

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年12月16日
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポートニング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	コア投資戦略ファンド（切替型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	当初自己設定 100万円 継続募集額 上限10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1. 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成25年9月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

2. 【訂正の内容】

第一部【証券情報】

原届出書の「第一部 証券情報」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

(4)発行（売）価格

<訂正前>

（前略）

継続申込期間

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。

<訂正後>

（前略）

継続申込期間

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。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

(8)申込取扱場所

<訂正前>

（前略）

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。）

<訂正後>

（前略）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

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。）

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

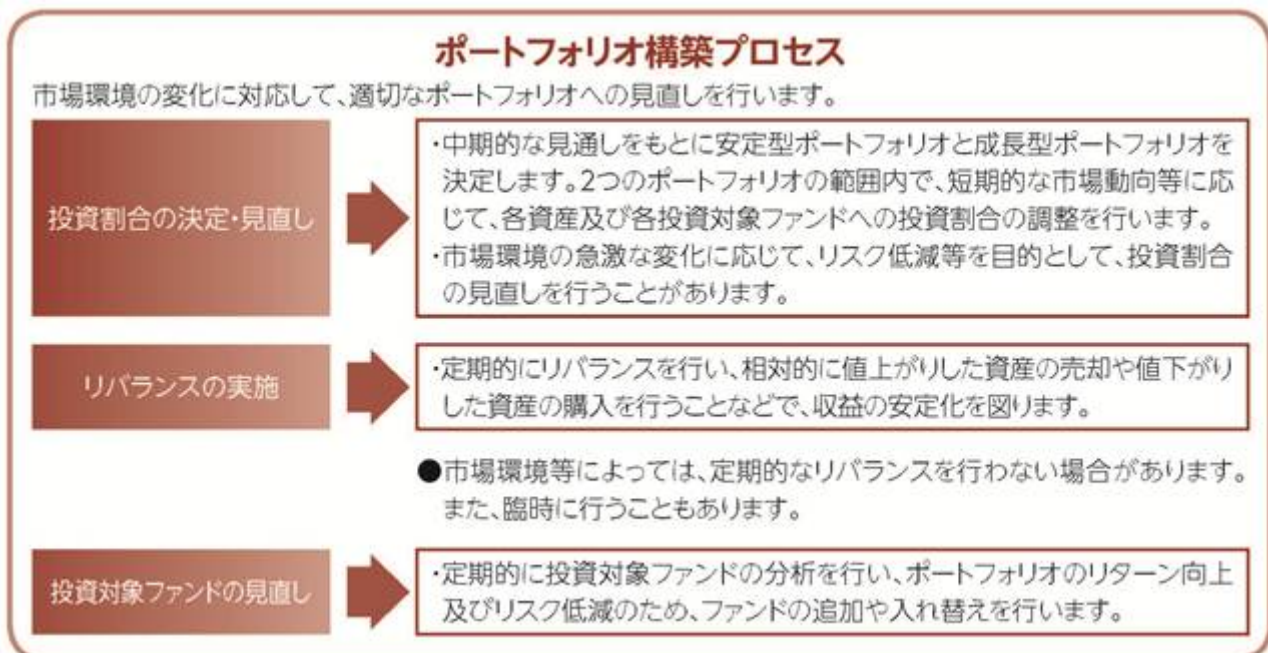
原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「1 ファンドの性格」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

(1) ファンドの目的及び基本的性格

ファンドの特色

「ポートフォリオ構築プロセス」を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>



<「コアラップ(切替型)」の切替機能のイメージ>

短期的な市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合を機動的に調整します。



※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

(3)ファンドの仕組み

委託会社の概況

該当情報を以下の内容に訂正します。

(注) 下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

イ．資本金の額：3億円（平成25年7月31日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年7月31日現在）

（後略）

<訂正後>

イ．資本金の額：3億円（平成25年10月31日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年10月31日現在）

