）	170,000,000	189,145,400	
第 4 5 回利付国債（ 2 0 年）	290,000,000	321,308,400	
第 4 6 回利付国債（ 2 0 年）	170,000,000	187,547,400	
第 4 7 回利付国債（ 2 0 年）	90,000,000	99,756,000	
第 4 8 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	146,835,000	
第 4 9 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	155,747,200	
第 5 0 回利付国債（ 2 0 年）	220,000,000	242,325,600	
第 5 1 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	111,115,000	
第 5 2 回利付国債（ 2 0 年）	110,000,000	123,304,500	
第 5 3 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	90,029,600	
第 5 4 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	226,350,000	
第 5 5 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	157,141,600	
第 5 6 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	168,696,000	
第 5 7 回利付国債（ 2 0 年）	240,000,000	268,269,600	
第 5 8 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	336,129,000	
第 5 9 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	221,574,000	
第 6 0 回利付国債（ 2 0 年）	350,000,000	380,075,500	
第 6 1 回利付国債（ 2 0 年）	240,000,000	253,567,200	
第 6 2 回利付国債（ 2 0 年）	320,000,000	333,043,200	
第 6 3 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	223,856,000	

第64回利付国債（20年）	320,000,000	361,340,800
第65回利付国債（20年）	220,000,000	248,958,600
第66回利付国債（20年）	330,000,000	370,725,300
第67回利付国債（20年）	130,000,000	147,351,100
第68回利付国債（20年）	190,000,000	220,267,000
第69回利付国債（20年）	390,000,000	448,831,500
第70回利付国債（20年）	400,000,000	471,856,000
第71回利付国債（20年）	200,000,000	232,456,000
第72回利付国債（20年）	630,000,000	728,122,500
第73回利付国債（20年）	360,000,000	413,686,800
第74回利付国債（20年）	200,000,000	231,650,000
第75回利付国債（20年）	130,000,000	150,880,600
第76回利付国債（20年）	270,000,000	308,180,700
第77回利付国債（20年）	290,000,000	333,714,600
第78回利付国債（20年）	170,000,000	194,270,900
第79回利付国債（20年）	270,000,000	311,274,900
第80回利付国債（20年）	220,000,000	255,732,400
第81回利付国債（20年）	390,000,000	449,970,300
第82回利付国債（20年）	600,000,000	698,124,000
第83回利付国債（20年）	290,000,000	337,861,600
第84回利付国債（20年）	670,000,000	773,896,900
第85回利付国債（20年）	290,000,000	338,595,300
第86回利付国債（20年）	210,000,000	249,469,500
第87回利付国債（20年）	550,000,000	647,768,000
第88回利付国債（20年）	550,000,000	654,670,500
第89回利付国債（20年）	450,000,000	530,959,500
第90回利付国債（20年）	630,000,000	744,641,100
第91回利付国債（20年）	450,000,000	536,944,500
第92回利付国債（20年）	1,080,000,000	1,266,224,400
第93回利付国債（20年）	410,000,000	476,563,500
第94回利付国債（20年）	680,000,000	798,320,000
第95回利付国債（20年）	660,000,000	790,673,400
第96回利付国債（20年）	420,000,000	493,458,000
第97回利付国債（20年）	640,000,000	760,166,400
第98回利付国債（20年）	450,000,000	529,357,500
第99回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,177,670,000
第100回利付国債（20年）	620,000,000	738,215,400
第101回利付国債（20年）	435,000,000	528,525,000
第102回利付国債（20年）	440,000,000	535,057,600
第103回利付国債（20年）	380,000,000	457,261,600
第104回利付国債（20年）	460,000,000	542,165,200
第105回利付国債（20年）	680,000,000	802,182,400
第106回利付国債（20年）	360,000,000	429,332,400

第107回利付国債(20年)	370,000,000	436,829,400	
第108回利付国債(20年)	650,000,000	750,854,000	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	392,659,200	
第110回利付国債(20年)	850,000,000	1,003,595,000	
第111回利付国債(20年)	300,000,000	358,266,000	
第112回利付国債(20年)	800,000,000	945,192,000	
第113回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,571,288,600	
第114回利付国債(20年)	680,000,000	803,229,600	
第115回利付国債(20年)	720,000,000	859,903,200	
第116回利付国債(20年)	550,000,000	656,777,000	
第117回利付国債(20年)	910,000,000	1,073,891,000	
第118回利付国債(20年)	850,000,000	991,355,000	
第119回利付国債(20年)	380,000,000	432,713,600	
第120回利付国債(20年)	300,000,000	333,126,000	
第121回利付国債(20年)	1,220,000,000	1,405,525,400	
第122回利付国債(20年)	280,000,000	318,561,600	
第123回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,251,033,200	
第124回利付国債(20年)	400,000,000	466,264,000	
第125回利付国債(20年)	430,000,000	513,523,200	
第126回利付国債(20年)	390,000,000	454,260,300	
第127回利付国債(20年)	460,000,000	529,027,600	
第128回利付国債(20年)	660,000,000	758,848,200	
第129回利付国債(20年)	620,000,000	703,644,200	
第130回利付国債(20年)	630,000,000	714,136,500	
第131回利付国債(20年)	580,000,000	648,759,000	
第132回利付国債(20年)	530,000,000	591,978,200	
第133回利付国債(20年)	880,000,000	996,248,000	
第134回利付国債(20年)	420,000,000	474,826,800	
第135回利付国債(20年)	380,000,000	423,783,600	
第136回利付国債(20年)	710,000,000	780,950,300	
第137回利付国債(20年)	290,000,000	322,903,400	
第138回利付国債(20年)	630,000,000	682,038,000	
第139回利付国債(20年)	410,000,000	450,188,200	
第140回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,791,028,400	
第141回利付国債(20年)	360,000,000	399,787,200	
第142回利付国債(20年)	730,000,000	822,199,000	
第143回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,146,379,500	
第144回利付国債(20年)	640,000,000	688,595,200	
第145回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,637,531,200	
第146回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,998,801,100	
第147回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,594,876,500	
第148回利付国債(20年)	1,530,000,000	1,629,893,700	

	第149回利付国債(20年)	1,460,000,000	1,551,512,800
	第150回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,825,932,500
	第151回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,528,420,800
	第152回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,593,800,100
	第153回利付国債(20年)	240,000,000	244,056,000
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	101,052,000
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,536,000
	国債証券合計	245,680,000,000	261,215,411,250
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,905,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,439,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	117,464,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	113,867,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,013,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,612,000
	第23回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,339,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	221,760,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	219,146,000
	第639回東京都公募公債	50,000,000	51,049,500
	第645回東京都公募公債	300,000,000	308,583,000
	第649回東京都公募公債	102,000,000	105,726,060
	第650回東京都公募公債	140,000,000	145,482,400
	第695回東京都公募公債	100,000,000	105,807,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	105,935,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,498,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,365,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	104,139,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,251,000
	平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	102,601,000
	平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	114,144,800
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	105,749,000
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	106,159,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,232,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	122,060,000
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,751,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,307,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	103,009,000
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	102,528,000
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	103,895,000
	第172回神奈川県公募公債	200,000,000	210,992,000
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	224,220,000
	第26回大阪府公募公債(2年)	270,000,000	269,757,000
	第91回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,144,000

第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,980,000	
第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,116,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,667,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,641,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,337,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,591,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,468,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	102,349,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	105,084,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	112,075,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,460,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,686,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,421,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,147,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	103,936,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,974,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,379,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	103,635,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	104,875,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	105,769,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	109,307,675	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	105,127,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,651,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,433,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	119,508,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	211,562,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,858,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,942,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,324,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,124,000	
平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,266,000	
平成19年度第2回広島県公募公債	200,000,000	207,872,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	119,963,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,781,000	
平成23年度第6回広島県公募公債(5年)	200,000,000	200,866,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,684,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,838,000	

平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,938,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	204,834,760	
平成23年度第11回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	100,445,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,484,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,944,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,104,000	
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,300,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	116,451,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,465,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	211,686,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	112,074,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	109,928,000	
平成18年度第6回千葉県公募公債	392,700,000	401,897,034	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	105,907,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,264,400	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,789,000	
第46回共同発行市場公募地方債	336,500,000	345,403,790	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,716,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	164,835,792	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,900,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,759,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	173,342,084	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,356,900	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,254,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,058,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,507,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,904,182	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,780,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,813,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,820,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	265,330,000	
第97回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,684,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,751,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,681,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,220,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,482,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,394,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,045,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,023,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,146,000	

第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,631,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,453,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,273,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,991,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,306,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,559,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,119,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,439,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	207,286,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,430,000	
第13回大田市公募公債（20年）	200,000,000	232,586,000	
平成19年度第7回大田市公募公債	100,000,000	103,759,000	
平成22年度第5回大田市公募公債	100,000,000	105,108,000	
平成26年度第1回大田市公募公債（3年）	200,000,000	200,114,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	119,816,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	116,768,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	103,574,000	
第458回名古屋市公募公債（10年）	200,000,000	205,486,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,233,000	
平成18年度第3回京都市公募公債	100,000,000	102,964,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	106,822,560	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,680,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,980,000	
平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,127,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,199,000	
平成18年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	102,586,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,181,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	211,292,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	106,156,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,144,000	
平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	102,051,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,603,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	113,159,000	
第81回川崎市公募公債	100,000,000	105,370,000	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,780,000	
平成23年度第1回北九州市公募公債（5年）	100,000,000	100,328,000	
平成18年度第6回福岡市公募公債	120,050,000	123,058,453	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,880,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,295,500	
平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	105,351,000	
	100,000,000	102,367,000	

	平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年）			
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,312,000	
	地方債証券合計	18,473,940,000	19,530,961,390	
特殊債券	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	108,319,280	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,828,000	
	第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,431,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,762,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,646,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,745,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,885,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	219,754,000	
	第14回道路債券	100,000,000	111,278,000	
	第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,220,000	
	第17回道路債券	100,000,000	108,555,000	
	第21回道路債券	100,000,000	125,010,000	
	第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,406,000	
	第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,636,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	303,000,000	312,344,520	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,545,000	
	第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	326,292,750	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,236,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,058,000	
	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,623,000	
	第42回道路債券	100,000,000	115,845,000	
	第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,787,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,094,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,602,000	
	第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,558,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,291,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,749,000	

第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,042,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,088,400	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	115,140,300	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,174,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	190,059,050	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,884,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,219,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,465,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	234,838,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,127,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,915,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,504,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,917,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	145,730,760	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,052,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,702,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,337,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,520,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,818,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,008,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,388,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,319,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,757,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,558,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,586,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,602,000	
	200,000,000	209,312,000	

第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,598,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,938,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,960,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,527,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,024,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,649,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,528,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,759,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,579,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,654,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,236,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,856,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,153,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,738,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,042,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,329,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	212,077,780	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,499,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,260,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,186,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,059,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	335,547,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,475,800	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	104,576,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,787,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	122,671,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,535,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,101,600	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,725,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,738,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	212,028,000	

第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,864,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,013,740	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,653,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,502,380	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,580,150	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,800,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,193,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	104,071,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	105,445,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,591,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,321,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,755,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,221,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,940,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,806,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,467,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,752,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,080,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,694,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,636,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,917,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	218,478,720	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	126,361,500	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	105,898,420	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	82,911,200	
第11回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	301,200,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,011,620	
第14回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,465,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,690,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,492,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,546,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,617,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,115,800	
第190回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,055,000	
第191回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,060,000	
第197回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,048,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,620,000	34,017,428	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,515,000	27,451,588	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,355,000	28,612,569	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	107,181,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,582,000	35,314,978	

第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,109,000	30,186,255	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	22,731,000	24,106,452	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,002,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,330,000	51,243,244	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,743,000	29,619,536	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,616,000	26,562,633	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,338,000	31,324,182	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,551,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,320,000	26,277,760	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,867,000	31,750,711	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	36,769,000	38,534,647	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,070,000	38,781,892	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,783,000	46,456,348	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,977,000	47,941,526	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,505,000	48,370,704	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,871,000	54,574,408	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,602,000	57,441,511	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,867,000	58,562,841	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,156,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,798,000	122,302,345	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,511,000	33,588,520	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,568,000	67,627,452	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,057,000	33,040,300	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,822,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,883,000	33,619,851	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,586,000	78,521,413	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,305,000	30,742,060	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,449,000	78,643,313	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,076,000	77,304,393	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,245,000	35,069,017	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,530,000	152,006,881	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,582,000	81,067,407	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,602,000	34,074,224	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,732,000	86,478,104	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,713,000	85,457,906	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,168,000	86,039,756	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,209,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,274,000	173,039,689	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,966,000	

第 6 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,117,000	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,142,000	177,569,240	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,959,000	89,982,057	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,387,000	91,457,564	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,761,000	91,971,485	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,303,000	90,321,064	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,427,000	89,429,078	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,547,000	93,002,618	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,798,500	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,588,000	92,539,265	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,974,000	95,568,738	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,215,000	96,858,410	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,022,000	97,193,468	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,897,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,020,000	196,167,801	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,954,000	97,499,851	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,738,000	194,589,017	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,639,000	98,566,007	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,259,000	98,586,023	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,666,000	99,673,973	
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,626,000	
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,063,000	
第 1 4 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,662,000	
第 1 2 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,498,000	
第 1 1 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,445,000	
い第 7 3 6 号商工債	100,000,000	100,358,000	
い第 7 3 8 号商工債	100,000,000	100,398,000	
い第 7 4 1 号商工債	100,000,000	100,481,000	
い第 7 5 0 号商工債	100,000,000	100,356,000	
い第 7 5 2 号商工債	200,000,000	200,734,000	
い第 7 5 6 号商工債	100,000,000	100,371,000	
い第 7 4 0 号農林債	100,000,000	100,487,000	
い第 7 4 3 号農林債	100,000,000	100,474,000	
い第 7 4 6 号農林債	100,000,000	100,334,000	
い第 7 4 8 号農林債	100,000,000	100,375,000	
い第 7 4 9 号農林債	300,000,000	300,822,000	
い第 7 5 2 号農林債	200,000,000	200,582,000	
第 2 6 5 回信金中金債（5年）	300,000,000	301,557,000	
第 2 6 7 回信金中金債（5年）	200,000,000	200,994,000	
第 2 7 4 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,353,000	
第 2 9 0 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,458,000	
第 2 9 9 回信金中金債（5年）	100,000,000	99,957,000	

	第175号商工債(3年)	100,000,000	99,994,000	
	第178号商工債(3年)	300,000,000	300,000,000	
	第179号商工債(3年)	200,000,000	199,926,000	
	第19回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,536,000	
	第20回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,436,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,763,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,017,000	
	第43回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,552,000	
	第26回政府保証銀行等保有株式取得機構債	400,000,000	400,272,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,756,000	
	特殊債券合計	25,020,250,000	26,261,717,773	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	101,892,000	
	第6回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,149,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	100,135,000	
	第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	200,478,000	
	第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	101,801,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	102,708,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,734,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリパ円貨社債	100,000,000	100,222,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,821,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,007,000	
	第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債	100,000,000	100,237,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,737,000	
	第14回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	101,330,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	203,344,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	100,085,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,234,000	
	第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,455,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,091,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,932,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,021,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,191,000	
	第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,346,000	

第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	105,273,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	105,454,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,873,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,164,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,822,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,289,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,344,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,459,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	98,234,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,168,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,223,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,415,000	
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,092,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,459,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,805,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,912,000	
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	102,181,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,484,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,524,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,407,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,416,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,358,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,330,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,157,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,602,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,088,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,841,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,282,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,431,000	
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	99,809,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,097,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,038,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,419,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,142,000	

第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	111,397,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,213,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,827,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,895,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,023,000	
第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,489,000	
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,307,000	
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	200,390,000	
第33回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	201,202,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	124,002,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,830,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,080,000	
第134回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,452,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	99,483,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,481,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,951,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,042,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,548,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,336,000	
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,489,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,935,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	208,700,000	
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,695,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,506,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,910,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,586,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,275,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,146,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,626,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,168,000	

第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,753,000	
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,091,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,570,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,829,000	
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,474,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,237,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	106,649,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,499,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,486,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,807,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,128,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,992,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,875,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,529,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,228,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,444,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,610,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,296,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	239,520,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,362,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,508,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,836,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,558,800	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,971,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,825,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,744,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,599,000	
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,671,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,241,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,295,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	124,621,200	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,612,900	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,073,000	

第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,307,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,438,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,158,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,162,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,384,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,484,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,628,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,592,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,855,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,549,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,775,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,319,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,766,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,691,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,137,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,740,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,570,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,307,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,597,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,035,000	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,480,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,369,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,037,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,885,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,923,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,875,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,756,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,341,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,145,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,466,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	32,793,970	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	101,255,530	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,604,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,141,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,064,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,850,000	
社債券合計	16,221,000,000	16,689,342,400	
合計		323,697,432,813	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,089,128,515
コール・ローン	377,402,949
株式	249,272,438,927
投資信託受益証券	197,733,676
投資証券	5,910,589,549
派生商品評価勘定	13,069,496
未収入金	108,112,441
未収配当金	321,048,742
未収利息	588
前払金	182,278,670
差入委託証拠金	872,647,493
流動資産合計	265,344,451,046
資産合計	265,344,451,046
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	193,762,766
未払解約金	132,464,236
流動負債合計	326,227,002
負債合計	326,227,002
純資産の部	
元本等	
元本	127,796,929,313
剰余金	
剰余金又は欠損金()	137,221,294,731
元本等合計	265,018,224,044
純資産合計	265,018,224,044
負債純資産合計	265,344,451,046

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	平成27年 7月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	平成27年 7月10日現在
	<p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成27年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,796,929,313口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 2.0737円 (1万口当たり純資産額) (20,737円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成27年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成27年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	平成27年 7月10日現在
期首	平成26年 7月11日
期首元本額	100,538,126,225円
期中追加設定元本額	49,394,322,028円
期中一部解約元本額	22,135,518,940円
期末元本額	127,796,929,313円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,827,692,737円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,471,354円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	23,853,360,828円
世界経済インデックスファンド	1,953,417,032円
マイセレクション25	4,194,435円
マイセレクション50	21,169,302円
マイセレクション75	24,757,668円
外国株式インデックス・オープン	1,017,081,417円
D C マイセレクション25	847,041,632円
D C マイセレクション50	4,086,392,774円
D C マイセレクション75	4,619,626,753円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,150,404,089円
D C マイセレクションS25	301,221,182円
D C マイセレクションS50	1,513,858,176円
D C マイセレクションS75	1,193,645,479円
D C ターゲット・イヤー ファンド2015	1,197,257円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	134,855,215円
D C ターゲット・イヤー ファンド2035	148,388,947円
D C ターゲット・イヤー ファンド2045	77,121,064円
D C 世界経済インデックスファンド	1,655,303,185円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	31,303,132,850円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	48,402,862円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	28,266,078円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	152,142,855円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	243,130,459円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	846,051,406円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	751,798,503円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	746,070,226円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,296,746,021円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	732,480,239円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,758,454,154円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,840,189,748円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,056,147,416円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	713,616,317円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	664,746,921円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	208,531,646円

区分	平成27年 7月10日現在
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,693,475,113円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	3,843,412,242円
外国株式ファンド・シリーズ1	615,841,970円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,347,845,711円
コア投資戦略ファンド（成長型）	11,333,033,714円
分散投資コア戦略ファンドA	664,284,641円
分散投資コア戦略ファンドS	1,120,541,028円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,229,398円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	155,824,125円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,163,631,545円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	436,506,954円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,369,904円
S M T インデックスバランス・オープン	160,441,156円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	2,493,040,394円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	798,343,191円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,682,896,313
投資信託受益証券	16,377,418
投資証券	209,663,909
合計	10,908,937,640

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,773,802,850	-	9,591,524,180	182,278,670
合計		9,773,802,850	-	9,591,524,180	182,278,670

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	225,581,000	-	227,166,400	1,585,400
	アメリカドル	163,066,500	-	164,214,000	1,147,500
	ユーロ	24,053,400	-	24,233,400	180,000
	イギリスポンド	18,555,800	-	18,694,000	138,200
	スイスフラン	12,775,300	-	12,840,000	64,700
	スウェーデンクローナ	7,130,000	-	7,185,000	55,000
	売建	21,895,200	-	21,895,200	-
	アメリカドル	21,895,200	-	21,895,200	-
	合計	247,476,200	-	249,061,600	1,585,400