（後略）

2 投資方針

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

(2)投資対象

該当情報を以下の内容に訂正します。

(注) 下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

- 投資対象ファンドの概要 -

（中略）

以下の内容は、平成25年9月25日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

（中略）

11. HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

（中略）	（中略）
設定日	<u>平成25年9月（予定）</u>
（中略）	（中略）

（後略）

<訂正後>

（前略）

- 投資対象ファンドの概要 -

（中略）

以下の内容は、平成25年10月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

（中略）

11. HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

（中略）	（中略）
設定日	平成25年10月2日
（中略）	（中略）

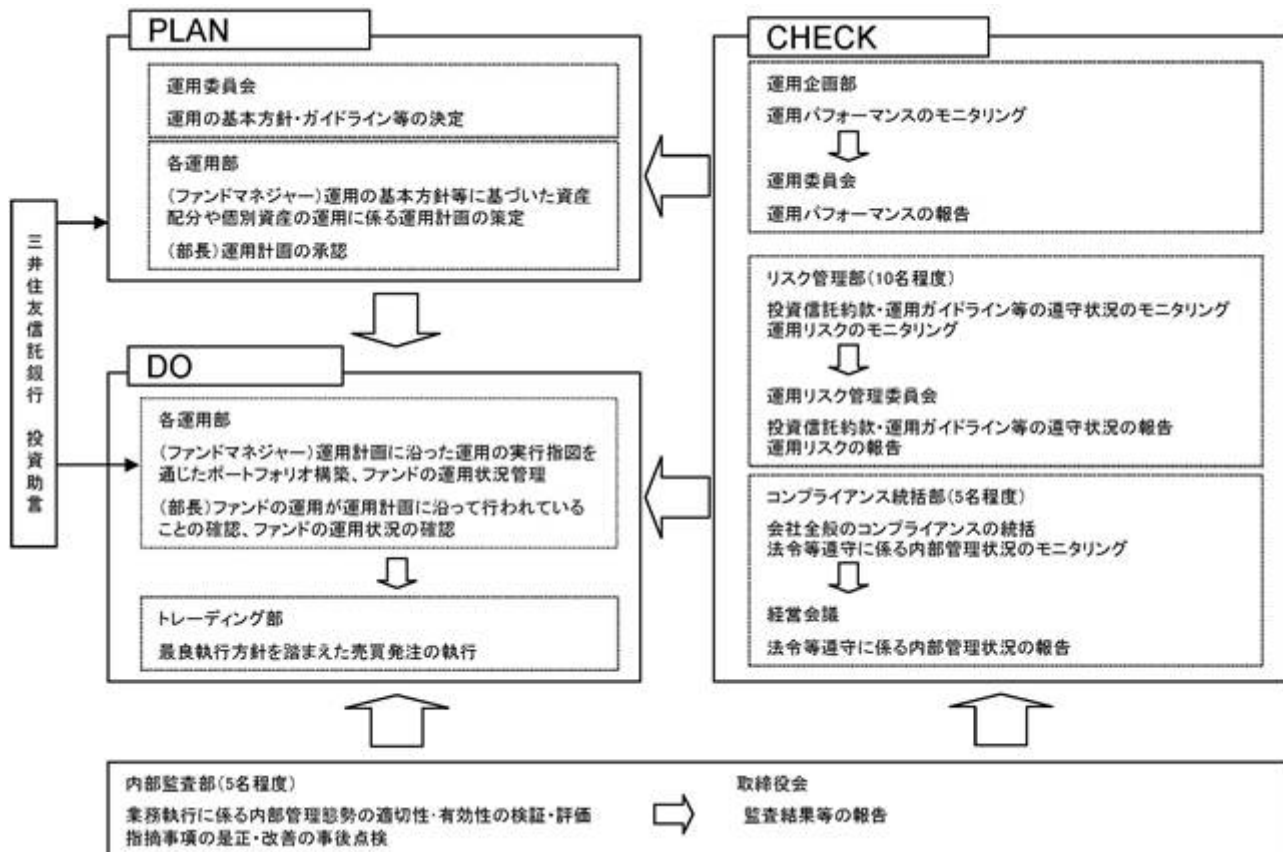
（後略）

(3)運用体制

該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年12月16日現在のものであり、今後変更されることがあります。



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

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

3 投資リスク

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「3 投資リスク」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部 _____ は訂正部分を示します。

(2) リスクの管理体制

< 訂正前 >

委託会社におけるリスク管理体制（平成25年10月1日現在（予定））

（後略）

< 訂正後 >

委託会社におけるリスク管理体制

（後略）

4 手数料等及び税金

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「4 手数料等及び税金」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部 _____ は訂正部分を示します。

(1) 申込手数料

< 訂正前 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）に、3.15%（ ）（税抜3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

（後略）

< 訂正後 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（当初自己設定においては1口当たり1円）に、3.15%（ ）（税抜3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

（後略）

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

（前略）

上記は、平成25年7月31日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

上記は、平成25年10月31日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

[次へ](#)

5 運用状況

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

以下の記載は、平成25年10月31日現在の状況について記載してあります。

(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	280,413	27.81
	ケイマン	11,012	1.09
	小計	291,425	28.91
投資証券	ルクセンブルク	69,612	6.90
親投資信託受益証券	日本	630,078	62.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,062	1.69
合計(純資産総額)		1,008,177	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	79,739	1.3920	111,000	1.3854	110,470	10.96
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	39,117	2.3263	91,000	2.3508	91,956	9.12
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	56,109	1.6218	91,000	1.6294	91,424	9.07
日本	親投資信託受益証券	FRM シグマ リンク マザーファンド	82,976	0.8408	69,767	0.8703	72,214	7.16
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	47,681	1.4890	71,000	1.5122	72,103	7.15
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	40.215	1,717.00	69,049	1,731.00	69,612	6.90
日本	投資信託受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	71,130	0.9663	68,739	0.9746	69,323	6.88

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)	69,000	1.0000	69,000	0.9999	68,993	6.84
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)	65,614	1.0390	68,178	1.0461	68,638	6.81
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	47,850	1.2782	61,163	1.2807	61,281	6.08
日本	親投資信 託受益証 券	J-REITインデックス マザーファン ド	34,734	1.1516	40,000	1.1595	40,274	3.99
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	34,808	1.1491	40,000	1.1494	40,008	3.97
日本	投資信託 受益証券	FOFs用外国債券インデックス 為替 ヘッジあり(適格機関投資家専用)	36,456	1.0076	36,734	1.0133	36,940	3.66
日本	投資信託 受益証券	FOFs用米ドル建新興国債券インデッ クス 為替ヘッジあり(適格機関投資 家専用)	39,468	0.9208	36,343	0.9253	36,519	3.62
日本	親投資信 託受益証 券	新興国株式インデックス マザー ファンド	13,844	2.1670	30,000	2.2018	30,481	3.02
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	45,537	0.4392	20,000	0.4363	19,867	1.97
ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	10.9627	1,003.40	11,000	1,004.55	11,012	1.09