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	35,311	76.08	2,686,460.88	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,850	31.04	119,504.00	
	APACHE CORP	26,572	53.83	1,430,370.76	
	BAKER HUGHES	30,467	60.15	1,832,590.05	
	CABOT OIL & GAS CORP	28,477	29.58	842,349.66	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	12,808	50.38	645,267.04	
	CHENIERE ENERGY INC	15,407	64.53	994,213.71	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	41,770	11.68	487,873.60	
	CHEVRON CORP	130,008	93.78	12,192,150.24	
	CIMAREX ENERGY CO	6,492	105.66	685,944.72	

COBALT INTERNATIONAL ENERGY	19,979	9.18	183,407.22
COLUMBIA PIPELINE GROUP	21,371	29.37	627,666.27
CONCHO RESOURCES INC	8,018	109.73	879,815.14
CONOCOPHILLIPS	85,447	58.67	5,013,175.49
CONSOL ENERGY INC	14,731	20.25	298,302.75
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,265	38.07	238,508.55
CORE LABORATORIES N.V.	2,702	108.83	294,058.66
DEVON ENERGY CORPORATION	26,444	55.94	1,479,277.36
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,834	25.13	121,478.42
ENERGEN CORP	4,802	62.47	299,980.94
ENSCO PLC-CL A	14,882	20.98	312,224.36
EOG RESOURCES INC	38,157	85.30	3,254,792.10
EQT CORPORATION	10,283	77.54	797,343.82
EXXON MOBIL	289,980	81.60	23,662,368.00
FMC TECHNOLOGIES INC	15,287	37.43	572,192.41
HALLIBURTON CO	59,279	41.31	2,448,815.49
HELMERICH & PAYNE	6,883	64.55	444,297.65
HESS CORP	17,367	64.65	1,122,776.55
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	44.29	551,321.92
KINDER MORGAN INC	125,711	37.50	4,714,162.50
MARATHON OIL CORP	45,368	24.78	1,124,219.04
MARATHON PETROLEUM CORP	38,299	53.38	2,044,400.62
MURPHY OIL CORP	11,085	40.67	450,826.95
NABORS INDUSTRIES LTD	18,529	13.60	251,994.40
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,055	44.58	1,250,691.90
NOBLE ENERGY INC	25,925	39.31	1,019,111.75
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	53,558	73.12	3,916,160.96
OCEANEERING INTL INC	7,126	44.75	318,888.50
ONEOK INC	15,207	39.14	595,201.98
PHILLIPS 66	37,888	79.45	3,010,201.60
PIONEER NATURAL RESOURCES	10,159	138.66	1,408,646.94
RANGE RESOURCES CORP	12,259	46.29	567,469.11
SCHLUMBERGER	88,462	83.55	7,391,000.10
SOUTHWESTERN ENERGY CO	27,906	21.33	595,234.98
SPECTRA ENERGY CORP	47,194	31.08	1,466,789.52
TESORO CORP	8,241	93.41	769,791.81
VALERO ENERGY CORP	36,100	64.11	2,314,371.00
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	52,887	11.48	607,142.76
WHITING PETROLEUM CORP	14,018	30.83	432,174.94
WILLIAMS COS	49,677	56.45	2,804,266.65
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,341	132.26	1,896,740.66
AIRGAS INC	4,296	101.87	437,633.52

ALBEMARLE CORP	7,098	53.44	379,317.12
ALCOA	84,358	10.59	893,351.22
ASHLAND INC	4,810	116.19	558,873.90
AVERY DENNISON CORP	6,084	60.63	368,872.92
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	8,367	32.25	269,835.75
BALL CORP	9,502	69.67	662,004.34
CELANESE CORP-SERIES A	10,170	67.64	687,898.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	15,970	60.80	970,976.00
CROWN HOLDINGS INC	8,966	52.72	472,687.52
DOW CHEMICAL CO	80,936	50.26	4,067,843.36
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	63,200	57.90	3,659,280.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,723	76.36	818,808.28
ECOLAB INC	18,382	110.61	2,033,233.02
FMC CORP	8,555	48.67	416,371.85
FREEMPORT-MCMORAN INC	73,818	16.78	1,238,666.04
INT'L PAPER CO	27,052	46.60	1,260,623.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,305	108.91	577,767.55
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28,431	97.31	2,766,620.61
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,737	146.77	548,479.49
MONSANTO CO	33,791	106.51	3,599,079.41
MOSAIC CO/THE	23,683	44.71	1,058,866.93
NEWMONT MINING CORP	37,844	22.59	854,895.96
NUCOR CORP	21,574	42.96	926,819.04
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	62.43	429,955.41
PPG INDUSTRIES INC	18,777	112.64	2,115,041.28
PRAXAIR INC	20,295	116.00	2,354,220.00
SEALED AIR CORP	14,731	51.09	752,606.79
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,486	277.41	1,521,871.26
SIGMA-ALDRICH	8,040	139.32	1,120,132.80
VULCAN MATERIALS CO	9,207	85.92	791,065.44
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,260	64.41	209,976.60
WESTROCK CO	17,977	59.51	1,069,811.27
3 M COMPANY	43,979	153.75	6,761,771.25
ACUITY BRANDS INC	3,010	187.81	565,308.10
AGCO CORP	5,969	53.44	318,983.36
AMETEK INC	17,196	54.31	933,914.76
B/E AEROSPACE INC	6,965	54.40	378,896.00
BOEING CO	46,372	142.80	6,621,921.60
CATERPILLAR	40,054	81.69	3,272,011.26
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,538	45.48	297,348.24
CUMMINS INC	12,210	127.77	1,560,071.70
DANAHER CORP	44,143	85.74	3,784,820.82

DEERE&CO	22,597	94.54	2,136,320.38
DOVER CORP	11,669	67.24	784,623.56
EATON CORP	32,889	65.39	2,150,611.71
EMERSON ELECTRIC CO	47,828	53.76	2,571,233.28
FASTENAL CO	19,144	42.00	804,048.00
FLOWSERVE CORP	8,985	50.32	452,125.20
FLUOR CORP	10,027	50.54	506,764.58
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,074	44.73	495,340.02
GENERAL DYNAMICS CORP	19,664	143.88	2,829,256.32
GENERAL ELECTRIC CO	695,489	26.02	18,096,623.78
GRAINGER (WW) INC	4,144	235.70	976,740.80
HONEYWELL INTL INC	51,552	101.18	5,216,031.36
ILLINOIS TOOL WORKS	23,903	91.86	2,195,729.58
INGERSOLL-RAND PLC	17,860	66.10	1,180,546.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,917	39.84	315,413.28
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,450	117.59	640,865.50
LOCKHEED MARTIN CORP	18,657	192.13	3,584,569.41
MASCO CORP	23,242	23.05	535,728.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,809	162.69	2,083,896.21
PACCAR INC	24,967	62.90	1,570,424.30
PALL CORP	7,611	125.41	954,495.51
PARKER HANNIFIN CORP	9,733	113.01	1,099,926.33
PENTAIR PLC	12,104	64.55	781,313.20
PRECISION CASTPARTS CORP	9,940	192.85	1,916,929.00
QUANTA SERVICES INC	14,015	27.93	391,438.95
RAYTHEON COMPANY	21,520	98.63	2,122,517.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,169	121.49	1,113,941.81
ROCKWELL COLLIN	9,165	91.58	839,330.70
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,733	171.56	1,155,113.48
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	11,862	50.32	596,895.84
SNAP-ON INC	3,801	159.45	606,069.45
STANLEY BLACK&DECKER	10,815	105.82	1,144,443.30
TEXTRON	19,754	43.69	863,052.26
TRANSDIGM GROUP INC	3,646	223.64	815,391.44
UNITED RENTALS INC	6,249	81.37	508,481.13
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,572	108.92	6,161,822.24
WABCO HOLDINGS INC	3,875	118.27	458,296.25
WABTEC CORP	6,250	93.20	582,500.00
XYLEM INC	11,717	35.54	416,422.18
ADT CORPORATION	11,437	32.43	370,901.91
CINTAS CORP	6,449	84.16	542,747.84
DUN & BRADSTREET CORP	2,440	121.84	297,289.60

EQUIFAX INC	7,882	96.46	760,297.72
IHS INC-CLASS A	4,455	127.85	569,571.75
MANPOWER GROUP	5,272	89.67	472,740.24
NIELSEN NV	24,963	44.46	1,109,854.98
REPUBLIC SERVICES INC	16,349	39.48	645,458.52
ROBERT HALF INTL INC	9,340	55.47	518,089.80
STERICYCLE INC	6,092	133.85	815,414.20
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,037	128.55	647,506.35
TYCO INTERNATIONAL PLC	28,159	37.97	1,069,197.23
VERISK ANALYTICS INC	11,066	72.40	801,178.40
WASTE MANAGEMENT INC	31,279	47.15	1,474,804.85
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,255	39.67	486,155.85
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,600	62.16	658,896.00
CSX CORP	69,268	31.90	2,209,649.20
DELTA AIR LINES INC	13,337	40.55	540,815.35
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,420	44.72	555,422.40
FEDEX CORP	18,726	167.71	3,140,537.46
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	25,586	16.82	430,356.52
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,122	84.02	514,370.44
KANSAS CITY SOUTHERN	7,504	93.25	699,748.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,571	85.62	1,846,909.02
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,137	32.52	362,175.24
UNION PACIFIC CORP	61,083	96.25	5,879,238.75
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,125	53.26	326,217.50
UNITED PARCEL SERVICE B	48,705	95.75	4,663,503.75
AUTOLIV INC	6,037	106.56	643,302.72
BORGWARNER INC	15,633	53.28	832,926.24
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,834	77.94	1,545,861.96
FORD MOTOR COMPANY	256,739	14.33	3,679,069.87
GENERAL MOTORS CO	100,888	31.01	3,128,536.88
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,642	28.91	538,940.22
HARLEY-DAVIDSON	15,181	54.70	830,400.70
JOHNSON CONTROLS INC	46,001	48.72	2,241,168.72
LEAR CORP	5,323	103.33	550,025.59
TESLA MOTORS INC	6,421	257.92	1,656,104.32
COACH INC	19,954	33.08	660,078.32
DR HORTON INC	21,692	27.67	600,217.64
GARMIN LTD	7,608	43.56	331,404.48
HANESBRANDS INC	28,485	33.15	944,277.75
HARMAN INTL INDS INC	4,743	112.78	534,915.54
HASBRO INC	8,148	75.94	618,759.12
JARDEN CORP	11,913	51.61	614,829.93

LEGETT & PLATT INC	9,020	49.17	443,513.40
LENNAR CORP-CL A	12,676	52.72	668,278.72
LULULEMON ATHLETICA INC	8,316	62.46	519,417.36
MATTEL INC	21,936	25.78	565,510.08
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	41.99	584,500.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,448	189.41	842,495.68
NEWELL RUBBERMAID	17,771	40.72	723,635.12
NIKE B	47,656	109.44	5,215,472.64
POLARIS INDUSTRIES INC	4,072	148.22	603,551.84
PULTE GROUP INC	24,535	20.32	498,551.20
PVH CORP	5,967	112.86	673,435.62
RALPH LAUREN CORPORATION	3,958	128.99	510,542.42
TOLL BROTHERS INC	11,131	38.49	428,432.19
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12,599	84.49	1,064,489.51
VF CORP	23,539	69.90	1,645,376.10
WHIRLPOOL CORP	5,250	170.52	895,230.00
ARAMARK	14,928	31.02	463,066.56
BLOCK H & R INC	20,029	30.47	610,283.63
CARNIVAL CORPORATION	28,337	49.20	1,394,180.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,078	627.16	1,303,238.48
DARDEN RESTAURANTS INC	7,354	71.56	526,252.24
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	33,822	27.28	922,664.16
LAS VEGAS SANDS CORP	26,857	54.38	1,460,483.66
MARRIOTT INTL A	15,684	74.18	1,163,439.12
MCDONALD'S CORP	66,620	96.49	6,428,163.80
MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,010	17.84	446,178.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,731	55.48	539,875.88
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,525	78.51	983,337.75
STARBUCKS CORP	104,048	54.05	5,623,794.40
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,366	80.38	913,599.08
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,080	82.50	666,600.00
WYNN RESORTS LTD	5,532	105.20	581,966.40
YUM BRANDS INC	30,243	87.99	2,661,081.57
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,178	24.85	327,473.30
CBS CORP-CL B	32,248	54.25	1,749,454.00
CHARTER COMMUNICATION-A	5,758	172.65	994,118.70
COMCAST CORP-CL A	147,501	62.01	9,146,537.01
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,187	61.79	1,741,674.73
DIRECTV	33,273	92.25	3,069,434.25
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,803	32.53	318,891.59
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,203	30.56	556,283.68
DISH NETWORK CORPORATION-A	14,985	67.01	1,004,144.85

INTERPUBLIC GROUP OF COS	26,809	19.29	517,145.61
LIBERTY GLOBAL PLC-A	17,338	48.99	849,388.62
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,445	46.24	1,962,656.80
LIBERTY MEDIA CORP	6,384	35.31	225,419.04
LIBERTY MEDIA CORP-C	13,068	34.93	456,465.24
NEWS CORP-CLASS A	28,513	14.18	404,314.34
OMNICOM GROUP	16,681	70.99	1,184,184.19
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	65.42	321,931.82
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	3.70	615,092.98
TEGNA INC	15,014	31.10	466,935.40
THE WALT DISNEY CO	111,656	115.60	12,907,433.60
TIME WARNER CABLE-A	19,540	181.35	3,543,579.00
TIME WARNER INC	57,641	87.09	5,019,954.69
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	92,526	32.48	3,005,244.48
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	29,647	31.94	946,925.18
VIACOM INC-CLASS B	24,950	61.36	1,530,932.00
ADVANCE AUTO PARTS	5,222	162.07	846,329.54
AMAZON.COM	27,300	434.39	11,858,847.00
AUTONATION INC	5,015	61.81	309,977.15
AUTOZONE INC	2,150	670.36	1,441,274.00
BED BATH & BEYOND INC	12,541	67.37	844,887.17
BEST BUY COMPANY INC	21,899	33.67	737,339.33
CARMAX INC	14,096	66.25	933,860.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	50.39	319,674.16
DOLLAR GENERAL CORP	21,359	78.19	1,670,060.21
DOLLAR TREE INC	15,808	78.98	1,248,515.84
EXPEDIA INC	6,684	104.55	698,812.20
FOOT LOCKER INC	9,388	68.95	647,302.60
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	46.90	351,327.90
GAP	17,645	37.78	666,628.10
GENUINE PARTS CO	10,336	88.27	912,358.72
HOME DEPOT	91,182	111.38	10,155,851.16
KOHL'S CORP	14,442	62.68	905,224.56
L BRANDS INC	16,664	83.92	1,398,442.88
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	31,879	27.41	873,803.39
LKQ CORP	19,772	30.08	594,741.76
LOWES COMPANIES	67,573	67.02	4,528,742.46
MACY'S INC	23,212	65.78	1,526,885.36
NETFLIX INC	4,017	670.09	2,691,751.53
NORDSTROM INC	10,264	76.47	784,888.08
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,161	231.38	1,656,912.18
PRICELINE GROUP INC/THE	3,608	1,126.07	4,062,860.56

ROSS STORES INC	28,124	50.32	1,415,199.68
SIGNET JEWELERS LTD	5,506	120.73	664,739.38
STAPLES INC	41,695	15.25	635,848.75
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,310	83.04	3,513,422.40
TIFFANY & CO	8,996	91.03	818,905.88
TJX COMPANIES INC	47,605	67.67	3,221,430.35
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,923	88.72	791,648.56
TRIPADVISOR INC	7,647	85.96	657,336.12
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,993	159.91	638,520.63
URBAN OUTFITTERS INC	7,303	35.05	255,970.15
COSTCO WHOLESALE CORP	30,620	139.45	4,269,959.00
CVS HEALTH CORP	77,907	105.70	8,234,769.90
KROGER CO	32,634	75.57	2,466,151.38
RITE AID CORP	68,357	8.68	593,338.76
SYSCO CORP	40,413	36.00	1,454,868.00
WAL-MART STORES	111,594	72.78	8,121,811.32
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	60,471	89.55	5,415,178.05
WHOLE FOODS MKT INC	24,168	40.87	987,746.16
ALTRIA GROUP INC	136,414	50.95	6,950,293.30
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,016	47.09	2,025,623.44
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,634	101.36	875,142.24
BUNGE LIMITED	10,376	85.60	888,185.60
CAMPBELL SOUP CO (US)	12,938	47.12	609,638.56
COCA-COLA CO	286,891	39.92	11,452,688.72
COCA-COLA ENTERPRISES	15,090	43.93	662,903.70
CONAGRA	28,680	44.52	1,276,833.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,982	115.54	1,384,400.28
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,122	76.34	1,001,733.48
GENERAL MILLS INC	42,205	56.93	2,402,730.65
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,272	90.81	932,800.32
HORMEL FOODS CORP	9,273	57.22	530,601.06
JM SMUCKER CO	7,311	108.30	791,781.30
KELLOGG CO	17,922	63.59	1,139,659.98
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,222	70.67	581,048.74
KRAFT HEINZ CO/THE	40,912	74.80	3,060,217.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,477	79.39	593,599.03
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	13,836	88.14	1,219,505.04
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,651	71.19	758,244.69
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	114,520	41.25	4,723,950.00
MONSTER BEVERAGE CORP	9,554	133.44	1,274,885.76
PEPSICO INC	102,562	94.59	9,701,339.58
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	107,085	81.24	8,699,585.40

REYNOLDS AMERICAN INC	28,473	76.10	2,166,795.30
TYSON FOODS INC	20,777	42.67	886,554.59
WHITEWAVE FOODS CO	12,111	49.15	595,255.65
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,621	83.18	717,094.78
CLOROX COMPANY	8,745	106.81	934,053.45
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,906	66.17	3,963,980.02
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,520	96.71	437,129.20
ESTEE LAUDER CO-CL A	15,544	86.22	1,340,203.68
KIMBERLY-CLARK CORP	25,502	108.70	2,772,067.40
PROCTER & GAMBLE CO	186,682	80.66	15,057,770.12
ABBOTT LABORATORIES	104,747	49.19	5,152,504.93
AETNA INC	24,526	112.67	2,763,344.42
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,689	108.86	1,599,044.54
ANTHEM INC	18,608	158.58	2,950,856.64
BARD C R INC	5,308	171.20	908,729.60
BAXTER INTERNATIONAL	37,878	37.02	1,402,243.56
BECTON DICKINSON & CO	14,666	141.83	2,080,078.78
BOSTON SCIENTIFIC CORP	93,673	17.45	1,634,593.85
CARDINAL HEALTH	23,140	84.16	1,947,462.40
CENTENE CORP	7,820	70.85	554,047.00
CERNER CORP	21,758	68.47	1,489,770.26
CIGNA CORP	18,068	156.56	2,828,726.08
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	11,616	78.82	915,573.12
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,058	50.85	460,599.30
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,213	145.07	1,046,389.91
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	38.59	495,688.55
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	50,493	87.91	4,438,839.63
HCA HOLDINGS INC	22,815	91.64	2,090,766.60
HENRY SCHEIN INC	6,010	143.44	862,074.40
HOLOGIC INC	16,743	37.96	635,564.28
HUMANA INC	10,467	186.16	1,948,536.72
INTUITIVE SURGICAL INC	2,585	481.47	1,244,599.95
LABORATORY CRP OF AMER	7,190	119.44	858,773.60
MCKESSON CORP	16,180	226.90	3,671,242.00
MEDTRONIC PLC	98,111	73.09	7,170,932.99
OMNICARE INC	6,427	94.77	609,086.79
PATTERSON COMPANIES INC	5,552	48.73	270,548.96
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	70.84	735,177.52
RESMED INC	10,249	56.77	581,835.73
ST JUDE MEDICAL INC	19,840	74.54	1,478,873.60
STRYKER CORP	23,844	95.66	2,280,917.04
THE COOPER COS INC	3,161	174.68	552,163.48

UNITEDHEALTH GROUP INC	66,024	119.34	7,879,304.16
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,365	140.89	896,764.85
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,730	84.98	571,915.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12,009	106.84	1,283,041.56
ABBVIE INC	118,843	67.97	8,077,758.71
AGILENT TECHNOLOGIES	22,519	38.92	876,439.48
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,704	188.16	2,578,544.64
ALKERMES PLC	10,762	62.34	670,903.08
ALLERGAN PLC	26,078	304.10	7,930,319.80
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,206	116.04	604,104.24
AMGEN	52,544	151.31	7,950,432.64
BAXALTA INC	37,878	30.06	1,138,612.68
BIOGEN INC	16,257	399.29	6,491,257.53
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,865	140.13	1,522,512.45
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	115,127	67.89	7,815,972.03
CELGENE CORP	55,506	116.87	6,486,986.22
ENDO INTERNATIONAL PLC	14,238	80.46	1,145,589.48
GILEAD SCIENCES INC	103,001	113.36	11,676,193.36
HOSPIRA INC	11,423	89.13	1,018,131.99
ILLUMINA INC	9,760	217.17	2,119,579.20
INCYTE CORP	10,602	108.11	1,146,182.22
ISIS PHARMACEUTICALS INC	7,665	53.08	406,858.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,357	176.19	767,659.83
JOHNSON & JOHNSON	192,136	98.40	18,906,182.40
LILLY (ELI) & CO	69,307	87.48	6,062,976.36
MALLINCKRODT PLC	7,852	120.26	944,281.52
MEDIVATION INC	5,684	109.00	619,556.00
MERCK & CO	196,314	57.38	11,264,497.32
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,879	329.10	618,378.90
MYLAN NV	28,126	70.35	1,978,664.10
PERRIGO CO PLC	9,570	180.01	1,722,695.70
PFIZER	423,665	33.86	14,345,296.90
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,028	108.37	219,774.36
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	5,470	72.16	394,715.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,271	509.03	2,683,097.13
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27,609	127.82	3,528,982.38
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	167.69	540,967.94
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,948	120.89	2,048,843.72
WATERS CORP	5,962	125.41	747,694.42
ZOETIS INC	33,486	46.57	1,559,443.02
BANK OF AMERICA CORP	727,425	16.48	11,987,964.00
BB&T CORP	48,976	40.18	1,967,855.68

CIT GROUP INC	12,099	47.11	569,983.89
CITIGROUP	209,819	53.71	11,269,378.49
CITIZENS FINANCIAL GROUP	22,671	26.98	611,663.58
COMERICA INC	11,868	48.99	581,413.32
FIFTH THIRD BANCORP	56,562	20.66	1,168,570.92
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,878	62.51	554,963.78
HUDSON CITY BANCORP INC	33,541	9.81	329,037.21
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,227	11.12	591,884.24
JPMORGAN CHASE & CO	257,657	66.11	17,033,704.27
KEY CORP	56,451	14.82	836,603.82
M & T BANK CORP	8,028	124.19	996,997.32
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,326	18.07	511,850.82
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	16.05	350,483.85
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,242	94.90	3,439,365.80
REGIONS FINL CORP	93,279	10.00	932,790.00
SUNTRUST BANKS	36,837	43.21	1,591,726.77
US BANCORP	123,502	42.96	5,305,645.92
WELLS FARGO & CO	338,220	55.50	18,771,210.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,774	210.63	794,917.62
ALLY FINANCIAL INC	31,245	21.88	683,640.60
AMERICAN EXPRESS	63,677	76.34	4,861,102.18
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,352	123.09	1,520,407.68
BANK NEW YORK CO	77,577	40.99	3,179,881.23
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	79,901	138.25	11,046,313.25
BLACKROCK INC	8,646	336.89	2,912,750.94
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,412	86.73	3,331,472.76
CME GROUP INC	22,423	96.97	2,174,358.31
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	30,329	56.75	1,721,170.75
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,026	28.48	570,340.48
EATON VANCE CORP	7,881	38.22	301,211.82
FRANKLIN RESOURCES INC	27,118	48.36	1,311,426.48
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,193	204.81	5,569,398.33
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	7,868	224.43	1,765,815.24
INVESCO LTD	28,995	36.45	1,056,867.75
LEGG MASON INC	7,607	49.07	373,275.49
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,648	24.36	527,345.28
MCGRAW-HILL FINANCIAL	18,568	100.89	1,873,325.52
MOODY'S CORP	12,846	108.38	1,392,249.48
MORGAN STANLEY	101,991	38.10	3,885,857.10
NASDAQ OMX GROUP	7,604	49.22	374,268.88
NAVIENT CORP	29,347	18.53	543,799.91
NORTHERN TRUST CORP	15,081	74.74	1,127,153.94

PRICE T ROWE GROUP INC	18,411	76.61	1,410,466.71
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,630	57.65	497,519.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	82,294	32.18	2,648,220.92
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,417	48.72	458,796.24
STATE STREET CORP	28,867	74.95	2,163,581.65
SYNCHRONY FINANCIAL	11,555	32.60	376,693.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17,841	36.29	647,449.89
VOYA FINANCIAL INC	15,523	45.46	705,675.58
ACE LTD	22,907	103.49	2,370,645.43
AFLAC	30,793	60.66	1,867,903.38
ALLEGHANY CORP	1,109	484.23	537,011.07
ALLSTATE CORP	29,227	65.41	1,911,738.07
AMERICAN INT'L GROUP	95,148	61.76	5,876,340.48
AON PLC	19,035	100.15	1,906,355.25
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,815	68.62	604,885.30
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,411	47.32	539,968.52
ASSURANT INC	4,769	69.00	329,061.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,510	55.44	416,354.40
CHUBB CORPORATION	15,797	121.24	1,915,228.28
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,391	52.97	603,381.27
EVEREST RE GROUP LTD	2,941	184.84	543,614.44
FNF GROUP	16,273	38.12	620,326.76
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,099	43.15	1,212,471.85
LINCOLN NATIONAL CORP	17,556	57.00	1,000,692.00
LOEWS CORP	19,829	38.40	761,433.60
MARSH & MCLENNAN COS	37,723	56.60	2,135,121.80
METLIFE INC	66,127	55.02	3,638,307.54
PARTNERRE LTD	2,971	131.13	389,587.23
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,809	50.59	1,002,137.31
PROGRESSIVE CORP	40,491	29.03	1,175,453.73
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,799	85.72	2,725,810.28
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	102.52	333,087.48
TORCHMARK CORP	8,367	57.77	483,361.59
TRAVELERS COS INC/THE	22,488	100.07	2,250,374.16
UNUM GROUP	16,333	35.38	577,861.54
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	10,983	46.81	514,114.23
WR BERKLEY CORP	7,065	55.48	391,966.20
XL GROUP PLC	21,040	37.38	786,475.20
CBRE GROUP INC-A	21,499	37.20	799,762.80
JONES LANG LASALLE INC	3,112	172.22	535,948.64
REALOGY HOLDINGS CORP	9,422	47.94	451,690.68
WEYERHAEUSER CO	37,164	31.26	1,161,746.64

ACCENTURE PLC-CL A	43,756	97.75	4,277,149.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	35,097	25.12	881,812.12
ADOBE SYSTEMS INC	35,091	80.47	2,823,772.77
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	12,743	69.30	883,089.90
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,296	295.44	1,269,210.24
ANSYS INC	5,989	91.40	547,394.60
AUTODESK INC	16,266	52.46	853,314.36
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,279	80.69	2,685,282.51
CA INC	24,021	29.98	720,269.68
CDK GLOBAL INC	9,538	52.83	503,892.54
CITRIX SYSTEMS INC	11,506	68.89	792,648.34
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,660	59.49	2,537,843.40
COMPUTER SCIENCES CORP	9,202	65.49	602,638.98
EBAY	75,866	61.77	4,686,242.82
ELECTRONIC ARTS INC	20,956	70.50	1,477,398.00
FACEBOOK INC-A	139,663	85.88	11,994,258.44
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	19,083	62.33	1,189,443.39
FIREEYE INC	7,918	48.91	387,269.38
FISERV INC	16,414	84.44	1,386,080.23
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,587	153.61	858,219.07
GARTNER INC	6,094	85.33	520,001.02
GOOGLE INC-CL A	19,913	544.65	10,845,615.45
GOOGLE INC-CL C	21,333	520.68	11,107,666.44
INTL BUSINESS MACHINES CORP	65,166	163.85	10,677,449.10
INTUIT INC	18,506	103.58	1,916,851.48
LINKEDIN CORP - A	7,714	207.56	1,601,117.84
MASTERCARD INC-CLASS A	69,547	93.04	6,470,652.88
MICROSOFT CORP	540,454	44.52	24,061,012.08
NETSUITE INC	2,264	90.06	203,895.84
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	16.64	291,599.36
ORACLE CORP	243,743	40.18	9,793,593.74
PAYCHEX INC	22,018	47.43	1,044,313.74
RACKSPACE HOSTING INC	8,040	35.82	287,992.80
RED HAT INC	13,096	77.26	1,011,796.96
SALESFORCE.COM INC	41,903	69.96	2,931,533.88
SERVICENOW INC	10,291	76.18	783,968.38
SPLUNK INC	8,664	69.00	597,816.00
SYMANTEC CORP	46,562	22.99	1,070,460.38
SYNOPSYS INC	10,776	50.32	542,248.32
TERADATA CORP	9,511	35.56	338,211.16
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,950	41.74	457,053.00
TWITTER INC	33,221	34.36	1,141,473.56

VANTIV INC - CL A	9,716	38.75	376,495.00
VERISIGN INC	7,532	62.21	468,565.72
VISA INC-CLASS A SHARES	136,350	67.05	9,142,267.50
VMWARE INC-CLASS A	5,459	81.61	445,508.99
WESTERN UNION CO	34,620	18.91	654,664.20
WORKDAY INC-CLASS A	6,801	77.96	530,205.96
XEROX CORP	76,043	10.24	778,680.32
YAHOO	62,359	37.61	2,345,321.99
ZILLOW GROUP INC - CL A	3,100	85.26	264,306.00
AMPHENOL CORPORATION	20,848	54.29	1,131,837.92
APPLE INC	403,768	120.07	48,480,423.76
ARROW ELECTRONICS INC	6,579	53.88	354,476.52
AVNET INC	9,057	39.94	361,736.58
CISCO SYSTEMS	354,343	26.91	9,535,370.13
CORNING	89,623	19.16	1,717,176.68
EMC CORP	138,704	25.64	3,556,370.56
F5 NETWORKS INC	4,710	115.35	543,298.50
FLEXTRONICS INTL LTD	38,641	10.85	419,448.05
FLIR SYSTEMS INC	9,284	30.08	279,262.72
HARRIS CORP	8,870	78.49	696,206.30
HEWLETT-PACKARD CO	127,399	30.39	3,871,655.61
JUNIPER NETWORKS INC	24,324	25.71	625,370.04
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,616	56.94	775,295.04
NETAPP INC	20,591	30.35	624,936.85
PALO ALTO NETWORKS INC	4,921	174.81	860,240.01
QUALCOMM	114,569	61.86	7,087,238.34
SANDISK CORP	15,238	53.81	819,956.78
SEAGATE TECHNOLOGY	22,571	46.04	1,039,168.84
TE CONNECTIVITY LTD	28,578	61.73	1,764,119.94
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,032	22.91	390,203.12
WESTERN DIGITAL CORP	15,810	77.35	1,222,903.50
AT&T INC	358,915	34.39	12,343,086.85
CENTURYLINK INC	38,277	29.49	1,128,788.73
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	85,883	4.81	413,097.23
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	20,845	50.94	1,061,844.30
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,698	115.62	1,005,662.76
SPRINT CORP	53,367	3.90	208,131.30
T-MOBILE US INC	19,668	38.77	762,528.36
VERIZON COMMUNICATIONS	287,301	46.26	13,290,544.26
AES CORP	44,856	13.01	583,576.56
ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,080	59.59	421,897.20
AMEREN CORPORATION	17,567	38.68	679,491.56

AMERICAN ELECTRIC POWER	34,368	55.52	1,908,111.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,597	50.18	581,937.46
CALPINE CORP	25,284	17.37	439,183.08
CENTERPOINT ENERGY INC	29,837	18.95	565,411.15
CMS ENERGY CORP	18,893	33.51	633,104.43
CONSOLIDATED EDISON INC	20,080	60.49	1,214,639.20
DOMINION RESOURCES	41,005	68.65	2,814,993.25
DTE ENERGY COMPANY	11,965	76.86	919,629.90
DUKE ENERGY CORP	49,207	74.07	3,644,762.49
EDISON INTL	22,230	57.58	1,280,003.40
ENERGY CORP	12,200	72.52	884,744.00
EVERSOURCE ENERGY	22,558	46.73	1,054,135.34
EXELON CORP	60,267	32.50	1,958,677.50
FIRSTENERGY CORP	28,387	33.47	950,112.89
MDU RESOURCES GROUP INC	12,385	19.07	236,181.95
NEXTERA ENERGY INC	30,931	101.18	3,129,598.58
NRG ENERGY INC	24,624	21.89	539,019.36
OGE ENERGY CORP	12,751	28.65	365,316.15
PEPCO HOLDINGS INC	16,437	26.89	441,990.93
PG&E CORP	33,514	50.70	1,699,159.80
PINNACLE WEST CAPITAL	7,037	59.68	419,968.16
PPL CORPORATION	45,499	30.64	1,394,089.36
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	33,995	41.20	1,400,594.00
SCANA CORP	8,592	52.42	450,392.64
SEMPRA ENERGY	15,994	100.13	1,601,479.22
SOUTHERN CO	63,437	43.27	2,744,918.99
WEC ENERGY GROUP INC	22,566	46.81	1,056,314.46
XCEL ENERGY INC	35,870	33.33	1,195,547.10
ALTERA CORPORATION	20,000	49.46	989,200.00
ANALOG DEVICES	22,041	60.89	1,342,076.49
APPLIED MATERIALS	86,635	18.52	1,604,480.20
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	17,943	124.68	2,237,133.24
BROADCOM CORP-CL A	38,616	50.65	1,955,900.40
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	7,708	37.38	288,125.04
INTEL CORP	328,690	28.93	9,509,001.70
KLA-TENCOR CORP	10,702	54.73	585,720.46
LAM RESEARCH CORP	11,403	77.63	885,214.89
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,680	42.48	708,566.40
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,518	12.40	378,423.20
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,443	32.03	590,729.29
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,627	44.18	646,220.86
MICRON TECHNOLOGY	75,813	17.15	1,300,192.95

	NVIDIA CORP	39,139	19.41	759,687.99
	QORVO INC	10,323	74.63	770,405.49
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,842	94.51	1,213,697.42
	TEXAS INSTRUMENTS	73,041	48.11	3,514,002.51
	XILINX INC	18,770	41.85	785,524.50
	アメリカドル 小計	21,730,007		1,294,724,379.62 (157,503,220,780)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,790	37.55	330,064.50
	ARC RESOURCES LTD	21,371	21.20	453,065.20
	BAYTEX ENERGY CORP	17,204	17.81	306,403.24
	CAMECO CORP	28,709	17.04	489,201.36
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	76,497	32.81	2,509,866.57
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,980	9.02	261,399.60
	CENOVUS ENERGY INC	56,678	18.47	1,046,842.66
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,507	25.01	737,970.07
	ENBRIDGE	59,682	57.41	3,426,343.62
	ENCANA CORP	57,917	12.75	738,441.75
	ENERPLUS CORP	14,969	10.34	154,779.46
	HUSKY ENERGY INC	22,657	23.45	531,306.65
	IMPERIAL OIL	21,343	46.60	994,583.80
	INTER PIPELINE LTD	21,128	27.58	582,710.24
	KEYERA CORP	11,240	40.30	452,972.00
	MEG ENERGY CORP	11,150	17.82	198,693.00
	PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	4,574	26.58	121,576.92
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,385	39.11	953,697.35
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,172	30.01	275,251.72
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,235	29.76	274,833.60
	SUNCOR ENERGY	100,913	33.79	3,409,850.27
	TOURMALINE OIL CORP	11,584	36.15	418,761.60
	TRANSCANADA CORP	49,756	49.24	2,449,985.44
	VERESEN INC	23,096	15.26	352,444.96
	VERMILION ENERGY INC	7,138	49.08	350,333.04
	AGNICO EAGLE MINES	13,800	36.35	501,630.00
	AGRIUM INC	9,289	129.00	1,198,281.00
	BARRICK GOLD CORP	83,694	12.87	1,077,141.78
	ELDORADO GOLD CORP	45,613	4.89	223,047.57
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,763	15.41	766,847.83
	FRANCO-NEVADA CORP	10,197	58.50	596,524.50
	GOLDCORP INC	58,034	21.18	1,229,160.12
	KINROSS GOLD CORP	81,986	2.76	226,281.36
	METHANEX CORP	6,468	63.78	412,529.04
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	58,829	36.49	2,146,670.21

SILVER WHEATON CORP	28,647	19.43	556,611.21
TECK RESOURCES LTD-CL B	37,266	11.37	423,714.42
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	65.72	284,370.44
YAMANA GOLD INC	59,651	3.61	215,340.11
BOMBARDIER B	157,835	2.00	315,670.00
CAE INC	18,429	14.18	261,323.22
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	23.30	274,101.20
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,840	42.15	499,056.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	56,573	71.75	4,059,112.75
CP RAILWAY LIMITED	10,799	196.29	2,119,735.71
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,856	69.77	2,013,283.12
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,244	41.91	722,696.04
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,830	48.46	718,661.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	25,738	26.76	688,748.88
THOMSON REUTERS CORP	25,675	47.66	1,223,670.50
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,298	130.73	692,607.54
DOLLARAMA INC	8,315	74.74	621,463.10
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,506	52.55	1,550,540.30
EMPIRE CO LTD 'A'	3,833	88.33	338,568.89
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	20.49	112,981.86
LOBLAW COMPANIES LTD	16,310	63.24	1,031,444.40
METRO INC	18,650	33.43	623,469.50
WESTON (GEORGE) LTD	3,518	99.78	351,026.04
SAPUTO INC	16,769	28.80	482,947.20
CATAMARAN CORPORATION	14,865	77.76	1,155,902.40
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	22,283	283.43	6,315,670.69
BANK MONTREAL	45,393	73.32	3,328,214.76
BANK NOVA SCOTIA	84,723	63.08	5,344,326.84
CANADIAN IMPERIAL BANK	27,855	90.75	2,527,841.25
NATIONAL BANK OF CANADA	23,214	46.19	1,072,254.66
ROYAL BANK OF CANADA	100,436	75.48	7,580,909.28
TORONTO-DOMINION BANK	128,610	51.80	6,661,998.00
CI FINANCIAL CORP	15,063	32.92	495,873.96
IGM FINANCIAL INC	7,685	39.39	302,712.15
ONEX CORP	5,970	67.33	401,960.10
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,347	617.00	831,099.00
GREAT-WEST LIFECO INC	19,628	36.14	709,355.92
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	40.14	277,808.94
INTACT FINANCIAL CORP	8,577	89.51	767,727.27
MANULIFE FINANCIAL CORP	137,685	22.63	3,115,811.55
POWER CORP OF CANADA	24,148	31.14	751,968.72
POWER FINANCIAL CORP	16,605	34.62	574,865.10

	SUN LIFE FINANCIAL INC	41,708	41.09	1,713,781.72
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	59,679	43.65	2,604,988.35
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,116	17.82	198,087.12
	CGI GROUP INC - CL A	16,338	48.54	793,046.52
	CONSTELLATION SOFTWARE -RTS	1,236	0.23	290.46
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,236	495.15	612,005.40
	OPEN TEXT CORP	8,064	49.73	401,022.72
	BCE INC	10,313	52.57	542,154.41
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	25,948	43.19	1,120,694.12
	TELUS CORP	16,454	43.50	715,749.00
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	38.67	202,669.47
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,267	35.26	256,234.42
	FORTIS INC	17,872	35.30	630,881.60
	TRANSALTA CORP	15,621	9.20	143,713.20
	カナダドル 小計	2,691,636		102,532,255.36 (9,813,362,160)
ユーロ	ENI	178,533	15.45	2,758,334.85
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	10.40	268,559.20
	NESTE OIL OYJ	9,335	22.50	210,037.50
	OMV AG	9,889	24.45	241,786.05
	REPSOL SA	73,981	15.85	1,172,968.75
	SAIPEM	22,904	8.56	196,172.76
	TECHNIP S.A.	7,230	50.61	365,910.30
	TENARIS SA	34,866	11.54	402,353.64
	TOTAL SA	148,313	43.30	6,422,694.46
	VOPAK	4,507	45.85	206,668.48
	AIR LIQUIDE	24,047	113.15	2,720,918.05
	AKZO NOBEL	16,338	64.40	1,052,167.20
	ARCELORMITTAL	71,940	8.17	588,037.56
	ARKEMA	4,293	64.03	274,880.79
	BASF SE	63,612	78.62	5,001,175.44
	CRH	58,420	24.92	1,455,826.40
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,472	35.24	263,313.28
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	37.99	160,642.86
	HEIDELBERGCEMENT AG	10,068	70.48	709,592.64
	IMERYSA SA	1,975	66.56	131,456.00
	K+S AG	14,212	36.64	520,798.74
	KONINKLIJKE DSM NV	12,871	51.72	665,688.12
	LAFARGE SA	12,815	61.68	790,429.20
	LANXESS	5,814	51.70	300,583.80
	LINDE AG	12,961	172.30	2,233,180.30
	OCI NV	5,400	25.52	137,808.00