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	28.91
投資証券	6.90
親投資信託受益証券	62.50
合計	98.31

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
平成25年10月末日	1,008,177		10,082	

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

該当事項はありません。

(4)設定及び解約の実績

該当事項はありません。

(参考情報)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	7,634,446,100	25.95
国債証券	日本	12,995,554,000	44.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,788,617,216	29.87
合計(純資産総額)		29,418,617,316	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第375回国庫短期証券		13,000,000,000	99.91	12,989,179,000	99.96	12,995,554,000	0.0	2014/06/20	44.17
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	82,200	5,176.94	425,544,483	5,370.00	441,414,000			1.50
日本	株式	日本軽金属ホールディングス	非鉄金属	2,335,100	153.25	357,865,142	140.00	326,914,000			1.11
日本	株式	宇部興産	化学	1,205,000	199.26	240,119,805	203.00	244,615,000			0.83
日本	株式	サッポロホールディングス	食料品	442,000	404.94	178,985,102	436.00	192,712,000			0.66
日本	株式	大成建設	建設業	382,000	479.40	183,130,800	502.00	191,764,000			0.65

日本	株式	ジーエス・ユアサコーポレーション	電気機器	315,000	576.82	181,698,300	589.00	185,535,000			0.63
日本	株式	フジクラ	非鉄金属	415,000	396.11	164,389,026	447.00	185,505,000			0.63
日本	株式	東海カーボン	ガラス・土石製品	532,000	338.26	179,955,126	337.00	179,284,000			0.61
日本	株式	北越紀州製紙	パルプ・紙	381,000	451.80	172,138,771	457.00	174,117,000			0.59
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	454,000	404.45	183,622,051	382.00	173,428,000			0.59
日本	株式	日立建機	機械	81,800	2,247.82	183,871,801	2,067.00	169,080,600			0.57
日本	株式	日新製鋼ホールディングス	鉄鋼	129,200	1,300.64	168,043,173	1,305.00	168,606,000			0.57
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	143,100	1,174.89	168,127,790	1,178.00	168,571,800			0.57
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	228,400	740.34	169,094,074	723.00	165,133,200			0.56
日本	株式	住友商事	卸売業	127,500	1,309.81	167,001,466	1,275.00	162,562,500			0.55
日本	株式	日本碍子	ガラス・土石製品	84,000	1,530.76	128,584,196	1,644.00	138,096,000			0.47
日本	株式	アルプス電気	電気機器	155,600	817.39	127,185,950	858.00	133,504,800			0.45
日本	株式	大林組	建設業	207,000	622.63	128,884,679	627.00	129,789,000			0.44
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	33,100	3,865.05	127,933,175	3,915.00	129,586,500			0.44
日本	株式	ヤマハ	その他製品	87,900	1,462.19	128,526,907	1,460.00	128,334,000			0.44
日本	株式	ダイキン工業	機械	22,700	5,580.18	126,670,191	5,630.00	127,801,000			0.43
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	15,000	8,583.96	128,759,476	8,510.00	127,650,000			0.43
日本	株式	シチズンホールディングス	精密機器	181,900	704.85	128,213,523	697.00	126,784,300			0.43
日本	株式	マツダ	輸送用機器	288,000	448.65	129,213,193	440.00	126,720,000			0.43
日本	株式	明治ホールディングス	食料品	23,100	5,491.49	126,853,478	5,480.00	126,588,000			0.43
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	17,200	7,459.81	128,308,768	7,300.00	125,560,000			0.43
日本	株式	りそなホールディングス	銀行業	245,800	515.66	126,750,824	510.00	125,358,000			0.43
日本	株式	太平洋セメント	ガラス・土石製品	302,000	426.17	128,705,025	415.00	125,330,000			0.43
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	56,400	2,144.40	120,944,209	2,166.00	122,162,400			0.42

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	25.95
国債証券	44.17
合計	70.13

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	建設業	1.09
		食料品	1.48
		繊維製品	0.66
		パルプ・紙	0.59
		化学	1.08
		医薬品	1.61
		ゴム製品	0.40
		ガラス・土石製品	1.50
		鉄鋼	1.14
		非鉄金属	1.74
		機械	2.35
		電気機器	3.72
		輸送用機器	1.76
		精密機器	0.43
		その他製品	0.75
		電気・ガス業	0.29
		陸運業	0.83
		海運業	0.58
		情報・通信業	0.43
		卸売業	1.84
小売業	0.29		
銀行業	0.43		
証券、商品先物取引業	0.56		
不動産業	0.39		
合計			25.95

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	196,792,669,300	77.96
地方債証券	日本	16,008,549,961	6.34
特殊債券	日本	22,235,356,227	8.81
	アメリカ	208,930,000	0.08
	韓国	201,035,000	0.08
	スウェーデン	100,894,000	0.04
	小計	22,746,215,227	9.01
社債券	日本	14,437,752,920	5.72
	オーストラリア	407,319,000	0.16
	オランダ	406,150,000	0.16
	アメリカ	207,766,000	0.08
	スウェーデン	102,550,000	0.04
	イギリス	100,947,000	0.04
	小計	15,662,484,920	6.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,230,958,049	0.49
合計(純資産総額)		252,440,877,457	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	3,630,000,000	100.67	3,654,364,800	100.74	3,657,043,500	0.4	2016/06/20	1.45
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	3,630,000,000	100.35	3,642,950,800	100.52	3,649,130,100	0.3	2018/06/20	1.45
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,060,000,000	99.70	3,050,869,800	100.18	3,065,508,000	0.2	2017/06/20	1.21
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,890,000,000	101.48	2,932,865,700	101.95	2,946,615,100	0.8	2023/09/20	1.17
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	2,820,000,000	100.57	2,836,186,800	100.46	2,833,113,000	0.5	2014/12/20	1.12
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,640,000,000	97.67	2,578,603,100	100.35	2,649,398,400	0.6	2023/03/20	1.05
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	2,570,000,000	100.65	2,586,859,200	100.56	2,584,571,900	0.5	2015/03/20	1.02
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,490,000,000	100.61	2,505,224,000	102.05	2,541,069,900	0.8	2023/06/20	1.01
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	2,390,000,000	105.26	2,515,717,000	105.24	2,515,451,100	1.7	2017/03/20	1.00

日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	2,260,000,000	98.94	2,236,044,000	102.26	2,311,076,000	0.8	2022/12/20	0.92
日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	2,110,000,000	106.07	2,238,240,500	106.84	2,254,366,200	1.4	2019/09/20	0.89
日本	国債証券	第296回利付国債 (10年)	2,100,000,000	105.41	2,213,684,000	106.35	2,233,371,000	1.5	2018/09/20	0.88
日本	国債証券	第288回利付国債 (10年)	2,090,000,000	105.68	2,208,774,700	105.94	2,214,334,100	1.7	2017/09/20	0.88
日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	2,080,000,000	105.14	2,187,044,700	106.36	2,212,371,200	1.3	2019/12/20	0.88
日本	国債証券	第333回利付国債 (2年)	2,160,000,000	100.01	2,160,280,800	100.00	2,160,194,400	0.1	2015/10/15	0.86
日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	2,040,000,000	102.45	2,090,154,100	104.57	2,133,289,200	1.0	2020/09/20	0.85
日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	2,070,000,000	99.19	2,053,233,000	102.41	2,120,052,600	0.8	2022/09/20	0.84
日本	国債証券	第270回利付国債 (10年)	2,000,000,000	102.26	2,045,245,400	101.95	2,039,180,000	1.3	2015/06/20	0.81
日本	国債証券	第319回利付国債 (10年)	1,860,000,000	102.86	1,913,227,200	105.13	1,955,511,000	1.1	2021/12/20	0.77
日本	国債証券	第102回利付国債 (5年)	1,880,000,000	100.10	1,881,931,000	100.52	1,889,926,400	0.3	2016/12/20	0.75
日本	国債証券	第106回利付国債 (5年)	1,880,000,000	99.27	1,866,276,000	100.15	1,882,895,200	0.2	2017/09/20	0.75
日本	国債証券	第103回利付国債 (5年)	1,840,000,000	100.24	1,844,493,000	100.53	1,849,862,400	0.3	2017/03/20	0.73
日本	国債証券	第99回利付国債(5 年)	1,800,000,000	100.49	1,808,820,000	100.78	1,814,166,000	0.4	2016/09/20	0.72
日本	国債証券	第312回利付国債 (10年)	1,710,000,000	104.03	1,779,024,500	105.90	1,811,009,700	1.2	2020/12/20	0.72
日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	1,660,000,000	104.48	1,734,368,000	105.63	1,753,491,200	1.3	2018/12/20	0.69
日本	国債証券	第320回利付国債 (10年)	1,680,000,000	101.03	1,697,388,000	104.35	1,753,096,800	1.0	2021/12/20	0.69
日本	国債証券	第273回利付国債 (10年)	1,590,000,000	103.09	1,639,146,900	102.62	1,631,785,200	1.5	2015/09/20	0.65
日本	国債証券	第89回利付国債(5 年)	1,610,000,000	100.53	1,618,565,200	100.51	1,618,211,000	0.4	2015/06/20	0.64
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	1,530,000,000	104.96	1,606,025,700	105.46	1,613,645,100	1.5	2017/12/20	0.64
日本	国債証券	第313回利付国債 (10年)	1,510,000,000	104.67	1,580,627,800	106.59	1,609,584,500	1.3	2021/03/20	0.64

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.96
地方債証券	6.34

特殊債券	9.01
社債券	6.20
合計	99.51

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	3	435,120,945	435,210,000	435,210,000	0.17

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

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	87,569,006,578	53.17
	イギリス	15,348,584,572	9.32
	カナダ	7,306,638,234	4.44
	スイス	7,286,074,362	4.42
	フランス	6,669,848,601	4.05
	ドイツ	6,560,668,490	3.98
	オーストラリア	5,517,353,381	3.35
	オランダ	2,616,249,881	1.59
	スペイン	2,439,545,928	1.48
	スウェーデン	2,316,990,306	1.41
	香港	1,746,884,919	1.06
	イタリア	1,566,756,276	0.95
	アイルランド	1,306,375,748	0.79
	シンガポール	1,068,050,906	0.65
	ジャージー	880,750,717	0.53
	ベルギー	861,627,392	0.52
	デンマーク	845,461,116	0.51
	アンティル	704,641,915	0.43
	フィンランド	671,700,894	0.41
バミューダ	652,019,493	0.40	
ノルウェー	489,115,419	0.30	