SOLVAY SA	4,144	121.15	502,045.60
STORA ENSO OYJ R	36,014	8.96	322,685.44
SYMRISE AG	8,131	56.56	459,889.36
THYSSEN KRUPP	25,892	22.68	587,230.56
UMICORE	6,892	41.73	287,603.16
UPM KYMMENE CORP	36,421	15.85	577,272.85
VOESTALPINE AG	7,829	36.54	286,110.80
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,261	28.00	399,308.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y-RTS	14,261	0.66	9,497.82
AIRBUS GROUP SE	41,093	58.60	2,408,049.80
ALSTOM RGPT	13,896	25.49	354,278.52
ANDRITZ AG	5,242	50.30	263,672.60
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	42.75	250,245.01
BOUYGUES ORD	13,925	31.08	432,858.62
BRENTAG AG	9,887	51.00	504,237.00
CNH INDUSTRIAL NV	65,726	8.26	542,896.76
FERROVIAL SA	32,322	19.83	640,945.26
FINMECCANICA SPA	28,941	11.57	334,847.37
GEA GROUP AG	11,636	39.59	460,669.24
KONE OYJ-B	22,070	35.14	775,539.80
KONINKLIJKE PHILIPS	66,379	23.08	1,532,027.32
LEGRAND SA	18,099	49.84	902,144.65
MAN SE	2,329	92.52	215,479.08
METSO OYJ	6,575	24.18	158,983.50
OSRAM LICHT AG	5,675	44.39	251,913.25
PRYSMIAN SPA	14,715	19.21	282,675.15
REXEL SA	18,266	14.38	262,756.41
SAFRAN SA	19,667	60.88	1,197,326.96
SAINT-GOBAIN	32,316	39.79	1,285,853.64
SCHNEIDER ELECTRIC SE	38,788	61.11	2,370,334.68
SIEMENS	54,918	90.01	4,943,169.18
THALES SA	7,650	54.45	416,542.50
VALLOUREC	7,471	16.88	126,110.48
VINCI S.A.	33,138	52.85	1,751,343.30
WARTSILA OYJ	9,741	39.52	384,964.32
ZARDOYA OTIS SA	13,496	9.32	125,782.72
ZODIAC AEROSPACE	13,148	27.17	357,296.90
BUREAU VERITAS SA	18,808	20.11	378,228.88
EDENRED	13,303	22.14	294,594.93
RANDSTAD HOLDING NV	9,537	58.84	561,157.08
SOCIETE BIC SA	1,899	143.35	272,221.65
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	34,142	14.55	496,936.81

ADP	1,728	103.55	178,934.40
AENA SA	5,053	94.05	475,234.65
ATLANTIA SPA	30,604	21.93	671,145.72
BOLLORE	61,805	4.82	298,085.51
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,731	11.85	174,636.00
DEUTSCHE POST AG-REG	67,843	27.43	1,861,272.70
FRAPORT AG	2,319	57.31	132,901.89
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	30,159	12.86	387,995.53
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	7.15	430,992.73
TNT EXPRESS	29,257	7.67	224,459.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,091	93.99	2,170,323.09
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	73.25	262,308.25
CONTINENTAL AG	7,701	208.20	1,603,348.20
DAIMLER AG	66,726	80.99	5,404,138.74
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	65,416	12.75	834,054.00
MICHELIN	12,616	93.42	1,178,586.72
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,697	27.53	211,898.41
PEUGEOT SA	29,979	17.85	535,275.04
PIRELLI & CO	21,084	15.07	317,735.88
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,392	74.12	770,255.04
RENAULT SA	13,059	88.50	1,155,721.50
VALEO SA	5,433	131.15	712,537.95
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,331	203.70	2,308,124.70
VOLKSWAGEN STAMM	2,554	203.45	519,611.30
ADIDAS AG	14,173	67.56	957,527.88
CHRISTIAN DIOR	3,920	173.05	678,356.00
HERMES INTERNATIONAL	1,898	330.85	627,953.30
HUGO BOSS AG	4,618	100.20	462,723.60
KERING	5,402	158.95	858,647.90
LUXOTTICA GROUP SPA	12,406	60.10	745,600.60
LVMH	19,437	153.40	2,981,635.80
ACCOR	14,341	44.34	635,951.64
SODEXO	6,061	84.81	514,033.41
ALTICE SA	5,811	114.75	666,812.25
AXEL SPRINGER SE	2,489	49.11	122,247.23
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	28.54	341,854.92
JC DECAUX SA	4,674	38.75	181,117.50
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	120.90	159,950.70
LAGADERE S.C.A	9,057	26.83	242,999.31
NUMERICABLE-SFR	7,331	44.89	329,125.24
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	15,697	45.05	707,149.85
PUBLICIS GROUPE	12,832	68.32	876,682.24

RELX NV	69,697	13.80	962,167.08
RTL GROUP	2,486	82.98	206,303.19
SES	22,020	29.35	646,287.00
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	47.40	152,644.10
VIVENDI	80,572	22.71	1,829,790.12
WOLTERS KLUWER	19,392	26.15	507,100.80
INDITEX	76,966	28.60	2,201,227.60
CARREFOUR	39,030	28.25	1,102,597.50
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	66.17	243,968.79
COLRUYT SA	4,415	41.23	182,052.52
DELHAIZE GROUP	7,165	74.89	536,586.85
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	6.42	296,740.09
JERONIMO MARTINS	15,262	11.35	173,223.70
KONINKLIJKE AHOLD NV	61,242	16.82	1,030,090.44
METRO STAMM	10,502	27.89	292,900.78
ANHEUSER-BUSCH INBEV	55,921	110.35	6,170,882.35
DANONE (GROUPE)	40,454	59.40	2,402,967.60
HEINEKEN HOLDING NV	6,365	62.64	398,703.60
HEINEKEN NV	15,768	68.87	1,085,942.16
KERRY GROUP PLC-A	11,778	66.63	784,768.14
PERNOD-RICARD	14,278	103.40	1,476,345.20
REMY COINTREAU	1,575	64.94	102,280.50
UNILEVER NV-CVA	113,687	38.14	4,336,590.61
BEIERSDORF AG	7,289	75.08	547,258.12
HENKEL AG & CO KGAA	7,179	88.07	632,254.53
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,990	104.20	1,249,358.00
LOREAL	17,589	159.75	2,809,842.75
ESSILOR INTERNATIONAL	13,759	108.10	1,487,347.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,677	74.99	1,100,628.23
FRESENIUS SE&CO KGAA	25,466	59.44	1,513,699.04
BAYER	57,240	127.30	7,286,652.00
GRIFOLS SA	9,815	36.73	360,504.95
MERCK KGAA	9,075	92.20	836,715.00
ORION OYJ-CLASS B	5,839	35.30	206,116.70
QIAGEN N.V.	14,956	22.54	337,183.02
SANOFI	82,219	89.38	7,348,734.22
UCB (GROUPE)	8,266	67.02	553,987.32
BANCO BILBAO VIZCAYA	449,593	8.72	3,921,350.14
BANCO DE SABADELL SA	348,220	2.15	751,110.54
BANCO SANTANDER SA	1,018,178	6.24	6,357,503.43
BANKINTER SA	46,530	6.70	311,844.06
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.07	187,882.38

BNP PARIBAS	74,935	52.38	3,925,095.30
CAIXABANK	156,396	4.18	655,142.84
COMMERZBANK AG	75,767	11.09	840,256.03
CREDIT AGRICOLE SA	74,532	13.20	983,822.40
ERSTE GROUP BANK AG	20,664	25.95	536,230.80
ING GROEP NV-CVA	274,533	14.61	4,010,927.13
INTESA SANPAOLO	906,096	3.21	2,908,568.16
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.76	179,660.00
KBC GROEP NV	17,786	59.45	1,057,377.70
NATIXIS	66,904	6.47	433,270.30
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	13.04	119,974.86
SOCIETE GENERALE	51,660	40.95	2,115,735.30
UNICREDIT SPA	344,122	5.89	2,026,878.58
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,870	7.17	472,617.25
DEUTSCHE BANK NAMEN	97,792	27.41	2,680,478.72
DEUTSCHE BOERSE	13,320	78.22	1,041,890.40
EURAZEO	2,763	58.08	160,475.04
EXOR SPA	7,381	43.40	320,335.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,274	72.36	453,986.64
MEDIOBANCA	41,923	8.71	365,149.33
WENDEL	1,898	111.30	211,247.40
AEGON	127,254	6.55	834,658.98
AGEAS	13,863	33.99	471,203.37
ALLIANZ SE-REG	32,272	141.40	4,563,260.80
ASSICURAZIONI GENERALI	81,295	16.16	1,313,727.20
AXA	138,640	22.09	3,063,250.80
CNP ASSURANCES	11,830	14.54	172,008.20
DELTA LLOYD NV	13,360	14.80	197,794.80
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,957	90.07	356,406.99
MAPFRE SA	90,939	3.09	281,365.26
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,313	163.75	2,016,253.75
NN GROUP NV	12,045	25.92	312,206.40
SAMPO OYJ-A SHS	31,087	43.49	1,351,973.63
SCOR SE	10,368	32.23	334,212.48
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	71,163	2.16	154,139.05
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	23,417	26.87	629,331.87
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	24,532	21.76	533,938.98
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	31,138	36.52	1,137,315.45
ATOS	6,363	68.89	438,347.07
CAP GEMINI SA	10,594	82.50	874,005.00
DASSAULT SYSTEMES SA	8,235	65.39	538,486.65
GEMALTO	5,820	79.26	461,293.20

	SAP SE	68,204	63.72	4,345,958.88
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,947	39.47	313,668.09
	ALCATEL-LUCENT	202,873	3.16	642,904.53
	NOKIA CORP	250,293	5.94	1,486,740.42
	DEUTSCHE TELEKOM	220,503	15.59	3,437,641.77
	ELISA A	10,064	28.78	289,641.92
	ILIAD SA	1,701	195.90	333,225.90
	KPN (KON.)	234,777	3.30	774,998.87
	ORANGE	125,419	13.65	1,712,596.44
	PROXIMUS	10,096	31.39	316,913.44
	TELECOM ITALIA ORD	678,554	1.16	791,872.51
	TELECOM ITALIA RNC	412,771	0.92	381,606.78
	TELEFONICA	311,213	12.61	3,925,951.99
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	4.96	186,391.84
	E.ON SE	140,142	11.99	1,680,302.58
	ELECTRICITE DE FRANCE	15,766	20.22	318,788.52
	ENAGAS	15,285	24.14	368,979.90
	ENDESA	24,774	17.12	424,130.88
	ENEL	481,534	4.11	1,981,993.94
	ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.82	225,257.12
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	159,451	3.46	552,497.71
	FORTUM OYJ	28,668	16.28	466,715.04
	GAS NATURAL SDG SA	23,632	19.81	468,149.92
	GDF SUEZ	98,800	16.73	1,652,924.00
	IBERDROLA SA	382,951	6.03	2,312,641.08
	IBERDROLA SA-RTS	382,951	0.11	42,890.51
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,272	69.69	506,785.68
	RWE STAMM	35,007	19.40	679,135.80
	SNAM SPA	155,537	4.44	691,828.57
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	16.85	349,974.50
	TERNA SPA	115,157	4.07	469,610.24
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,385	18.31	538,186.27
	ASML HOLDING NV	23,858	91.54	2,183,961.32
	INFINEON TECHNOLOGIES	79,114	10.89	861,551.46
	STMICROELECTRONICS	42,509	7.06	300,283.57
	ユーロ 小計	15,826,881		239,602,792.90 (32,257,724,008)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	26,190	8.09	211,877.10
	BG GROUP	236,533	10.66	2,521,441.78
	BP PLC	1,267,175	4.26	5,398,799.08
	PETROFAC LTD	16,711	8.51	142,294.16
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	270,192	18.04	4,875,614.64

ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	169,129	18.25	3,086,604.25
TULLOW OIL PLC	67,219	3.00	201,657.00
ANGLO AMERICAN PLC	97,881	8.59	840,993.55
ANTOFAGASTA PLC	25,418	6.50	165,217.00
BHP BILLITON PLC	146,605	12.06	1,768,056.30
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	27.28	236,381.20
FRESNILLO PLC	17,743	6.69	118,789.38
GLENCORE PLC	771,189	2.40	1,858,179.89
JOHNSON MATTHEY PLC	15,609	29.99	468,113.91
MONDI PLC	26,172	14.32	374,783.04
RANDGOLD RESOURCES LTD	5,987	41.82	250,376.34
REXAM PLC	44,988	5.61	252,382.68
RIO TINTO PLC REG	88,161	25.28	2,229,150.88
ASHTREAD GROUP PLC	32,745	10.53	344,804.85
BAE SYSTEMS PLC	220,794	4.67	1,031,549.56
BUNZL PLC	21,394	17.52	374,822.88
COBHAM PLC	72,398	2.63	190,768.73
IMI PLC	17,506	11.45	200,443.70
MEGGITT PLC	50,990	4.57	233,483.21
MELROSE INDUSTRIES PLC	64,431	2.47	159,724.44
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	125,506	7.57	950,080.42
SMITHS GROUP PLC	24,869	11.08	275,548.52
TRAVIS PERKINS PLC	17,877	20.95	374,523.15
WEIR GROUP PLC/THE	13,390	16.15	216,248.50
WOLSELEY LTD	18,305	41.41	758,010.05
AGGREKO PLC	18,794	14.22	267,250.68
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,206	10.74	206,272.44
CAPITA GROUP PLC	46,828	12.72	595,652.16
EXPERIAN PLC	66,036	11.57	764,036.52
G4S PLC	100,693	2.68	270,159.31
INTERTEK GROUP PLC	10,210	23.60	240,956.00
EASYJET PLC	11,633	16.33	189,966.89
ROYAL MAIL PLC	57,694	5.08	293,373.99
NEW GKN	117,344	3.19	375,031.42
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	70,432	6.20	437,030.56
BURBERRY GROUP PLC	31,553	15.63	493,173.39
PERSIMMON PLC	19,808	19.54	387,048.32
TAYLOR WIMPAY PLC	230,785	1.84	426,721.46
CARNIVAL PLC	11,844	33.60	397,958.40
COMPASS GROUP PLC	116,253	10.87	1,263,670.11
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,822	26.06	438,381.32
MERLIN ENTERTAINME	48,554	4.28	208,005.33

TUI AG-DI	32,064	10.39	333,144.96
WHITBREAD PLC	12,139	50.35	611,198.65
WILLIAM HILL	55,917	3.84	215,112.69
ITV PLC	256,099	2.65	680,198.94
PEARSON	54,591	12.16	663,826.56
RELX PLC	75,619	10.51	794,755.69
SKY PLC	68,919	10.44	719,514.36
WPP PLC	91,579	14.49	1,326,979.71
DIXONS CARPHONE PLC	66,738	4.45	297,384.52
KINGFISHER PLC	164,264	3.47	571,145.92
MARKS & SPENCER GROUP PLC	114,726	5.20	597,148.83
NEXT PLC	9,848	73.55	724,320.40
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,094	7.06	127,834.11
MORRISON SUPERMARKETS	135,997	1.70	232,282.87
SAINSBURY (J) PLC	86,863	2.53	220,197.70
TESCO	567,347	2.06	1,168,734.82
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	23,781	30.80	732,454.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	129,877	35.64	4,629,465.66
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	13.40	187,586.60
DIAGEO	174,324	18.88	3,292,108.74
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	66,383	31.79	2,110,315.57
SABMILLER PLC	67,209	33.95	2,282,081.59
TATE & LYLE	29,189	5.05	147,550.39
RECKITT BENCKISER PLC	44,745	57.39	2,567,915.55
UNILEVER PLC	88,936	28.19	2,507,105.84
SMITH & NEPHEW PLC	59,650	11.14	664,501.00
ASTRAZENECA	87,478	42.22	3,693,321.16
GLAXOSMITHKLINE	338,532	13.69	4,634,503.08
SHIRE PLC	40,935	53.25	2,179,788.75
BARCLAYS	1,163,440	2.61	3,038,323.56
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,352,920	5.64	7,630,468.80
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,023,874	0.83	3,362,349.11
ROYAL BANK OF SCOTLAND	174,975	3.43	600,339.22
STANDARD CHARTERED PLC	174,979	9.92	1,737,016.53
3I GROUP PLC	71,189	5.23	372,674.41
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	58,338	3.90	227,634.87
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,796	11.42	226,070.32
ICAP PLC	42,238	5.02	212,034.76
INVESTEC PLC	36,474	5.86	213,920.01
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	20,896	24.62	514,459.52
SCHRODERS PLC	7,932	30.00	237,960.00
ADMIRAL GROUP PLC	15,994	14.11	225,675.34

	AVIVA PIC	283,685	5.14	1,459,559.32
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	94,822	3.36	318,791.56
	LEGAL & GENERAL GROUP	423,482	2.57	1,089,195.70
	OLD MUTUAL PLC	333,096	2.09	698,502.31
	PRUDENTIAL	181,113	15.66	2,837,135.14
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	70,206	3.99	280,262.35
	STANDARD LIFE PLC	133,270	4.34	578,391.80
	SAGE GROUP PLC	69,473	5.19	360,912.23
	BT GROUP PLC	580,820	4.50	2,616,013.28
	INMARSAT PLC	32,474	9.04	293,727.33
	VODAFONE GROUP PLC	1,846,526	2.30	4,247,933.06
	CENTRICA PLC	331,184	2.66	881,280.62
	NATIONAL GRID PLC	259,421	8.46	2,197,036.44
	SEVERN TRENT PLC	15,457	21.19	327,533.83
	SSE PLC	69,099	15.72	1,086,236.28
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	48,638	8.76	426,068.88
	ARM HOLDINGS PLC	98,651	10.45	1,030,902.95
	イギリスポンド 小計	19,986,565		115,606,297.48 (21,613,753,376)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	22,796	14.52	330,997.92
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	402.75	192,111.75
	GIVAUDAN-REG	628	1,607.00	1,009,196.00
	HOLCIM LTD	15,561	71.55	1,113,389.55
	SIKA AG-BR	138	3,447.00	475,686.00
	SYNGENTA AG	6,316	384.20	2,426,607.20
	ABB LTD	152,968	19.15	2,929,337.20
	GEBERIT AG-REG	2,584	311.50	804,916.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	153.80	207,937.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,860	152.10	435,006.00
	SULZER AG-REG	1,607	92.80	149,129.60
	ADECCO	11,912	74.80	891,017.60
	SGS SA	393	1,685.00	662,205.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,932	125.40	493,072.80
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	36,365	74.75	2,718,283.75
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,114	366.00	773,724.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,872	71.00	203,912.00
	DUFREY AG-REG	2,223	133.60	296,992.80
	ARYZTA AG	5,619	44.44	249,708.36
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,033.00	136,356.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	62	5,180.00	321,160.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	61,050.00	427,350.00
	NESTLE SA - REGISTERED	222,872	70.05	15,612,183.60