	イスラエル	321,662,683	0.20
	ルクセンブルク	263,832,247	0.16
	オーストリア	221,036,536	0.13
	ケイマン	209,167,466	0.13
	ポルトガル	130,006,440	0.08
	ニュージーランド	92,691,850	0.06
	英ヴァージン諸島	86,289,769	0.05
	パナマ	74,986,196	0.05
	ガーンジー	46,319,451	0.03
	マン島	44,025,819	0.03
	リベリア	37,460,963	0.02
	モーリシャス	20,480,565	0.01
	ギリシャ	16,434,720	0.01
	小計	155,988,739,833	94.71
投資信託受益証券	オーストラリア	58,289,641	0.04
	シンガポール	24,585,633	0.01
	香港	11,896,560	0.01
	小計	94,771,834	0.06
投資証券	アメリカ	2,135,221,260	1.30
	オーストラリア	412,782,595	0.25
	フランス	228,388,876	0.14
	イギリス	207,984,496	0.13
	香港	67,327,412	0.04
	シンガポール	57,893,067	0.04
	カナダ	38,014,745	0.02
	オランダ	15,037,658	0.01
	小計	3,162,650,109	1.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,455,691,329	3.31
合計(純資産総額)		164,701,853,105	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	53,922	43,486.25	2,344,865,809	51,711.83	2,788,405,804	1.69
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	255,079	9,100.35	2,321,309,146	8,748.67	2,231,602,785	1.35
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	455,633	3,448.83	1,571,403,083	3,501.04	1,595,191,818	0.97

アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,571	86,813.90	1,351,779,356	101,506.67	1,580,560,423	0.96
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	593,066	2,324.83	1,378,781,187	2,597.70	1,540,612,707	0.94
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	161,102	8,630.46	1,390,384,544	9,140.74	1,472,591,962	0.89
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	184,748	7,171.59	1,324,937,833	7,171.59	1,324,937,833	0.80
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	111,174	12,454.61	1,384,629,846	11,850.75	1,317,495,614	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	157,176	7,965.51	1,251,988,351	8,030.53	1,262,207,400	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	288,544	3,991.62	1,151,759,501	4,245.78	1,225,094,632	0.74
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,081,581	1,173.71	1,269,470,114	1,079.72	1,167,809,990	0.71
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	376,450	2,852.84	1,073,955,231	3,046.91	1,147,010,888	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	216,737	5,378.64	1,165,751,598	5,181.62	1,123,050,074	0.68
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	311,369	3,564.09	1,109,747,699	3,571.97	1,112,201,536	0.68
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,402	27,657.17	1,117,405,143	27,427.24	1,108,115,552	0.67
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	60,476	20,468.40	1,237,847,430	17,746.57	1,073,241,960	0.65
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	132,117	7,817.58	1,032,836,009	7,768.31	1,026,326,538	0.62
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	2,788,571	311.20	867,805,804	357.17	995,994,377	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	229,796	4,191.60	963,213,028	3,902.96	896,886,020	0.54
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	618,014	1,315.10	812,755,464	1,395.88	862,677,523	0.52
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	174,440	5,101.83	889,963,731	4,914.66	857,313,970	0.52
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,086,832	761.41	827,530,622	761.41	827,530,622	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	93,753	9,196.89	862,236,365	8,800.88	825,109,221	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	165,534	5,006.27	828,709,255	4,977.71	823,980,296	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	173,089	4,691.04	811,968,495	4,456.59	771,387,121	0.47

イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	217,354	3,560.64	773,920,172	3,450.06	749,885,384	0.46
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	122,032	5,420.26	661,446,254	6,118.26	746,623,760	0.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	20,893	26,330.73	550,128,106	35,569.99	743,163,817	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	88,633	8,120.17	719,715,851	8,345.76	739,710,384	0.45
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	281,883	2,815.02	793,507,804	2,596.23	731,835,059	0.44

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	94.71
投資信託受益証券	0.06
投資証券	1.92
合計	96.69

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

c . 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	10.12
		素材	5.55
		資本財	7.44
		商業・専門サービス	0.90
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	1.63
		耐久消費財・アパレル	1.62
		消費者サービス	1.70
		メディア	2.85
		小売	3.11
		食品・生活必需品小売り	2.23
		食品・飲料・タバコ	6.15
		家庭用品・パーソナル用品	1.83
		ヘルスケア機器・サービス	2.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.48
		銀行	7.78
		各種金融	5.69
		保険	4.20
		不動産	0.68
		ソフトウェア・サービス	6.16
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.82		

	電気通信サービス	3.57
	公益事業	3.19
	半導体・半導体製造装置	1.43
合計		94.71

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	59	25,524,565.50	25,968,850	2,558,191,413	1.55
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	16	2,426,296	2,478,400	233,118,304	0.14
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	26	2,116,762	2,137,980	234,087,430	0.14
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	113	3,363,818.50	3,427,290	463,609,518	0.28
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	19	2,536,933	2,574,025	240,954,480	0.15
	FTSE 100	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	48	3,192,690	3,240,720	511,936,538	0.31

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

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	89,244,862,864	38.90
	フランス	23,092,766,431	10.07
	イタリア	22,450,492,354	9.79
	ドイツ	20,281,999,045	8.84
	イギリス	17,209,051,558	7.50
	スペイン	11,972,198,388	5.22
	オランダ	6,333,947,267	2.76
	ベルギー	6,207,232,753	2.71
	カナダ	5,619,039,041	2.45
	オーストリア	4,056,097,150	1.77
	オーストラリア	3,518,083,122	1.53
	メキシコ	2,336,146,466	1.02

デンマーク	1,951,052,771	0.85
アイルランド	1,871,990,534	0.82
ポーランド	1,827,553,734	0.80
フィンランド	1,483,180,319	0.65
スウェーデン	1,253,101,194	0.55
マレーシア	1,162,713,912	0.51
南アフリカ	1,155,522,239	0.50
シンガポール	878,300,839	0.38
スイス	855,399,108	0.37
ノルウェー	757,958,974	0.33
小計	225,518,690,063	98.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	3,909,694,988	1.70
合計(純資産総額)	229,428,385,051	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/30/15	39,000,000	9,855.13	3,843,503,593	9,871.20	3,849,768,871	0.375	2015/06/30	1.68
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,091.36	2,805,399,303	10,063.60	2,797,682,072	1.375	2015/11/30	1.22
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	9,859.66	1,991,651,817	9,871.77	1,994,099,458	0.375	2015/06/15	0.87
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	10,213.29	1,960,952,365	10,134.02	1,945,732,580	2.375	2015/02/28	0.85
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	9,827.14	1,906,465,578	9,811.74	1,903,479,494	0.750	2017/06/30	0.83
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	18,700,000	9,831.33	1,838,458,735	9,840.22	1,840,122,162	0.250	2015/10/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	9,786.54	1,761,578,136	9,807.70	1,765,387,707	0.250	2016/04/15	0.77
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,155.18	1,523,278,221	10,104.39	1,515,659,088	1.750	2015/07/31	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	14,000,000	9,909.12	1,387,276,926	9,896.02	1,385,443,097	0.875	2017/02/28	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	9,836.37	1,377,092,845	9,848.88	1,378,843,705	0.250	2015/07/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	10,911.71	1,396,699,405	10,724.89	1,372,786,107	3.125	2019/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,171.73	1,332,497,240	10,114.59	1,325,011,445	1.875	2015/06/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,700.26	1,337,532,996	10,550.95	1,318,869,968	4.250	2015/08/15	0.57

アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	9,861.83	1,311,624,201	9,881.59	1,314,251,733	0.625	2016/07/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	13,100,000	9,748.64	1,277,072,101	9,705.92	1,271,476,653	0.750	2018/02/28	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	10,130.94	1,276,499,123	10,060.33	1,267,602,052	2.125	2014/11/30	0.55
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000	14,393.81	1,266,655,294	14,225.26	1,251,823,209	3.250	2015/07/04	0.55
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	9,712.32	1,214,041,200	9,469.46	1,183,683,267	2.000	2023/02/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	9,866.77	1,134,679,351	9,873.51	1,135,453,777	0.375	2015/04/15	0.49
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	14,389.81	1,136,795,755	14,174.33	1,119,772,432	3.500	2015/04/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/30/17	11,500,000	9,705.85	1,116,173,095	9,696.50	1,115,097,609	0.625	2017/11/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,292.28	1,106,644,019	11,117.58	1,089,523,294	4.500	2017/05/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,261.39	1,056,923,605	10,210.40	1,051,671,985	2.000	2016/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	9,675.05	1,064,255,868	9,553.93	1,050,932,385	1.250	2020/02/29	0.46
スペイン	国債証券	SPGB 4.4% 01/31/15	7,400,000	14,155.19	1,047,484,347	14,102.43	1,043,580,454	4.400	2015/01/31	0.45
イギリス	国債証券	UKT 1% 09/07/17	6,550,000	15,875.95	1,039,874,884	15,743.21	1,031,180,334	1.000	2017/09/07	0.45
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	6,300,000	16,461.73	1,037,089,523	16,339.53	1,029,390,631	6.500	2027/11/01	0.45
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	10,688.91	1,015,446,655	10,580.78	1,005,174,296	3.000	2017/02/28	0.44
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000	14,460.94	997,805,492	14,531.92	1,002,702,537	4.500	2018/08/01	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	9,800,000	10,282.75	1,007,709,588	10,202.32	999,828,011	1.875	2017/08/31	0.44

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.30
合計	98.30

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	9	1,095,082.92	1,095,117.21	107,879,996	0.05
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	5	638,301.25	637,578.15	62,807,823	0.03
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	3	406,512	404,906.25	39,887,314	0.02
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	6	662,634	662,640	89,635,312	0.04
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	6	748,404	750,300	101,493,081	0.04
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	8	1,127,072	1,134,800	153,504,396	0.07