	SONOVA HOLDING AG-REG	3,452	130.30	449,795.60	
	ACTELION LTD-REG	7,272	138.80	1,009,353.60	
	LONZA GROUP AG-REG	3,394	134.20	455,474.80	
	NOVARTIS	158,984	95.60	15,198,870.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	48,569	270.00	13,113,630.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	108,387	26.37	2,858,165.19	
	JULIUS BAER GROUP LTD	16,239	51.90	842,804.10	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	62.50	118,500.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,159	279.50	323,940.50	
	UBS GROUP AG	257,924	20.13	5,192,010.12	
	BALOISE HOLDING AG	3,124	115.30	360,197.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,095	215.80	452,101.00	
	SWISS RE LTD	24,427	83.20	2,032,326.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,611	289.70	3,074,006.70	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,001	72.45	362,322.45	
	SWISSCOM	1,802	529.00	953,258.00	
	スイスフラン 小計	1,150,126		79,657,036.79 (10,227,963,523)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	137.70	1,954,100.70	
	BOLIDEN AB	18,196	152.80	2,780,348.80	
	ALFA LAVAL AB	19,284	146.50	2,825,106.00	
	ASSA ABLOY AB-B	67,365	158.00	10,643,670.00	
	ATLAS COPCO A	45,041	227.10	10,228,811.10	
	ATLAS COPCO B	28,786	204.30	5,880,979.80	
	SANDVIK AB	77,472	90.65	7,022,836.80	
	SKANSKA B	26,115	173.10	4,520,506.50	
	SKF AB-B	27,040	186.40	5,040,256.00	
	VOLVO B	103,261	103.80	10,718,491.80	
	SECURITAS B	22,844	117.10	2,675,032.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,271	240.20	3,668,094.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	62.95	1,747,366.10	
	HENNES & MAURITZ B	66,741	321.70	21,470,579.70	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	301.10	1,725,303.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,410	247.80	3,075,198.00	
	SCA SV CELLULOSA B	40,560	217.20	8,809,632.00	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	53.45	1,127,955.35	
	GETINGE AB-B SHS	12,725	206.50	2,627,712.50	
	NORDEA BANK AB	217,398	104.00	22,609,392.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	104,072	103.90	10,813,080.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	102,174	125.80	12,853,489.20	
	SWEDBANK AB-A	61,784	192.80	11,911,955.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	157.80	2,018,577.60	

	INVESTOR AB-B SHS	31,222	315.30	9,844,296.60	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	17,990	266.30	4,790,737.00	
	ERICSSON (LM) B	214,364	86.95	18,638,949.80	
	HEXAGON AB-B SHS	17,545	295.00	5,175,775.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	640.50	2,772,724.50	
	TELE2 AB-B SHS	21,310	94.70	2,018,057.00	
	TELIASONERA AB	173,919	48.42	8,421,157.98	
	スウェーデンクローナ 小計	1,630,792		220,410,173.43 (3,167,294,192)	
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	23,438	78.95	1,850,430.10	
	STATOIL ASA	76,364	138.10	10,545,868.40	
	SUBSEA 7 SA	18,360	73.60	1,351,296.00	
	NORSK HYDRO	83,896	32.49	2,725,781.04	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,150	406.70	5,348,105.00	
	ORKLA	58,072	64.50	3,745,644.00	
	DNB ASA	70,730	127.40	9,011,002.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	126.40	1,703,998.40	
	TELENOR ASA	53,340	173.20	9,238,488.00	
	ノルウェークローネ 小計	410,831		45,520,612.94 (681,898,781)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	16,749	336.80	5,641,063.20	
	VESTAS WIND SYSYEMS	16,058	343.50	5,515,923.00	
	ISS A/S	11,483	223.90	2,571,043.70	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	245	11,450.00	2,805,250.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	497	11,720.00	5,824,840.00	
	DSV A/S	11,156	222.20	2,478,863.20	
	PANDORA A/S	8,218	735.00	6,040,230.00	
	CARLSBERG AS-B	7,708	597.00	4,601,676.00	
	COLOPLAST-B	8,054	441.50	3,555,841.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	501.50	744,226.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,612	373.00	49,091,276.00	
	DANSKE BANK A/S	49,086	195.20	9,581,587.20	
	TRYG A/S	9,828	140.10	1,376,902.80	
	TDC A/S	52,498	50.40	2,645,899.20	
	デンマーククローネ 小計	324,676		102,474,621.30 (1,848,642,168)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,386	32.89	670,495.54	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	80,275	11.27	904,699.25	
	SANTOS	74,790	7.48	559,429.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	51,156	33.52	1,714,749.12	
	WORLEYPARSONS LTD	15,026	9.80	147,254.80	
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.48	253,130.13	

AMCOR	85,997	13.66	1,174,719.02
BHP BILLITON LTD	222,962	25.88	5,770,256.56
BORAL LIMITED	46,867	5.90	276,515.30
FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,478	1.78	161,503.23
ILUKA RESOURCES LTD	28,555	7.18	205,024.90
INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.69	406,593.72
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	17.67	520,346.16
NEWCREST MINING LIMITED	56,897	12.90	733,971.30
ORICA LTD	27,564	19.90	548,523.60
RIO TINTO LTD	30,548	50.89	1,554,587.72
SOUTH32 LTD	354,855	1.75	622,770.52
CIMIC GROUP LIMITED	5,336	21.56	115,044.16
BRAMBLES LTD	111,650	10.72	1,196,888.00
SEEK LTD	21,328	14.19	302,644.32
ASCIANO GROUP	64,054	7.84	502,183.36
AURIZON HOLDINGS LTD	136,201	5.30	721,865.30
QANTAS AIRWAYS LIMITED	36,374	3.40	123,671.60
TRANSURBAN GROUP	127,628	9.67	1,234,162.76
ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,905	8.00	367,240.00
CROWN RESORTS LTD	21,269	12.49	265,649.81
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	32.94	107,483.22
TABCORP HOLDINGS	62,731	4.76	298,599.56
TATTS GROUP LTD	93,361	3.82	356,639.02
REA GROUP LTD	3,593	41.14	147,816.02
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	4.48	138,037.76
WESFARMERS LTD	77,044	39.91	3,074,826.04
WOOLWORTHS LTD	86,130	26.83	2,310,867.90
COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	9.21	350,016.84
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	5.07	195,458.64
COCHLEAR LIMITED	3,856	79.51	306,590.56
HEALTHSCOPE LTD	88,599	2.70	239,217.30
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,644	60.90	648,219.60
SONIC HEALTHCARE LTD	24,730	22.40	553,952.00
CSL LIMITED	32,222	88.45	2,850,035.90
AUST AND NZ BANKING GROUP	192,007	32.21	6,184,545.47
BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	12.97	316,169.69
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	12.53	390,998.65
COMMONWEALTH BANK OF AUST	112,294	85.60	9,612,366.40
NATIONAL AUSTRALIA BANK	181,634	33.13	6,017,534.42
WESTPAC BANKING	216,405	32.88	7,115,396.40
ASX LTD	12,620	40.79	514,769.80
MACQUARIE GROUP LIMITED	20,655	79.69	1,645,996.95

	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	7.28	147,252.56	
	AMP LTD	210,176	6.27	1,317,803.52	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	169,008	5.56	939,684.48	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	213,373	2.09	445,949.57	
	QBE INSURANCE GROUP	96,940	13.95	1,352,313.00	
	SUNCORP GROUP LIMITED	91,702	13.48	1,236,142.96	
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	11.74	361,791.58	
	TELSTRA CORP	301,600	6.18	1,863,888.00	
	TPG TELECOM LTD	20,000	8.88	177,600.00	
	AGL ENERGY LTD	43,547	15.37	669,317.39	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.37	165,316.25	
	オーストラリアドル 小計	4,768,553		73,106,516.83 (6,640,995,988)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	7.94	369,607.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,160	5.20	318,032.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	7.88	173,486.08	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	108,032	2.78	300,869.12	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	4.98	127,004.94	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.16	239,327.76	
	MIGHTY RIVER POWER	61,741	2.80	172,874.80	
	ニュージーランドドル 小計	435,546		1,701,201.70 (139,787,743)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	191,496	108.60	20,796,465.60	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	10.78	1,067,220.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	18.82	1,618,520.00	
	MTR CORP	94,000	34.80	3,271,200.00	
	LI & FUNG	378,800	5.94	2,250,072.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	26.50	2,477,750.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	25.50	1,185,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	168,000	33.05	5,552,400.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	15.64	1,051,008.00	
	SANDS CHINA LTD	174,800	28.80	5,034,240.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	10.30	1,009,400.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.40	1,108,800.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	14.82	1,523,496.00	
	WH GROUP LTD	465,000	4.83	2,245,950.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	31.60	2,678,416.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	261,500	29.45	7,701,175.00	
	HANG SENG BANK	54,100	146.30	7,914,830.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	6.35	812,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	75,500	233.60	17,636,800.00	
	AIA GROUP LTD	835,000	49.40	41,249,000.00	

	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	191,496	60.70	11,623,807.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	21.55	3,534,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	74,360	50.70	3,770,052.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	33.15	1,326,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	27.60	1,062,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	389,500	9.24	3,598,980.00	
	SINO LAND CO	227,400	12.08	2,746,992.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	119.70	14,004,900.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	95.55	3,869,775.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,200	24.00	1,660,800.00	
	WHARF HOLDINGS	96,000	50.50	4,848,000.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	38.85	2,525,250.00	
	PCCW LTD	232,000	4.31	999,920.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	59.20	2,427,200.00	
	CLP HOLDINGS	126,500	64.05	8,102,325.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	489,679	15.60	7,638,992.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	98,500	69.25	6,821,125.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	73.95	1,020,510.00	
	香港ドル 小計	6,150,391		209,766,721.20 (3,291,239,855)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	94,300	8.12	765,716.00	
	NOBLE GROUP LTD	297,563	0.68	203,830.65	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.84	218,880.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	2.81	171,129.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.26	355,340.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.32	175,560.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	3.00	435,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,533	10.95	476,686.35	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.88	376,125.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	124,800	4.05	505,440.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	31.00	186,000.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.37	157,125.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	150,200	3.25	488,150.00	
	DBS GROUP	118,400	20.51	2,428,384.00	
	OCBC BANK	213,900	10.10	2,160,390.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	92,300	22.82	2,106,286.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	7.98	438,900.00	
	CAPITALAND LTD	165,500	3.35	554,425.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	9.70	232,800.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	199,000	2.42	481,580.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	6.68	217,100.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	544,343	4.26	2,318,901.18	

	STARHUB LTD	38,000	3.97	150,860.00	
	シンガポールドル 小計	3,548,239		15,604,608.18 (1,407,379,611)	
イスラエルシ ケル	DELEK GROUP LTD	435	1,090.00	474,150.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	25.49	834,950.44	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,300.00	209,300.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	59,878	234.30	14,029,415.40	
	BANK HAPOLIM BM	75,703	20.61	1,560,238.83	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,989	15.97	1,516,974.33	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	47.15	386,630.00	
	AZRIELI GROUP	3,726	153.50	571,941.00	
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	244.20	820,023.60	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.70	747,941.10	
	イスラエルシケル 小計	390,839		21,151,564.70 (679,176,742)	
	合 計	79,045,082		249,272,438,927 (249,272,438,927)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	アメリカド ル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	329,000	202,335.00	
		アメリカドル 小計	329,000	202,335.00 (24,614,052)	
	オーストラ リアドル	APA GROUP	74,495	618,308.50	
		LEND LEASE GROUP	40,519	611,836.90	
		SYDNEY AIRPORT	70,759	384,928.96	
	オーストラリアドル 小計	185,773	1,615,074.36 (146,713,354)		
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,683,000.00	
	香港ドル 小計	187,000	1,683,000.00 (26,406,270)		
投資信託受益証券合計			701,773	197,733,676 (197,733,676)	
投資証券	アメリカド ル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,115	440,340.75	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	58,790	487,663.05	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	29,307	2,766,287.73	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	61,309	582,435.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,343	1,557,291.24	
		BOSTON PROPERTIES	10,280	1,265,673.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,835	300,339.00	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,979	461,638.59	
	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	7,973	178,834.39	
	CROWN CASTLE INTL CORP	22,699	1,825,907.56	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,832	667,887.76	
	DUKE REALTY CORP	21,780	415,344.60	
	EQUINIX INC	3,901	1,001,308.68	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	24,683	1,831,231.77	
	ESSEX PROPERTY TRUST	4,313	953,216.13	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,671	528,531.90	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,971	662,982.27	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	39,489	1,041,719.82	
	HCP INC	30,818	1,159,989.52	
	HEALTH CARE REIT INC	24,401	1,667,564.34	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	51,077	1,050,143.12	
	IRON MOUNTAIN INC	14,074	431,649.58	
	KIMCO REALTY CORP	29,848	705,308.24	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	9,708	317,257.44	
	MACERICH CO/THE	9,059	698,358.31	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,594	470,136.70	
	PROLOGIS INC	36,115	1,381,398.75	
	PUBLIC STORAGE	10,306	1,996,581.38	
	REALTY INCOME CORP	15,686	720,771.70	
	REGENCY CENTERS CORP	6,051	374,617.41	
	SIMON PROPERTY GROUP	21,871	3,895,662.52	
	SL GREEN REALTY CORP	6,544	745,557.92	
	UDR INC	18,795	620,047.05	
	VENTAS INC	23,299	1,493,232.91	
	VORNADO REALTY TRUST	11,985	1,160,986.95	
	アメリカドル 小計	689,501	35,857,898.18	(4,362,113,313)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	214,250.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	286,500.39	
	カナダドル 小計	19,938	500,750.69	(47,926,848)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	179,718.00	
	GECINA SA	2,522	282,842.30	
	ICADE	2,811	184,457.82	
	KLEPIERRE	10,883	438,040.75	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,029	1,575,198.90	
	ユーロ 小計	25,555	2,660,257.77	(358,150,503)

イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	66,079	538,213.45	
	HAMMERSON PLC	51,215	327,776.00	
	INTU PROPERTIES PLC	56,999	181,484.81	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	53,777	685,656.75	
	SEGREO PLC	48,938	205,490.66	
イギリスポンド 小計		277,008	1,938,621.67	(362,444,707)
オーストラ リアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	59,205	427,460.10	
	FEDERATION CENTRES	244,891	724,877.36	
	GOODMAN GROUP	119,536	749,490.72	
	GPT GROUP	109,865	469,123.55	
	MIRVAC GROUP	241,410	452,643.75	
	SCENTRE GROUP	376,553	1,457,260.11	
	STOCKLAND	150,322	622,333.08	
	WESTFIELD CORP	140,517	1,301,187.42	
オーストラリアドル 小計		1,442,299	6,204,376.09	(563,605,524)
香港ドル	LINK REIT	162,500	7,190,625.00	
香港ドル 小計		162,500	7,190,625.00	(112,820,906)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,300	331,920.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	218,075.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	141,000	300,330.00	
	SUNTEC REIT	173,000	297,560.00	
シンガポールドル 小計		595,300	1,147,885.00	(103,527,748)
投資証券合計		3,212,101	5,910,589,549	(5,910,589,549)
合計			6,108,323,225	(6,108,323,225)

有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 603銘柄	97.3%			61.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%

	投資証券 35銘柄			2.7%	1.7%
カナダドル	株式 91銘柄	99.5%			3.8%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 229銘柄	98.9%			12.6%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 106銘柄	98.4%			8.5%
	投資証券 5銘柄			1.6%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			4.0%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.3%			2.6%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.0%		0.1%
	投資証券 8銘柄			7.7%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	95.9%			1.3%
	投資信託受益証券 1銘柄		0.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式 23銘柄	93.1%			0.6%
	投資証券 4銘柄			6.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%			0.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	192,676,327
コール・ローン	2,197,702,587

	平成27年 7月10日現在
項目	金額（円）
国債証券	219,006,929,747
派生商品評価勘定	8,426,737
未収入金	6,398,840
未収利息	1,768,479,001
前払費用	247,416,840
差入委託証拠金	65,837,561
流動資産合計	223,493,867,640
資産合計	223,493,867,640
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,834,840
前受金	8,404,477
前受収益	5,229
未払金	14,397,920
未払解約金	476,146,468
流動負債合計	527,788,934
負債合計	527,788,934
純資産の部	
元本等	
元本	79,431,517,226
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	143,534,561,480
元本等合計	222,966,078,706
純資産合計	222,966,078,706
負債純資産合計	223,493,867,640

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

平成27年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,431,517,226口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8070円 (1万口当たり純資産額) (28,070円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	平成27年 7月10日現在
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成27年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 7月11日
期首元本額	91,264,530,297円
期中追加設定元本額	46,606,973,644円
期中一部解約元本額	58,439,986,715円
期末元本額	79,431,517,226円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	3,217,467,890円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	167,590,875円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,266,717,214円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	864,726,898円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,235,571,933円
SBI資産設計オープン（分配型）	10,726,718円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	4,827,175,160円
世界経済インデックスファンド	1,387,715,785円
マイセレクション25	6,228,574円
マイセレクション50	4,980,540円
マイセレクション75	3,605,029円
DCマイセレクション25	1,082,256,774円
DCマイセレクション50	1,005,497,584円
DCマイセレクション75	678,143,892円
DC外国債券インデックス・オープン	1,355,954,386円
DCマイセレクションS25	424,197,785円
DCマイセレクションS50	374,147,384円
DCマイセレクションS75	174,370,256円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	444,733円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	48,187,184円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	35,659,729円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	13,952,100円
DC世界経済インデックスファンド	1,206,492,906円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	480,545,339円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	183,323,990円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	11,862,631円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	4,207,437円

区分	平成27年 7月10日現在
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	136,629,939円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	412,962,179円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	616,059,863円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	2,774,133,448円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	915,844,250円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	5,623,780,232円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	971,068,265円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,431,187,177円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,471,380,371円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,838,394,624円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,035,875,253円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,297,759,467円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	372,604,761円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	498,873,293円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	2,028,133,734円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,564,542,769円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	617,493,949円
外国債券ファンド・シリーズ1	151,197,870円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,003,233,021円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,705,417,599円
分散投資コア戦略ファンドA	453,884,735円
分散投資コア戦略ファンドS	773,145,732円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	22,837,643円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	330,491,468円
コア投資戦略ファンド（切替型）	767,214,259円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	102,961,222円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	78,790,060円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	297,467,341円
SMT インデックスバランス・オープン	116,462,993円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	18,390,859,933円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	559,079,050円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,902,264,587
合計	2,902,264,587

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成27年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,128,529,429	-	1,136,933,906	8,404,477
合計		1,128,529,429	-	1,136,933,906	8,404,477

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,673,971,080	-	1,645,158,500	28,812,580
	アメリカドル	760,475,680	-	751,735,200	8,740,480
	カナダドル	74,268,190	-	71,767,500	2,500,690
	ユーロ	688,708,520	-	675,842,600	12,865,920
	イギリスポンド	150,518,690	-	145,813,200	4,705,490
合計		1,673,971,080	-	1,645,158,500	28,812,580

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 03/31/17	1,000,000.00	999,785.16	
		T 0.5% 07/31/17	2,000,000.00	1,995,429.68	
		T 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,927,148.40	
		T 0.625% 07/15/16	6,600,000.00	6,621,011.69	
		T 0.625% 08/15/16	7,300,000.00	7,322,955.06	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	6,996,582.04	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	998,886.72	
		T 0.625% 10/15/16	5,500,000.00	5,516,328.12	
		T 0.625% 11/15/16	5,600,000.00	5,616,515.63	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,987,207.05	
		T 0.625% 12/15/16	10,000,000.00	10,027,539.10	
		T 0.75% 01/15/17	12,000,000.00	12,052,265.64	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,390,718.77	
		T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	2,990,039.07	
		T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	6,019,570.32	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,898,640.62	
		T 0.875% 01/31/17	10,000,000.00	10,062,500.00	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,511,171.87	
		T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,030,664.05	
		T 0.875% 04/30/17	11,600,000.00	11,667,742.14	
		T 0.875% 06/15/17	5,000,000.00	5,028,320.30	
		T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	4,021,171.88	
		T 0.875% 08/15/17	8,800,000.00	8,843,484.40	
		T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,230,875.00	
		T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,959,804.68	
		T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	3,004,250.00	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	902,232.42	
		T 1.25% 01/31/20	8,520,000.00	8,426,313.31	
		T 1.25% 02/29/20	7,000,000.00	6,915,781.25	
		T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,535,546.87	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,464,013.66	
		T 1.25% 11/30/18	9,400,000.00	9,441,125.00	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,973,828.15	
		T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,112,509.76	
		T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,845,115.61	
		T 1.375% 04/30/20	12,600,000.00	12,493,933.57	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,535,862.31			
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,227,886.71			