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

新興国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	韓国	3,583,079,627	15.72
	ブラジル	2,567,234,674	11.27
	台湾	2,494,055,769	10.94
	中国	2,233,982,350	9.80
	南アフリカ	1,654,782,685	7.26
	インド	1,366,931,194	6.00
	ロシア	1,360,121,627	5.97
	メキシコ	1,127,031,489	4.95
	香港	985,985,278	4.33
	ケイマン	865,399,867	3.80
	マレーシア	832,069,033	3.65
	インドネシア	566,537,481	2.49
	タイ	547,352,618	2.40
	トルコ	394,272,073	1.73
	ポーランド	390,497,391	1.71
	チリ	379,882,993	1.67
	フィリピン	206,730,804	0.91
	コロンビア	204,115,493	0.90
	バミューダ	174,712,672	0.77
チェコ	62,182,729	0.27	
エジプト	56,286,769	0.25	

	ハンガリー	43,733,832	0.19
	ペルー	23,882,527	0.10
	アメリカ	17,872,590	0.08
	モロッコ	14,253,324	0.06
	ルクセンブルク	4,296,058	0.02
	小計	22,157,282,947	97.24
投資信託受益証券	ブラジル	50,252,229	0.22
	南アフリカ	17,089,241	0.07
	メキシコ	11,872,733	0.05
	小計	79,214,203	0.35
投資証券	メキシコ	22,013,808	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		528,794,011	2.32
合計(純資産総額)		22,787,304,969	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	6,387	126,072.72	805,226,510	139,800.00	892,902,600	3.92
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,418,389	312.42	443,143,118	368.49	522,676,346	2.29
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	349,500	1,092.18	381,716,996	1,037.13	362,479,032	1.59
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	346,312	876.38	303,502,174	925.00	320,341,682	1.41
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	58,600	3,586.54	210,171,255	5,447.50	319,223,851	1.40
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	4,135,620	73.45	303,765,367	76.64	316,959,293	1.39
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,213,515	65.15	274,526,383	69.52	292,939,152	1.29
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,114,340	117.70	248,877,231	106.10	224,348,811	0.98
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	142,490	1,243.23	177,148,453	1,550.67	220,955,025	0.97
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	8,999	20,363.54	183,251,573	24,325.19	218,902,474	0.96
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	240,240	908.22	218,192,804	896.95	215,483,748	0.95
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	165,750	1,099.99	182,324,685	1,267.82	210,141,778	0.92
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	22,497	5,830.52	131,169,345	9,321.22	209,699,684	0.92
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,020,000	202.06	206,110,983	200.56	204,575,076	0.90
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,284,200	40.54	173,698,857	46.01	197,116,898	0.87

ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	30,234	5,913.07	178,775,787	6,437.62	194,635,260	0.85
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	97,091	1,698.82	164,941,018	1,974.07	191,665,401	0.84
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	123,200	1,326.20	163,388,506	1,454.90	179,244,369	0.79
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	110,515	1,615.56	178,543,653	1,464.34	161,832,330	0.71
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	639,352	274.47	175,486,419	251.25	160,637,190	0.70
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	31,431	3,821.36	120,109,445	5,103.74	160,415,677	0.70
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	39,500	3,663.91	144,724,551	3,785.18	149,514,704	0.66
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	171,300	922.07	157,951,726	852.44	146,023,246	0.64
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,234,000	128.04	158,003,309	114.39	141,157,260	0.62
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	25,908	3,973.68	102,950,285	5,384.71	139,507,273	0.61
コロンビア	株式	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	エネルギー	24,938	4,587.52	114,403,759	4,657.55	116,150,051	0.51
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	84,191	1,291.62	108,742,884	1,376.10	115,855,992	0.51
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	440,000	289.01	127,166,318	263.09	115,762,680	0.51
ブラジル	株式	VALE SA	素材	72,500	1,658.29	120,226,322	1,574.49	114,151,192	0.50
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,437,400	79.77	114,665,180	79.18	113,818,075	0.50

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	97.24
投資信託受益証券	0.35
投資証券	0.10
合計	97.68

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

c . 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	11.58
		素材	9.35
		資本財	4.38
		商業・専門サービス	0.09
		運輸	1.67
		自動車・自動車部品	3.76

	耐久消費財・アパレル	0.94
	消費者サービス	0.63
	メディア	1.60
	小売	1.79
	食品・生活必需品小売り	2.20
	食品・飲料・タバコ	5.24
	家庭用品・パーソナル用品	1.07
	ヘルスケア機器・サービス	0.60
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.97
	銀行	18.47
	各種金融	2.50
	保険	3.16
	不動産	1.93
	ソフトウェア・サービス	3.52
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.06
	電気通信サービス	7.23
	公益事業	3.13
	半導体・半導体製造装置	8.35
合計		97.24

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	MSCI EMERG M	ニューヨーク証券取引 所	買建	アメリカドル	101	5,129,212	5,228,265	515,036,385	2.26

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

新興国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	ロシア	2,594,443,721	10.02
	ポーランド	2,594,196,159	10.02
	マレーシア	2,581,989,913	9.97
	南アフリカ	2,555,419,464	9.87
	トルコ	2,548,516,709	9.84
	ブラジル	2,519,477,839	9.73
	メキシコ	2,517,822,669	9.72