T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,939,761.70	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,023,906.25	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,022,343.76	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,368,955.09	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,020,859.38	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,444,000.00	
T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,061,250.00	
T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,353,330.06	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,885,527.32	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,561,024.41	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,014,746.10	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,042,539.07	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,066,503.90	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,375,634.76	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,578,222.67	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,932,567.35	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,463,671.87	
T 1.75% 03/31/22	10,000,000.00	9,846,875.00	
T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,659,033.21	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,736,246.10	
T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	6,789,726.57	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,013,750.00	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,272,820.33	
T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,106,757.85	
T 1.875% 09/30/17	850,000.00	872,594.72	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,566,552.72	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,378,695.32	
T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,811,484.36	
T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,411,867.18	
T 1% 05/31/18	5,000,000.00	5,012,109.40	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,891,718.75	
T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,960,792.94	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,934,609.36	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,178,798.83	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,058,183.59	
T 2.125% 05/15/25	2,000,000.00	1,967,968.76	
T 2.125% 06/30/21	1,000,000.00	1,015,156.25	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,185,066.39	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,655,644.51	
T 2.25% 03/31/21	6,600,000.00	6,761,906.25	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,583,466.81	
T 2.25% 07/31/18	2,700,000.00	2,802,779.30	

T 2.25% 11/15/24	8,150,000.00	8,118,959.99
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,166,718.76
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,568,564.48
T 2.5% 02/15/45	6,080,000.00	5,348,500.00
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,566,031.29
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,241,894.55
T 2.625% 11/15/20	2,000,000.00	2,093,593.76
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,852,640.64
T 2.75% 02/15/24	10,600,000.00	11,034,351.53
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,991,632.82
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,331,406.24
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,192,306.62
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,907,886.72
T 2.75% 11/30/16	6,250,000.00	6,451,904.31
T 2.75% 12/31/17	9,100,000.00	9,546,291.02
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,112,062.50
T 2.875% 05/15/43	10,800,000.00	10,290,796.84
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,506,591.80
T 2% 02/15/23	1,100,000.00	1,090,955.07
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,181,140.59
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,048,203.12
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,835,179.67
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,299,328.11
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,841,304.69
T 2% 10/31/21	6,200,000.00	6,226,882.82
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,410,640.61
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,583,037.13
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,645,126.94
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,001,152.34
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,804,306.66
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,346,875.00
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,682,179.71
T 3.125% 08/15/44	10,250,000.00	10,256,206.06
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,729,912.08
T 3.125% 11/15/41	2,800,000.00	2,822,531.26
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,554,933.61
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,577,099.60
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,644,375.00
T 3.375% 05/15/44	7,500,000.00	7,872,509.77
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,092,765.62
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,160,781.26
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,635,729.51
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	6,048,173.83

T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,495,019.54	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,944,687.50	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,199,960.94	
T 3.75% 08/15/41	2,200,000.00	2,473,109.38	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,439,746.10	
T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,587,275.38	
T 3.875% 08/15/40	4,200,000.00	4,802,355.47	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	9,890,576.16	
T 3% 05/15/42	4,250,000.00	4,166,328.12	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	8,963,209.01	
T 3% 09/30/16	5,500,000.00	5,675,742.21	
T 3% 11/15/44	3,100,000.00	3,028,796.87	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,609,697.27	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	725,531.25	
T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,759,827.15	
T 4.25% 11/15/40	1,000,000.00	1,211,718.75	
T 4.375% 02/15/38	1,200,000.00	1,479,914.05	
T 4.375% 05/15/40	3,500,000.00	4,315,048.81	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,475,039.06	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,327,591.80	
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,320,843.75	
T 4.5% 05/15/17	4,800,000.00	5,148,656.25	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,254,101.56	
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	313,505.86	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,330,664.05	
T 4.625% 02/15/40	1,650,000.00	2,107,456.04	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,411,972.65	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	672,021.48	
T 5.25% 02/15/29	400,000.00	524,218.75	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,701,705.08	
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,162,312.49	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,601,085.93	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,288,791.02	
T 6.125% 11/15/27	350,000.00	487,450.19	
T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,595,171.87	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,158,309.57	
T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,285,937.50	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,324,650.39	
T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,669,378.90	
アメリカドル 小計	749,920,000.00	768,867,076.28	(93,532,679,829)
カナダドル CAN 1.25% 02/01/18	850,000.00	867,497.25	

	CAN 1.25% 03/01/18	1,990,000.00	2,033,222.80	
	CAN 1.25% 08/01/17	2,250,000.00	2,286,247.50	
	CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	512,920.00	
	CAN 1.5% 02/01/17	2,500,000.00	2,540,337.50	
	CAN 1.5% 03/01/20	1,450,000.00	1,501,322.75	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,650,000.00	1,665,666.75	
	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,687,257.00	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,464,309.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	850,000.00	890,676.75	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,643,116.25	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,700,000.00	1,841,278.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,300,000.00	1,435,219.50	
	CAN 2.75% 09/01/16	4,750,000.00	4,870,626.25	
	CAN 2.75% 12/01/48	800,000.00	891,912.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	370,000.00	428,236.15	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,200,000.00	1,356,942.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,200,000.00	2,483,294.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,740,000.00	2,219,631.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	3,031,276.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,100,000.00	2,814,651.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,941,712.50	
	CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,493,814.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,550,000.00	2,273,175.75	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,480,000.00	2,285,993.20	
	CAN 5% 06/01/37	1,690,000.00	2,507,833.25	
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	601,246.80	
	カナダドル 小計	43,730,000.00	49,569,415.95	(4,744,288,800)
メキシコベ ン	MBONO 10% 11/20/36	12,000,000.00	16,588,380.00	
	MBONO 10% 12/05/24	8,100,000.00	10,438,551.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	21,150,000.00	21,253,423.50	
	MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,165,041.00	
	MBONO 5% 12/11/19	11,300,000.00	11,266,100.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	9,500,000.00	9,914,580.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	17,000,000.00	17,864,875.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	29,800,000.00	31,215,500.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	16,000,000.00	17,724,560.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	19,900,000.00	22,413,270.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	9,300,000.00	10,490,167.50	
	MBONO 7.75% 12/14/17	9,700,000.00	10,460,189.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	18,500,000.00	22,181,592.50	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	19,967,310.00	
MBONO 8% 06/11/20	14,500,000.00	16,263,417.50		

	MBONO 8% 12/07/23	26,450,000.00	30,019,295.25
	メキシコペソ 小計	261,500,000.00	290,226,252.75 (2,234,742,146)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	800,000.00	767,892.00
	BGB 1.25% 06/22/18	1,100,000.00	1,143,092.50
	BGB 1% 06/22/31	800,000.00	714,912.00
	BGB 2.25% 06/22/23	1,700,000.00	1,878,721.00
	BGB 2.6% 06/22/24	1,940,000.00	2,195,197.30
	BGB 3.25% 09/28/16	100,000.00	104,166.50
	BGB 3.5% 06/28/17	1,520,000.00	1,629,736.40
	BGB 3.75% 06/22/45	740,000.00	1,007,480.40
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,943,037.50
	BGB 3% 06/22/34	920,000.00	1,091,317.80
	BGB 3% 09/28/19	1,050,000.00	1,175,916.00
	BGB 4.0% 03/28/17	1,910,000.00	2,047,109.35
	BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,950,427.00
	BGB 4.25% 03/28/41	1,890,000.00	2,742,512.85
	BGB 4.25% 09/28/21	2,300,000.00	2,825,182.00
	BGB 4.25% 09/28/22	2,400,000.00	2,994,864.00
	BGB 4.5% 03/28/26	1,550,000.00	2,048,263.00
	BGB 4% 03/28/18	1,400,000.00	1,556,646.00
	BGB 4% 03/28/22	1,110,000.00	1,356,986.10
	BGB 4% 03/28/32	1,100,000.00	1,458,968.50
	BGB 5.5% 03/28/28	1,850,000.00	2,702,674.25
	BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,138,668.50
	BGB 5% 03/28/35	1,900,000.00	2,884,048.00
	BTNS 1.75% 02/25/17	2,500,000.00	2,577,887.50
	BTNS 1% 07/25/17	3,600,000.00	3,686,184.00
	BTNS 2.5% 07/25/16	3,000,000.00	3,083,700.00
	BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,612,532.00
	BTPS 1.05% 12/01/19	500,000.00	499,712.50
	BTPS 1.15% 05/15/17	800,000.00	812,152.00
	BTPS 1.35% 04/15/22	1,300,000.00	1,269,944.00
	BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,449,488.00
	BTPS 1.5% 12/15/16	1,200,000.00	1,221,540.00
	BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,579,225.00
	BTPS 2.5% 05/01/19	2,000,000.00	2,117,930.00
	BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,522,250.50
	BTPS 2.75% 11/15/16	500,000.00	516,940.00
	BTPS 3.25% 09/01/46	1,000,000.00	1,021,380.00
	BTPS 3.5% 03/01/30	2,200,000.00	2,440,966.00
	BTPS 3.5% 06/01/18	1,100,000.00	1,189,710.50

BTPS 3.5% 11/01/17	2,000,000.00	2,138,590.00
BTPS 3.5% 12/01/18	3,200,000.00	3,491,360.00
BTPS 3.75% 03/01/21	4,700,000.00	5,301,670.50
BTPS 3.75% 05/01/21	750,000.00	845,276.25
BTPS 3.75% 08/01/16	2,900,000.00	3,009,112.50
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,513,840.00
BTPS 3.75% 09/01/24	3,300,000.00	3,733,966.50
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,251,421.00
BTPS 4.25% 03/01/20	5,800,000.00	6,617,162.00
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,996,275.50
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,638,332.00
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,899,249.00
BTPS 4.5% 03/01/19	1,600,000.00	1,808,456.00
BTPS 4.5% 03/01/24	3,450,000.00	4,101,273.75
BTPS 4.5% 03/01/26	3,200,000.00	3,850,448.00
BTPS 4.5% 05/01/23	1,450,000.00	1,719,910.25
BTPS 4.5% 08/01/18	2,780,000.00	3,099,213.50
BTPS 4.75% 05/01/17	3,770,000.00	4,069,771.55
BTPS 4.75% 06/01/17	1,700,000.00	1,840,275.50
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,402,137.25
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,847,792.00
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,419,308.75
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	2,210,467.50
BTPS 4.75% 09/15/16	2,400,000.00	2,528,280.00
BTPS 4% 02/01/17	4,950,000.00	5,236,827.75
BTPS 4% 02/01/37	3,050,000.00	3,535,971.75
BTPS 4% 09/01/20	2,200,000.00	2,500,817.00
BTPS 5.0% 08/01/39	2,450,000.00	3,261,795.25
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,354,771.25
BTPS 5.25% 11/01/29	2,340,000.00	3,063,399.30
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,617,135.50
BTPS 5.5% 11/01/22	2,950,000.00	3,678,856.50
BTPS 5.75% 02/01/33	2,050,000.00	2,888,542.25
BTPS 5% 03/01/22	2,800,000.00	3,384,780.00
BTPS 5% 03/01/25	3,500,000.00	4,343,692.50
BTPS 5% 08/01/34	2,500,000.00	3,286,162.50
BTPS 5% 09/01/40	2,800,000.00	3,719,016.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,800,000.00	3,961,986.00
BTPS 6% 05/01/31	4,500,000.00	6,372,630.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,062,984.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,221,904.00
DBR 0.5% 02/15/25	1,750,000.00	1,709,303.75
DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	2,965,957.50

DBR 1.5% 05/15/23	1,950,000.00	2,102,226.75
DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,640,385.40
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,564,695.00
DBR 1.75% 02/15/24	2,970,000.00	3,258,921.60
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	2,961,913.50
DBR 1% 08/15/24	2,150,000.00	2,208,931.50
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,778,012.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,247,230.00
DBR 2.5% 01/04/21	2,100,000.00	2,370,469.50
DBR 2.5% 07/04/44	2,020,000.00	2,499,840.90
DBR 2.5% 08/15/46	1,200,000.00	1,492,560.00
DBR 2% 01/04/22	2,900,000.00	3,221,813.00
DBR 2% 08/15/23	1,100,000.00	1,229,442.50
DBR 3.25% 01/04/20	4,700,000.00	5,386,129.50
DBR 3.25% 07/04/21	1,700,000.00	2,008,388.50
DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	2,647,925.50
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,999,240.00
DBR 3.75% 01/04/17	3,600,000.00	3,816,900.00
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,713,155.00
DBR 3% 07/04/20	2,300,000.00	2,634,960.50
DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,930,277.25
DBR 4.0% 01/04/37	2,850,000.00	4,211,331.00
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,486,656.00
DBR 4.25% 07/04/18	1,850,000.00	2,096,170.25
DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,585,517.00
DBR 4.75% 07/04/28	1,150,000.00	1,670,616.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,270,000.00	3,562,980.65
DBR 4.75% 07/04/40	1,850,000.00	3,124,307.75
DBR 4% 07/04/16	2,600,000.00	2,708,758.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,529,867.00
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,395,331.25
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,356,896.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,107,881.25
DBR 6.5% 07/04/27	1,550,000.00	2,525,732.75
FRTR 0.5% 05/25/25	3,800,000.00	3,557,161.00
FRTR 0.5% 11/25/19	3,400,000.00	3,445,458.00
FRTR 1.75% 05/25/23	3,000,000.00	3,208,320.00
FRTR 1.75% 11/25/24	3,200,000.00	3,383,840.00
FRTR 1% 05/25/18	3,500,000.00	3,608,920.00
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,363,262.50
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,585,387.50
FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	4,861,472.00

FRTR 2.25% 10/25/22	3,600,000.00	3,989,484.00
FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	3,885,612.50
FRTR 2.5% 10/25/20	3,430,000.00	3,813,508.30
FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	4,682,466.50
FRTR 3.25% 05/25/45	2,050,000.00	2,549,800.25
FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,070,688.00
FRTR 3.5% 04/25/20	5,050,000.00	5,828,179.75
FRTR 3.5% 04/25/26	4,010,000.00	4,901,824.00
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,527,884.50
FRTR 3.75% 04/25/21	4,050,000.00	4,815,693.00
FRTR 3.75% 10/25/19	3,750,000.00	4,324,537.50
FRTR 3% 04/25/22	5,000,000.00	5,789,050.00
FRTR 4.25% 04/25/19	4,700,000.00	5,444,456.50
FRTR 4.25% 10/25/17	3,250,000.00	3,577,177.50
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,449,588.00
FRTR 4.25% 10/25/23	3,600,000.00	4,567,392.00
FRTR 4.5% 04/25/41	2,850,000.00	4,260,493.50
FRTR 4.75% 04/25/35	2,550,000.00	3,771,781.50
FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,990,048.00
FRTR 4% 04/25/55	1,900,000.00	2,789,608.50
FRTR 4% 04/25/60	1,230,000.00	1,836,279.30
FRTR 4% 10/25/38	2,780,000.00	3,824,654.50
FRTR 5.5% 04/25/29	3,490,000.00	5,197,709.35
FRTR 5.75% 10/25/32	2,970,000.00	4,752,326.70
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,334,450.00
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,523,896.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,587,150.00
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,520,164.80
IRISH 0.8% 03/15/22	1,720,000.00	1,704,597.40
IRISH 2.4% 05/15/30	570,000.00	595,245.30
IRISH 2% 02/18/45	590,000.00	524,026.20
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,045,453.50
IRISH 3.9% 03/20/23	550,000.00	657,725.75
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,274,069.50
IRISH 4.5% 04/18/20	1,750,000.00	2,070,346.25
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	1,014,373.05
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,877,932.00
IRISH 5.5% 10/18/17	920,000.00	1,032,856.40
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	921,750.00
NETHER 0.25% 01/15/20	1,400,000.00	1,409,702.00
NETHER 0.25% 07/15/25	1,050,000.00	971,313.00
NETHER 0.5% 04/15/17	500,000.00	506,327.50
NETHER 1.25% 01/15/18	2,350,000.00	2,434,141.75

NETHER 1.25% 01/15/19	2,100,000.00	2,196,463.50	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,750,000.00	1,887,873.75	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,450,000.00	1,619,744.25	
NETHER 2.5% 01/15/17	3,250,000.00	3,384,550.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,400,000.00	1,631,406.00	
NETHER 2.75% 01/15/47	960,000.00	1,213,339.20	
NETHER 2% 07/15/24	1,700,000.00	1,864,483.50	
NETHER 3.25% 07/15/21	1,850,000.00	2,166,821.75	
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,273,017.50	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,230,000.00	2,741,182.90	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,950,000.00	2,880,042.75	
NETHER 4.0% 07/15/18	1,400,000.00	1,573,663.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,682,407.00	
NETHER 4% 01/15/37	1,530,000.00	2,231,397.90	
NETHER 4% 07/15/16	1,200,000.00	1,251,408.00	
NETHER 4% 07/15/19	2,000,000.00	2,319,620.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,380,977.30	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	301,106.00	
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,128,318.50	
OBL 0.25% 10/11/19	1,450,000.00	1,468,900.75	
OBL 0.5% 02/23/18	2,900,000.00	2,956,013.50	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,432,484.00	
OBL 0.5% 04/12/19	1,990,000.00	2,035,959.05	
OBL 0.5% 10/13/17	450,000.00	457,839.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,050,655.00	
OBL 1.25% 10/14/16	4,750,000.00	4,842,435.00	
OBL 1% 10/12/18	2,750,000.00	2,856,603.75	
RAGB 0.25% 10/18/19	500,000.00	503,040.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	470,000.00	471,872.95	
RAGB 1.65% 10/21/24	600,000.00	633,912.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,850,000.00	1,985,882.50	
RAGB 1.95% 06/18/19	800,000.00	860,252.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	561,440.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	660,000.00	857,336.70	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,107,366.75	
RAGB 3.4% 11/22/22	850,000.00	1,016,957.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,101,007.70	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,326,622.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	430,000.00	679,744.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,650,000.00	1,952,032.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,500,000.00	2,166,750.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,400,000.00	1,536,465.00	

RAGB 4.35% 03/15/19	2,300,000.00	2,666,850.00
RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,513,458.00
RAGB 4.85% 03/15/26	1,050,000.00	1,433,344.50
RAGB 4% 09/15/16	1,200,000.00	1,259,130.00
RAGB 6.25% 07/15/27	910,000.00	1,408,661.80
RFGB 0.375% 09/15/20	550,000.00	554,642.00
RFGB 0.75% 04/15/31	300,000.00	269,958.00
RFGB 1.125% 09/15/18	460,000.00	477,857.20
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	687,410.75
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	631,600.90
RFGB 2.625% 07/04/42	440,000.00	541,521.20
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	647,036.50
RFGB 2% 04/15/24	650,000.00	710,973.25
RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	691,305.00
RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	826,392.00
RFGB 3.875% 09/15/17	1,170,000.00	1,274,176.80
RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,231,555.50
RFGB 4% 07/04/25	750,000.00	963,075.00
SPGB 0.5% 10/31/17	1,700,000.00	1,701,853.00
SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,834,916.00
SPGB 1.6% 04/30/25	1,900,000.00	1,805,494.00
SPGB 1.95% 07/30/30	1,000,000.00	910,360.00
SPGB 2.1% 04/30/17	3,000,000.00	3,097,890.00
SPGB 2.15% 10/31/25	850,000.00	844,130.75
SPGB 2.75% 04/30/19	4,200,000.00	4,489,317.00
SPGB 2.75% 10/31/24	2,750,000.00	2,885,616.25
SPGB 3.3% 07/30/16	700,000.00	723,614.50
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,538,593.00
SPGB 3.8% 01/31/17	4,050,000.00	4,275,868.50
SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,177,384.00
SPGB 4.1% 07/30/18	2,400,000.00	2,651,076.00
SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,474,640.00
SPGB 4.25% 10/31/16	1,850,000.00	1,949,428.25
SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,354,430.25
SPGB 4.4% 10/31/23	1,000,000.00	1,181,835.00
SPGB 4.5% 01/31/18	3,030,000.00	3,332,833.35
SPGB 4.6% 07/30/19	1,200,000.00	1,373,172.00
SPGB 4.65% 07/30/25	1,900,000.00	2,312,898.50
SPGB 4.7% 07/30/41	1,430,000.00	1,817,537.15
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,704,591.00
SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,534,828.50
SPGB 4.9% 07/30/40	1,800,000.00	2,346,912.00
SPGB 4% 04/30/20	2,900,000.00	3,276,014.00

	SPGB 5.15% 10/31/28	2,710,000.00	3,471,089.95
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,070,000.00	1,457,837.55
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,000,000.00	2,492,980.00
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,050,000.00	3,729,143.50
	SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,534,768.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,950,000.00	2,723,262.75
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,800,000.00	3,521,742.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,252,443.20
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,500,000.00	2,071,065.00
	ユーロ 小計	559,640,000.00	653,422,439.20 (87,970,262,989)
イギリスポ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	3,650,000.00	3,680,733.00
	UKT 1.75% 01/22/17	2,600,000.00	2,647,775.00
	UKT 1.75% 07/22/19	3,000,000.00	3,058,395.00
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,847,862.50
	UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	3,019,245.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,700,000.00	2,775,249.00
	UKT 2.75% 09/07/24	3,500,000.00	3,724,822.50
	UKT 2% 07/22/20	3,300,000.00	3,384,909.00
	UKT 2% 09/07/25	1,150,000.00	1,140,570.00
	UKT 3.25% 01/22/44	3,200,000.00	3,547,072.00
	UKT 3.5% 01/22/45	2,220,000.00	2,577,386.70
	UKT 3.5% 07/22/68	1,700,000.00	2,131,800.00
	UKT 3.75% 07/22/52	2,150,000.00	2,708,645.25
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	606,166.00
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,954,882.50
	UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,535,772.50
	UKT 4.25% 03/07/36	2,830,000.00	3,577,035.10
	UKT 4.25% 06/07/32	2,330,000.00	2,901,770.35
	UKT 4.25% 09/07/39	1,420,000.00	1,823,393.60
	UKT 4.25% 12/07/27	1,690,000.00	2,064,934.95
	UKT 4.25% 12/07/40	2,200,000.00	2,843,412.00
	UKT 4.25% 12/07/46	1,800,000.00	2,404,215.00
	UKT 4.25% 12/07/49	1,600,000.00	2,183,104.00
	UKT 4.25% 12/07/55	1,800,000.00	2,538,612.00
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,582,785.00
	UKT 4.5% 09/07/34	2,450,000.00	3,173,938.25
	UKT 4.5% 12/07/42	2,100,000.00	2,848,681.50
	UKT 4.75% 03/07/20	3,950,000.00	4,559,623.25
UKT 4.75% 12/07/30	2,800,000.00	3,656,478.00	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,604,577.00	
UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,104,209.80	

	UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,354,691.50	
	UKT 4% 09/07/16	2,200,000.00	2,289,441.00	
	UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,279,928.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,404,773.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,100,000.00	1,587,635.50	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,760,820.00	
	UKT 8% 06/07/21	1,200,000.00	1,636,476.00	
イギリスポンド 小計		85,180,000.00	99,521,820.75 (18,606,599,607)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	450,000.00	515,031.75	
	SWISS 2% 04/28/21	400,000.00	458,036.00	
	SWISS 3% 01/08/18	1,970,000.00	2,166,950.75	
	SWISS 4% 02/11/23	1,140,000.00	1,510,574.10	
	SWISS 4% 04/08/28	490,000.00	725,060.35	
スイスフラン 小計		4,450,000.00	5,375,652.95 (690,233,838)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	7,550,000.00	8,111,153.75	
	SGB 2.5% 05/12/25	6,900,000.00	8,051,334.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,350,000.00	7,316,312.25	
	SGB 3.5% 06/01/22	9,460,000.00	11,470,391.90	
	SGB 3.75% 08/12/17	8,650,000.00	9,408,475.25	
	SGB 3% 07/12/16	6,550,000.00	6,778,562.25	
	SGB 4.25% 03/12/19	9,350,000.00	10,877,790.00	
	SGB 5% 12/01/20	10,150,000.00	12,823,357.75	
スウェーデンクローナ 小計		63,960,000.00	74,837,377.15 (1,075,413,109)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.75% 03/13/25	2,500,000.00	2,524,637.50	
	NGB 2% 05/24/23	5,740,000.00	5,974,192.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,630,000.00	9,875,913.10	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,203,540.25	
	NGB 4.25% 05/19/17	7,400,000.00	7,886,994.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	8,650,000.00	9,855,161.25	
ノルウェークローネ 小計		38,470,000.00	42,320,438.10 (633,960,162)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	6,150,000.00	6,557,191.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,700,000.00	6,146,167.50	
	DGB 2.5% 11/15/16	7,450,000.00	7,740,326.50	
	DGB 3% 11/15/21	10,400,000.00	12,129,000.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	14,950,000.00	23,843,979.25	
	DGB 4% 11/15/17	6,500,000.00	7,152,957.50	
	DGB 4% 11/15/19	11,100,000.00	13,023,352.50	
	DGB 7% 11/10/24	4,650,000.00	7,269,414.75	
		66,900,000.00	83,862,389.50	

デンマーククローネ 小計			(1,512,877,506)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	1,950,000.00	1,870,654.50
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,100,000.00	3,138,719.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,907,380.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,940,000.00	1,985,657.90
	POLGB 3.75% 04/25/18	1,800,000.00	1,884,906.00
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,720,000.00	2,862,759.20
	POLGB 4.75% 10/25/16	3,650,000.00	3,790,835.25
	POLGB 4% 10/25/23	3,150,000.00	3,412,127.25
	POLGB 5.25% 10/25/17	4,100,000.00	4,409,160.50
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,180,000.00	2,481,897.30
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,942,914.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,799,098.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,448,376.90
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,850,000.00	2,182,278.50
ポーランドズロチ 小計		36,130,000.00	39,116,764.30 (1,248,998,284)
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	650,000.00	632,248.50
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	2,932,106.10
	ACGB 2.75% 06/21/35	430,000.00	385,391.80
	ACGB 2.75% 10/21/19	1,020,000.00	1,047,835.80
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,100,000.00	2,167,515.00
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,240,000.00	1,249,777.40
	ACGB 3.25% 10/21/18	620,000.00	645,537.80
	ACGB 3.75% 04/21/37	900,000.00	933,115.50
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,600,000.00	2,909,374.00
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,800,000.00	1,882,098.00
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,600,000.00	2,875,847.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,100,000.00	1,268,795.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,590,000.00	1,861,921.80
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,890,000.00	4,338,050.20
	ACGB 5.5% 01/21/18	1,950,000.00	2,122,136.25
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,400,000.00	2,877,000.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,500,000.00	2,963,187.50
ACGB 5.75% 07/15/22	2,400,000.00	2,892,300.00	
ACGB 6% 02/15/17	3,350,000.00	3,561,050.00	
オーストラリアドル 小計		36,080,000.00	39,545,287.65 (3,592,293,930)
シンガポ ールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	593,844.00
	SIGB 1.625% 10/01/19	110,000.00	110,203.50
	SIGB 2.25% 06/01/21	280,000.00	282,910.60
	SIGB 2.375% 04/01/17	650,000.00	668,606.25
	SIGB 2.375% 06/01/25	200,000.00	197,762.00

	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	937,557.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	520,000.00	504,371.40
	SIGB 2.75% 07/01/23	250,000.00	256,787.50
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	202,475.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	301,372.50
	SIGB 3.125% 09/01/22	800,000.00	845,368.00
	SIGB 3.25% 09/01/20	930,000.00	991,347.45
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	427,494.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	773,871.60
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	827,720.00
	SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	805,689.50
	SIGB 4% 09/01/18	630,000.00	686,419.65
	シンガポールドル 小計	9,050,000.00	9,413,799.95 (849,030,617)
マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	2,600,000.00	2,602,587.00
	MGS 3.26% 03/01/18	1,450,000.00	1,445,729.75
	MGS 3.314% 10/31/17	1,000,000.00	1,000,875.00
	MGS 3.418% 08/15/22	1,750,000.00	1,696,012.50
	MGS 3.48% 03/15/23	1,450,000.00	1,401,744.00
	MGS 3.492% 03/31/20	1,550,000.00	1,540,661.25
	MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	750,724.00
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,156,084.50
	MGS 3.654% 10/31/19	1,200,000.00	1,203,462.00
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,247,857.00
	MGS 3.814% 02/15/17	2,700,000.00	2,730,267.00
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,515,457.50
	MGS 3.892% 03/15/27	750,000.00	733,792.50
	MGS 3.955% 09/15/25	540,000.00	537,885.90
	MGS 4.048% 09/30/21	1,400,000.00	1,417,045.00
	MGS 4.127% 04/15/32	1,400,000.00	1,368,542.00
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,678,223.25
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,563,647.75
	MGS 4.24% 02/07/18	2,700,000.00	2,756,551.50
	MGS 4.262% 09/15/16	1,000,000.00	1,012,995.00
MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,682,056.00	
MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,134,463.00	
MGS 4.935% 09/30/43	650,000.00	669,379.75	
MGS 5.248% 09/15/28	1,000,000.00	1,099,775.00	
	マレーシアリンギット 小計	35,790,000.00	35,945,818.15 (1,154,939,137)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	29,723,715.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	8,720,000.00	6,636,356.00

	SAGB 6.5% 02/28/41	7,300,000.00	5,603,626.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	9,420,000.00	8,965,956.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,700,000.00	7,584,577.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	7,000,000.00	6,885,795.00	
	SAGB 7% 02/28/31	17,300,000.00	14,886,131.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	6,200,000.00	6,339,159.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	8,200,000.00	7,941,290.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	3,420,000.00	3,379,883.40	
	SAGB 8.75% 02/28/48	12,400,000.00	12,248,038.00	
	SAGB 8% 12/21/18	8,700,000.00	8,842,375.50	
	南アフリカランド 小計	121,760,000.00	119,036,901.90	(1,160,609,793)
	合計		219,006,929,747	(219,006,929,747)

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 162銘柄	100.0%	42.7%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 261銘柄	100.0%	40.2%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	8.5%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 19銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 24銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	599,550,013
投資証券	53,336,971,800
未収配当金	408,822,352
未収利息	934
前払金	53,512,500
差入委託証拠金	9,880,000
流動資産合計	54,408,737,599
資産合計	54,408,737,599
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,512,500
未払金	360,990,368
未払解約金	152,380,799
流動負債合計	566,883,667
負債合計	566,883,667
純資産の部	
元本等	
元本	39,262,100,971
剰余金	
剰余金又は欠損金()	14,579,752,961
元本等合計	53,841,853,932
純資産合計	53,841,853,932
負債純資産合計	54,408,737,599

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

平成27年 7月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成27年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,262,100,971口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3713円 (1万口当たり純資産額) (13,713円)

（金融商品に関する注記）

1.金融商品の状況に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>

	平成27年 7月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 7月11日
期首元本額	22,536,630,858円
期中追加設定元本額	21,692,873,217円
期中一部解約元本額	4,967,403,104円
期末元本額	39,262,100,971円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,256,264,127円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,995,141円
S M T J - R E I Tインデックス・オープン	8,257,296,941円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,232,445,059円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,051,561,645円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,507,023,194円
分散投資コア戦略ファンドA	306,079,606円
分散投資コア戦略ファンドS	649,025,055円
コア投資戦略ファンド（切替型）	653,268,395円
J - R E I Tインデックス・オープン	300,658,829円
S M T インデックスバランス・オープン	19,377,882円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	587,209,876円
F O F s 用 J - R E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	431,895,221円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	3,621,720,532
合計	3,621,720,532

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「J - R E I Tインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	550,400,500	-	496,888,000	53,512,500
合計		550,400,500	-	496,888,000	53,512,500

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,678	1,155,557,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	1,061	355,965,500	
	森ヒルズリート投資法人	8,676	1,231,124,400	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	889	548,513,000	
	産業ファンド投資法人	1,948	985,688,000	
	大和ハウスリート投資法人	1,938	907,953,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	7,184	1,934,651,200	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	1,929	632,712,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,531	1,433,016,000	
	G L P 投資法人	13,212	1,473,138,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,618	620,727,800	
	日本プロロジスリート投資法人	9,564	2,094,516,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,202	1,294,721,400	
	星野リゾート・リート投資法人	275	337,150,000	
	S I A 不動産投資法人	415	184,882,500	
	イオンリート投資法人	6,025	892,905,000	
	ヒューリックリート投資法人	4,316	656,895,200	
	日本リート投資法人	2,144	574,592,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2,996	291,510,800	

日本ヘルスケア投資法人	336	76,507,200	
積水ハウス・リート投資法人	4,388	541,040,400	
トーセイ・リート投資法人	531	66,056,400	
ケネディクス商業リート投資法人	1,441	367,455,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	666	75,990,600	
日本ビルファンド投資法人	7,803	3,889,795,500	
ジャパンリアルエステイト投資法人	7,235	3,682,615,000	
日本リートファンド投資法人	13,430	2,973,402,000	
オリックス不動産投資法人	12,355	1,990,390,500	
日本プライムリアルティ投資法人	4,824	1,719,756,000	
プレミア投資法人	1,456	902,720,000	
東急リアル・エステート投資法人	5,402	747,636,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,071	418,761,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人	2,059	1,022,293,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	14,613	2,374,612,500	
森トラスト総合リート投資法人	7,295	1,530,491,000	
インヴィンシブル投資法人	14,748	877,506,000	
フロンティア不動産投資法人	2,741	1,352,683,500	
平和不動産リート投資法人	5,256	438,876,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,587	1,059,597,000	
福岡リート投資法人	4,128	807,436,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,237	1,214,691,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	5,626	634,612,800	
いちご不動産投資法人	7,827	614,419,500	
大和証券オフィス投資法人	2,675	1,463,225,000	
阪急リート投資法人	3,302	414,401,000	
スターツプロシード投資法人	960	172,416,000	
トップリート投資法人	973	458,283,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4,132	1,032,586,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	17,354	1,256,429,600	
日本賃貸住宅投資法人	9,112	698,890,400	
ジャパンエクセレント投資法人	6,702	855,175,200	
合計	255,866	53,336,971,800	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	404,207,481
コール・ローン	189,572,218
投資証券	54,106,717,033
派生商品評価勘定	202,300
未収配当金	182,460,027
未収利息	295
流動資産合計	54,883,159,354
資産合計	54,883,159,354
負債の部	
流動負債	
未払金	349,279,677
未払解約金	158,788,306
流動負債合計	508,067,983
負債合計	508,067,983
純資産の部	
元本等	
元本	33,439,197,963
剰余金	
剰余金又は欠損金()	20,935,893,408
元本等合計	54,375,091,371
純資産合計	54,375,091,371
負債純資産合計	54,883,159,354

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

平成27年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	33,439,197,963口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.6261円 (1万口当たり純資産額) (16,261円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	平成27年 7月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 7月11日
期首元本額	26,455,882,725円
期中追加設定元本額	17,257,393,441円
期中一部解約元本額	10,274,078,203円
期末元本額	33,439,197,963円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	300,680,581円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,197,042,834円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,050,228円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	8,021,335,369円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	16,555,941,142円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,252,291,321円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,907,644,716円
分散投資コア戦略ファンドA	186,680,893円
分散投資コア戦略ファンドS	388,095,791円
コア投資戦略ファンド（切替型）	389,877,759円
グローバルR E I Tインデックス・オープン	42,935,905円
S M T インデックスバランス・オープン	97,963,249円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	806,328,138円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	18,377,132円
F O F s 用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	264,952,905円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	407,296,068
合計	407,296,068

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルR E I Tインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	28,748,020	-	28,950,320	202,300
	アメリカドル	28,748,020	-	28,950,320	202,300
合計		28,748,020	-	28,950,320	202,300

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	29,650	912,627.00	
		AGREE REALTY CORP	8,660	261,099.00	
		ALEXANDER'S INC	1,480	621,600.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	32,750	2,950,120.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,810	719,524.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	52,380	1,993,059.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	63,910	1,039,815.70	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	410,470	3,404,848.65	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	15,190	281,015.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	71,640	2,767,453.20	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	8,370	86,043.60	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	8,000	121,680.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	35,030	305,811.90	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	25,440	729,619.20	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	59,720	9,954,129.60	
BIOMED REALTY TRUST INC	92,270	1,828,791.40	
BOSTON PROPERTIES	70,120	8,633,174.40	
BRANDYWINE REALTY TRUST	85,540	1,161,633.20	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	74,900	1,752,660.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	39,480	3,048,250.80	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	22,530	125,266.80	
CARETRUST REIT INC	13,746	183,784.02	
CBL & ASSOCIATES PRTYS	77,560	1,253,369.60	
CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	214,065.00	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	107,160	777,981.60	
CHATHAM LODGING TRUST	18,110	495,670.70	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	28,200	883,788.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	57,540	1,425,265.80	
CORESITE REALTY CORP	11,020	522,788.80	
CORPORATE OFFICE PPTYS	42,140	1,001,246.40	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	52,110	1,745,163.90	
COUSINS PROPERTIES INC	96,810	1,002,951.60	
CUBESMART	75,480	1,868,130.00	
CYRUSONE INC	30,400	898,928.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	38,957	1,286,749.71	
DDR CORPORATION	134,460	2,124,468.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	86,970	1,145,394.90	
DIGITAL REALTY TRUST INC	61,020	4,145,088.60	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	63,530	1,790,910.70	
DUKE REALTY CORP	153,900	2,934,873.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	31,220	917,868.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5,000	78,400.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	14,000	798,280.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	20,956	665,772.12	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	52,570	925,232.00	
EPR PROPERTIES	25,500	1,423,665.00	
EQUITY COMMONWEALTH	58,770	1,517,441.40	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	35,650	1,974,653.50	
EQUITY ONE INC	37,750	913,927.50	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	166,090	12,322,217.10	
ESSEX PROPERTY TRUST	29,920	6,612,619.20	
EXCEL TRUST INC	26,260	414,908.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	50,950	3,510,455.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	31,420	4,190,485.40	
FELCOR LODGING TRUST INC	54,920	570,618.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	47,990	931,485.90	

FIRST POTOMAC REALTY TRUST	26,460	275,184.00
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	36,030	413,984.70
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,790	1,428,873.70
GENERAL GROWTH PROPERTIES	287,910	7,595,065.80
GEO GROUP INC/THE	34,340	1,184,730.00
GETTY REALTY CORP	9,060	151,030.20
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,150	169,606.50
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	33,380	620,200.40
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	24,370	560,510.00
HCP INC	211,180	7,948,815.20
HEALTH CARE REIT INC	160,300	10,954,902.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	47,360	1,131,904.00
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	55,140	1,386,219.60
HERSHA HOSPITALITY TRUST	23,920	657,560.80
HIGHWOODS PROPERTIES INC	44,010	1,802,649.60
HOME PROPERTIES INC	26,030	1,904,615.10
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	69,900	2,021,508.00
HOST HOTELS AND RESORTS INC	346,770	7,129,591.20
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	34,600	998,210.00
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	8,500	66,130.00
INLAND REAL ESTATE CORP	37,640	361,720.40
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	49,890	364,197.00
IRON MOUNTAIN INC	83,590	2,563,705.30
KILROY REALTY CORPORATION	39,530	2,701,875.50
KIMCO REALTY CORP	187,780	4,437,241.40
KITE REALTY GROUP TRUST	39,340	1,003,170.00
LASALLE HOTEL PROPERTIES	52,230	1,923,630.90
LEXINGTON CORP PROPERTIES	100,610	854,178.90
LIBERTY PROPERTY TRUST	66,800	2,183,024.00
LTC PROPERTIES INC	16,890	736,572.90
MACERICH CO/THE	64,290	4,956,116.10
MACK-CALI REALTY CORP	39,340	744,312.80
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	96,570	1,302,729.30
MID-AMERICA APARTMENT COMM	33,700	2,577,713.00
MONMOUTH REIT -CL A	26,640	261,871.20
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	73,560	684,108.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	60,890	2,213,351.50
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,000	123,100.00
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,340	922,062.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	543,200.00
NEW YORK REIT INC	77,160	775,458.00

NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	133,200.00	
NORTHSTAR REALTY FINANCE	127,050	2,011,201.50	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	72,276	2,551,342.80	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,700	103,729.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	35,870	654,268.80	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	31,640	1,388,363.20	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,210	656,056.60	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,870	507,370.40	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,220	1,223,404.00	
POST PROPERTIES	25,180	1,451,878.80	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,500	76,350.00	
PROLOGIS INC	239,470	9,159,727.50	
PS BUSINESS PARKS INC	9,310	686,240.10	
PUBLIC STORAGE	66,270	12,838,487.10	
QTS REALTY TRUST INC	14,590	549,897.10	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	33,070	561,197.90	
REALTY INCOME CORP	106,180	4,878,971.00	
REGENCY CENTERS CORP	43,470	2,691,227.70	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	44,600	717,614.00	
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	110,790	1,614,210.30	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	26,000	381,680.00	
RLJ LODGING TRUST	60,370	1,843,096.10	
ROUSE PROPERTIES INC	16,050	274,134.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	23,270	1,285,202.10	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	30,810	834,026.70	
SAUL CENTERS INC	5,300	266,484.00	
SELECT INCOME REIT	15,420	327,366.60	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	109,630	1,955,799.20	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	17,380	286,248.60	
SIMON PROPERTY GROUP	141,730	25,244,947.60	
SL GREEN REALTY CORP	45,220	5,151,914.60	
SOVRAN SELF STORAGE INC	16,790	1,542,497.30	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	203,720	1,996,456.00	
STAG INDUSTRIAL INC	31,380	644,545.20	
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	16,610	412,758.50	
STORE CAPITAL CORP	24,470	501,635.00	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	124,620	1,570,212.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	40,380	563,301.00	
SUN COMMUNITIES INC	22,490	1,467,472.50	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	94,700	1,473,532.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	42,900	1,413,126.00	

	TAUBMAN CENTERS INC	27,870	1,964,835.00	
	TERRENO REALTY CORP	19,010	386,853.50	
	TRADE STREET RESIDENTIAL INC	4,930	33,573.30	
	UDR INC	116,490	3,843,005.10	
	UMH PROPERTIES INC	7,500	74,550.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	275,546.10	
	URBAN EDGE PROPERTIES	40,205	845,109.10	
	URSTADT BIDDLE - CL A	12,770	242,885.40	
	VENTAS INC	150,260	9,630,163.40	
	VORNADO REALTY TRUST	80,060	7,755,412.20	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	30,980	815,703.40	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	51,780	1,760,002.20	
	WHITESTONE REIT	13,600	180,744.00	
	WP CAREY INC	43,900	2,608,538.00	
	WP GLIMCHER INC	80,240	1,113,731.20	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	48,950	1,062,215.00	
	アメリカドル 小計	8,790,200	313,285,538.40 (38,111,185,746)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	16,190	591,420.70	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	34,460	467,277.60	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,110	663,044.80	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	7,307	190,639.63	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	26,990	745,193.90	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	16,130	680,363.40	
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,030	274,829.40	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	35,590	634,925.60	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,250	344,167.50	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	182,354.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	24,400	233,508.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	20,150	164,021.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	23,290	567,111.50	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,910	413,247.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	63,620	1,441,629.20	
	INVEST REAL ESTATE INVESTME	24,590	122,950.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	68,090.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	17,470	218,549.70	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	77,716.50	

	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	225,835.40
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	7,403	165,086.90
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	13,390	102,299.60
	PLAZA RETAIL REIT	15,650	67,138.50
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	44,240	207,485.60
	RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,000	84,500.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	71,890	1,964,753.70
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	33,210	1,002,942.00
	カナダドル 小計	641,340	11,901,081.13 (1,139,052,474)
ユーロ	AEDIFICA	6,350	315,214.00
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	39,000	456,300.00
	ALTAREA	1,000	149,000.00
	ANF IMMOBILIER	3,270	71,907.30
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	34,510	396,519.90
	BEFIMMO S.C.A.	8,120	450,903.60
	BENI STABILI SPA	402,000	269,340.00
	COFINIMMO	9,110	862,352.60
	EUROCOMMERCIAL	20,990	787,439.85
	FONCIERE DES REGIONS	21,760	1,692,928.00
	GECINA SA	16,680	1,870,662.00
	GREEN REIT PLC	287,170	420,416.88
	HAMBORNER REIT AG	27,440	235,435.20
	HIBERNIA REIT PLC	318,290	401,045.40
	ICADE	15,120	992,174.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	157,540	124,929.22
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	160,000	175,680.00
	KLEPIERRE	97,100	3,908,275.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	18,910	183,200.08
	MERCIALYS	26,620	532,133.80
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	87,000	944,385.00
	NSI NV	39,000	136,578.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	44,440	9,959,004.00
	VASTNED RETAIL	9,340	368,930.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,120	418,240.80
	WERELDHAVE NV	15,900	817,578.00
	ユーロ 小計	1,872,780	26,940,573.03 (3,627,009,347)
イギリスポンド	ASSURA PLC	364,838	201,572.99
	BIG YELLOW GROUP PLC	64,640	414,019.20
	BRITISH LAND CO PLC	469,060	3,820,493.70

	DERWENT LONDON PLC	49,740	1,737,915.60	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	156,830	1,267,186.40	
	HAMMERSON PLC	357,720	2,289,408.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	303,580	347,295.52	
	INTU PROPERTIES PLC	429,680	1,368,101.12	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	366,640	4,674,660.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	268,880	434,510.08	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	39,967	100,916.67	
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	24,000	114,180.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	51,510	200,889.00	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	425,670	223,263.91	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	86,990	244,441.90	
	SEGRE PLC	341,440	1,433,706.56	
	SHAFTESBURY PLC	129,390	1,116,635.70	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	318,110	359,782.41	
	WORKSPACE GROUP PLC	52,190	466,578.60	
	イギリスポンド 小計	4,300,875	20,815,557.36	(3,891,676,604)
オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	110,000	114,950.00	
	360 CAPITAL OFFICE FUND	22,000	45,100.00	
	ABACUS PROPERTY GROUP	122,010	352,608.90	
	ALE PROPERTY GROUP	77,000	281,050.00	
	ARENA REIT	73,057	111,046.64	
	ASPEN GROUP	70,000	94,850.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	21,820	110,409.20	
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	32,000	73,280.00	
	BWP TRUST	232,960	738,483.20	
	CHARTER HALL GROUP	142,920	656,002.80	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	151,280	639,914.40	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	591,940	621,537.00	
	DEXUS PROPERTY GROUP	429,040	3,097,668.80	
	FEDERATION CENTRES	1,472,761	4,359,372.56	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	216,942.00	
	GALILEO JAPAN TRUST	40,590	71,844.30	
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	186,179.68	
	GOODMAN GROUP	714,990	4,482,987.30	
	GPT GROUP	808,810	3,453,618.70	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	85,200	268,380.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	53,167	135,044.18	
	INDUSTRIA REIT	36,000	66,780.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	400,000	178,000.00	
INVESTA OFFICE FUND	269,190	1,030,997.70		
MIRVAC GROUP	1,656,430	3,105,806.25		

	NATIONAL STORAGE REIT	113,217	183,411.54	
	SCENTRE GROUP	2,437,420	9,432,815.40	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	313,790	658,959.00	
	STOCKLAND	1,071,810	4,437,293.40	
	WESTFIELD CORP	876,040	8,112,130.40	
	オーストラリアドル 小計	12,745,730	47,317,463.35 (4,298,318,370)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	335,000	365,150.00	
	DNZ PROPERTY FUND LTD	133,280	279,888.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	480,000	571,200.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	582,000	759,510.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	460,000	526,700.00	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	180,000	276,300.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	92,460	153,483.60	
	ニュージーランドドル 小計	2,262,740	2,932,231.60 (240,941,470)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,161,000	4,794,930.00	
	FORTUNE REIT	627,000	4,733,850.00	
	LINK REIT	1,037,000	45,887,250.00	
	NEW CENTURY REIT	125,000	395,000.00	
	PROSPERITY REIT	592,000	1,628,000.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	447,000	943,170.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	293,000	969,830.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	442,000	1,692,860.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	459,000	1,863,540.00	
	香港ドル 小計	5,183,000	62,908,430.00 (987,033,266)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	229,000	343,500.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	450,000	312,750.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	936,266	2,247,038.40	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	421,000	549,405.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	302,000	344,280.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	521,000	356,885.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	949,400	1,447,835.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,171,200	2,494,656.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	286,560	459,928.80	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	339,000	547,485.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	303,420.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	228,000	321,480.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	264,000	535,920.00	

	FRASERS COMMERCIAL TRUST	205,600	312,512.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	180,000	144,900.00	
	KEPPEL DC REIT	450,000	474,750.00	
	KEPPEL REIT	827,000	934,510.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	734,000	256,900.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	594,000	855,360.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	791,000	791,000.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	524,160	804,585.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	673,920	761,529.60	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	240,000	175,200.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	332,000	312,080.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	157,000	367,380.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	257,000	218,450.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	202,000	171,700.00	
	SPH REIT	375,000	390,000.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	700,000	612,500.00	
	SUNTEC REIT	1,138,000	1,957,360.00	
	シンガポールドル 小計	14,867,106	19,805,300.40 (1,786,240,043)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	72,370	786,661.90	
	イスラエルシェケル 小計	72,370	786,661.90 (25,259,713)	
	合計	50,736,141	54,106,717,033 (54,106,717,033)	

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 154銘柄	100.0%	70.4%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.1%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	6.7%
イギリスポンド	投資証券 19銘柄	100.0%	7.2%
オーストラリアドル	投資証券 30銘柄	100.0%	7.9%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 9銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.3%

イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
-----------	----------	--------	------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	124,470,708
コール・ローン	672,734,479
社債券	29,968,889,528
派生商品評価勘定	3,518,502
未収利息	1,048
流動資産合計	30,769,614,265
資産合計	30,769,614,265
負債の部	
流動負債	
未払金	355,497,795
未払解約金	30,770,000
流動負債合計	386,267,795
負債合計	386,267,795
純資産の部	
元本等	
元本	72,889,834,446
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	42,506,487,976
元本等合計	30,383,346,470
純資産合計	30,383,346,470
負債純資産合計	30,769,614,265

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券

平成27年 7月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	72,889,834,446口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 42,506,487,976円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.4168円 (1万口当たり純資産額) (4,168円)

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成27年 7月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 7月11日
期首元本額	29,543,676,863円
期中追加設定元本額	44,018,952,302円
期中一部解約元本額	672,794,719円
期末元本額	72,889,834,446円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	53,765,496,254円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,825,401,070円
コア投資戦略ファンド（成長型）	11,663,947,841円
分散投資コア戦略ファンドA	557,839,370円
分散投資コア戦略ファンドS	1,161,328,295円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,247,891,255円
SMTAMコモディティ・オープン	548,859,501円
コモディティ・オープン	117,905,303円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,165,557円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		1,015,969,099
合計		1,015,969,099

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	500,000,000	-	503,518,502	3,518,502
	アメリカドル	500,000,000	-	503,518,502	3,518,502
	合計	500,000,000	-	503,518,502	3,518,502

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 030 07/31/15	20,000,000.00	15,315,400.00	
		BAR USD COM 031 10/30/15	20,000,000.00	16,969,200.00	
		BAR USD COM 032 2/26/16	12,000,000.00	11,324,520.00	

	CS USD COM 008 07/31/15	10,000,000.00	7,688,000.00	
	CS USD COM 009 08/28/15	15,000,000.00	11,835,000.00	
	CS USD COM 010 10/27/15	20,000,000.00	16,918,000.00	
	CS USD COM 011 01/29/16	18,000,000.00	17,539,200.00	
	ETFS ALL COMMODITIES	320,250,000.00	32,185,125.00	
	IPATH DOW COMM 06/12/36	35,930,000.00	10,038,842.00	
	STAR HELIOS 001 04/18/16	64,000,000.00	62,124,800.00	
	UBS USD COM 007 08/12/15	17,000,000.00	13,176,700.00	
	UBS USD COM 008 09/25/15	20,000,000.00	16,112,000.00	
	UBS USD COM 009 11/27/15	17,000,000.00	15,126,600.00	
	アメリカドル 小計	589,180,000.00	246,353,387.00 (29,968,889,528)	
	合計		29,968,889,528 (29,968,889,528)	

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

FRMシグマ リンク マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	606,344,716
社債券	15,740,823,000

	平成27年 7月10日現在
項目	金額（円）
未収利息	945
流動資産合計	16,347,168,661
資産合計	16,347,168,661
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	15,794,682,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	552,486,195
元本等合計	16,347,168,661
純資産合計	16,347,168,661
負債純資産合計	16,347,168,661

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 7月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,794,682,466口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0350円 (1万口当たり純資産額) (10,350円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成27年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

平成27年 7月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成27年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 7月11日
期首元本額	10,641,147,645円
期中追加設定元本額	11,835,152,174円
期中一部解約元本額	6,681,617,353円
期末元本額	15,794,682,466円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	5,913,451,878円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,902,348,618円
分散投資コア戦略ファンドA	883,827,968円
分散投資コア戦略ファンドS	679,119,731円
コア投資戦略ファンド（切替型）	791,912,771円
F O F s 用 F R Mシグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	624,021,500円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	679,632,150
合計	679,632,150

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「FRMシグマ リンク マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	SIGNUM SIGMA2 0% 05/12/25	15,225,000,000	15,740,823,000	
	合計	15,225,000,000	15,740,823,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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27年 7月31日現在)

資産総額	23,788,852,271円
負債総額	96,406,678円
純資産総額(-)	23,692,445,593円
発行済口数	22,188,548,011口
1口当たり純資産額(/)	1.0678円
(1万口当たり純資産額)	(10,678円)

【分散投資コア戦略ファンドS】

【純資産額計算書】

(平成27年 7月31日現在)

資産総額	25,486,542,046円
負債総額	133,924,505円
純資産総額(-)	25,352,617,541円
発行済口数	22,590,758,505口
1口当たり純資産額(/)	1.1223円
(1万口当たり純資産額)	(11,223円)

(参考)

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27年 7月31日現在)

資産総額	334,922,211,122円
負債総額	7,276,667,658円
純資産総額(-)	327,645,543,464円
発行済口数	247,342,866,779口
1口当たり純資産額(/)	1.3247円
(1万口当たり純資産額)	(13,247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27年 7月31日現在)

資産総額	257,047,069,693円
負債総額	469,100,923円
純資産総額(-)	256,577,968,770円
発行済口数	118,246,230,530口
1口当たり純資産額(/)	2.1699円
(1万口当たり純資産額)	(21,699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27年 7月31日現在)

資産総額	224,038,887,303円
負債総額	372,355,852円
純資産総額(-)	223,666,531,451円
発行済口数	77,789,034,532口
1口当たり純資産額(/)	2.8753円
(1万口当たり純資産額)	(28,753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27年 7月31日現在)

資産総額	59,806,094,334円
負債総額	595,501,265円
純資産総額(-)	59,210,593,069円
発行済口数	40,124,530,418口
1口当たり純資産額(/)	1.4757円
(1万口当たり純資産額)	(14,757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27年 7月31日現在）

資産総額	57,137,246,454円
負債総額	235,006,710円
純資産総額（ - ）	56,902,239,744円
発行済口数	33,747,296,395口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6861円
（1万口当たり純資産額）	（16,861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27年 7月31日現在）

資産総額	29,799,991,710円
負債総額	452,770,808円
純資産総額（ - ）	29,347,220,902円
発行済口数	73,816,217,681口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3976円
（1万口当たり純資産額）	（3,976円）

FRMシグマ リンク マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 7月31日現在）

資産総額	17,156,513,379円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	17,156,513,379円
発行済口数	16,318,934,043口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0513円
（1万口当たり純資産額）	（10,513円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとし、ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとし、
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成27年 7月31日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成27年10月 9日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27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	425	7,129,597
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	23	80,174
単位型公社債投資信託	0	0
合計	448	7,209,771

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）の財務諸表について、有限責任 不審監査法人により監査を受けておりま

す。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	10,457,599	12,314,170
前払費用	114,325	125,306
未収委託者報酬	2,735,763	4,518,944
未収運用受託報酬	15,268	-
繰延税金資産	144,183	116,728
その他	3,448	8,789
流動資産合計	13,470,589	17,083,939
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 67,359	1 57,461
器具備品	1 87,378	1 116,879
有形固定資産合計	154,737	174,341
無形固定資産		
ソフトウェア	203,360	197,641
その他	4,686	7,648
無形固定資産合計	208,046	205,290
投資その他の資産		
投資有価証券	69,583	60,277
長期前払費用	34,773	5,425
長期貸付金	28,838	25,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	117,743	114,415
その他	553	463
貸倒引当金	28,838	25,838
投資その他の資産合計	247,653	205,581
固定資産合計	610,437	585,213
資産合計	14,081,027	17,669,152

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,353	13,868

未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
固定負債		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
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	62,500	65,500
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	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	22,773,831	28,159,652
運用受託報酬	55,511	8,732
営業収益合計	22,829,342	28,168,384

営業費用		
支払手数料	10,451,296	12,922,655
広告宣伝費	76,961	130,384
公告費	-	880
調査費	5,091,105	5,994,577
調査費	259,236	279,702
委託調査費	4,830,390	5,712,946
図書費	1,479	1,928
営業雑経費	1,264,334	1,299,065
通信費	17,246	17,456
印刷費	327,214	330,921
協会費	22,524	23,182
諸会費	773	105
情報機器関連費	837,859	857,009
その他営業雑経費	58,716	70,390
営業費用合計	16,883,698	20,347,563
一般管理費		
給料	2,201,964	2,185,555
役員報酬	102,330	89,055
給料・手当	1,846,450	1,839,000
賞与	253,183	257,499
退職給付費用	72,029	71,270
役員退職慰労金	1,070	-
福利費	207,122	212,286
交際費	2,758	4,491
旅費交通費	45,973	55,788
租税公課	42,862	42,868
不動産賃借料	130,938	130,938
寄付金	3,385	-
減価償却費	119,445	129,285
諸経費	1 219,615	1 212,345
一般管理費合計	3,047,165	3,044,830
営業利益	2,898,479	4,775,990

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802
収益分配金	3,234	4,617
投資有価証券売却益	553	1,846
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	1,775	1,936
営業外収益合計	16,027	18,203

営業外費用

長期前払費用償却	1	23,222	1	27,866
支払補償費		14,648		7,656
投資有価証券売却損		284		117
その他		2,112		3,283
営業外費用合計		40,268		38,924
経常利益		2,874,238		4,755,269
特別損失				
外国税関連費用		-	2	56,222
特別損失合計		-		56,222
税引前当期純利益		2,874,238		4,699,047
法人税、住民税及び事業税		1,623,332		1,667,610
法人税等調整額		502,474		30,739
法人税等合計		1,120,857		1,698,349
当期純利益		1,753,381		3,000,697

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				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	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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
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	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	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
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

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。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
建 物	35,517	千円	45,415	千円
器具備品	188,630	"	218,270	"
計	224,147	"	263,685	"

(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25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
諸経費	73,276	千円	37,614	千円
長期前払費用償却	23,222	"	27,866	"

2外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月

23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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

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27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27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27年3月31日	平成27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。

当事業年度（平成27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	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(*) 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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	平成26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	-	3

これについては、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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度(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	-

当事業年度(平成27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	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(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

当事業年度（平成27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	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

（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。

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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
34,635	1,846	117

（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26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）

(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付費用	72,029	71,270

(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13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	102,368 千円	64,846 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	10,277 "	8,356 "
賞与引当金損金算入限度超過額	33,736 "	31,368 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	111,906 "	110,871 "
外国税関連費用損金不算入額	- "	18,609 "
その他	13,094 "	5,855 "
繰延税金資産 合計	271,384 "	239,908 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	1,503 "	1,546 "
投資有価証券売却益益金不算入額	7,953 "	7,217 "
繰延税金負債 合計	9,457 "	8,763 "
繰延税金資産(負債)の純額	261,926 "	231,144 "

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27年法律第9号)及び「地方税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第2号)が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。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する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27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等については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については32.34%となります。

この税率変更により、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20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千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25年4月1日 至 平成26年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・レアルコース）	3,172,592千円

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・レアルコース）	3,178,319千円

（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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

- (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）

当事業年度（平成27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）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以

下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年10月9日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成27年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成27年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

の業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成27年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月 5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27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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

青木裕晃

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの平成26年7月11日から平成27年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドAの平成27年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成27年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

青木裕晃

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの平成26年7月11日から平成27年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドSの平成27年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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