インドネシア	2,040,470,674	7.88
タイ	1,883,222,826	7.27
ハンガリー	1,478,650,583	5.71
コロンビア	900,087,393	3.48
ナイジェリア	494,848,834	1.91
ペルー	436,691,479	1.69
フィリピン	142,056,026	0.55
チリ	39,613,162	0.15
小計	25,327,507,451	97.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	574,281,043	2.22
合計(純資産総額)	25,901,788,494	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
ロシア	国債証券	RFLB 7% 06/03/15	248,100,000	313.33	777,395,834	312.32	774,876,637	7.000	2015/06/03	2.99
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	230,000,000	330.65	760,513,600	320.91	738,106,754	7.850	2018/03/10	2.85
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	202,600,000	320.41	649,162,052	320.17	648,681,276	7.600	2021/04/14	2.50
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	8,750,000,000	6.34	554,941,173	5.95	520,967,164	12.000	2015/10/22	2.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	41,000,000	1,228.12	503,530,841	1,199.78	491,911,571	10.500	2026/12/21	1.90
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	14,000,000	3,483.31	487,663,666	3,444.28	482,199,853	0.000	2016/01/01	1.86
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	5,527.79	525,140,443	4,803.14	456,298,702	12.500	2016/01/05	1.76
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	132,000,000	330.38	436,107,980	327.86	432,779,054	8.150	2027/02/03	1.67
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	9,500,000	4,246.38	403,406,747	4,488.07	426,367,429	7.100	2023/03/08	1.65
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000	4,540.53	431,350,501	4,351.72	413,414,216	10.000	2017/01/01	1.60
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000	3,806.66	390,183,221	3,760.71	385,473,137	0.000	2015/04/01	1.49
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	10,100,000	3,373.02	340,675,963	3,362.34	339,596,470	5.500	2015/04/25	1.31
トルコ	国債証券	TURKGB 10.5% 01/15/20	6,200,000	5,627.04	348,876,928	5,438.22	337,169,982	10.500	2020/01/15	1.30
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000	50.70	342,252,284	47.89	323,311,810	7.000	2019/10/23	1.25

タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	98,000,000	318.84	312,472,658	318.35	311,989,624	3.250	2017/06/16	1.20
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	9,600,000	3,134.02	300,866,238	3,120.51	299,569,607	3.314	2017/10/31	1.16
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,355.21	296,936,113	3,382.42	299,344,562	4.750	2016/10/25	1.16
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	28,700,000	1,024.45	294,018,624	1,002.53	287,726,132	7.250	2020/01/15	1.11
マレーシア	国債証券	MGS 3.172% 07/15/16	9,050,000	3,125.91	282,895,382	3,130.59	283,318,543	3.172	2016/07/15	1.09
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	5,500,000	5,156.10	283,585,802	5,078.60	279,323,208	9.000	2017/03/08	1.08
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000	3,676.10	277,546,116	3,638.08	274,675,666	5.750	2022/09/23	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	26,000,000	1,080.33	280,886,629	1,051.98	273,515,132	8.250	2017/09/15	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	24,000,000	1,179.87	283,170,970	1,125.66	270,158,899	13.500	2015/09/15	1.04
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 06/15/32	27,700,000,000	1.07	298,745,054	0.92	257,161,606	8.250	2032/06/15	0.99
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	4,170,000,000	6.44	268,718,879	6.00	250,263,784	7.750	2021/04/14	0.97
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	23,600,000	1,065.35	251,422,735	1,046.44	246,961,237	8.000	2018/12/21	0.95
トルコ	国債証券	TURKGB 6.5% 01/07/15	5,000,000	4,786.08	239,304,390	4,876.74	243,837,230	6.500	2015/01/07	0.94
マレーシア	国債証券	MGS 3.741% 02/27/15	7,700,000	3,173.30	244,344,378	3,155.33	242,960,696	3.741	2015/02/27	0.94
ハンガリー	国債証券	HGB 8% 02/12/15	500,000,000	48.19	240,962,643	48.55	242,781,581	8.000	2015/02/12	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 3.75% 04/25/18	7,300,000	3,292.71	240,368,375	3,283.59	239,702,317	3.750	2018/04/25	0.93

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.78
合計	97.78

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	18,375,599,890	98.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		237,365,074	1.28
合計(純資産総額)		18,612,964,964	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,790	1,017,744.18	1,821,762,082	1,217,000.00	2,178,430,000	11.70
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,537	963,823.88	1,481,397,303	1,125,000.00	1,729,125,000	9.29
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	5,972	175,611.06	1,048,749,250	199,300.00	1,190,219,600	6.39
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,158	119,523.79	736,027,498	150,100.00	924,315,800	4.97
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3,208	192,252.65	616,746,501	222,200.00	712,817,600	3.83
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	722	945,228.24	682,454,789	980,000.00	707,560,000	3.80
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,134	273,487.89	583,623,157	327,000.00	697,818,000	3.75
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	642	821,114.09	527,155,246	983,000.00	631,086,000	3.39
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	678	805,427.65	546,079,946	874,000.00	592,572,000	3.18
日本	投資証券	G L P 投資法人	5,427	88,698.52	481,366,868	102,100.00	554,096,700	2.98
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,354	101,132.99	440,333,072	122,700.00	534,235,800	2.87
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	717	509,829.27	365,547,591	689,000.00	494,013,000	2.65
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	964	494,324.77	476,529,078	485,500.00	468,022,000	2.51
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	531	654,226.03	347,394,021	855,000.00	454,005,000	2.44
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,024	335,177.36	343,221,616	436,000.00	446,464,000	2.40

日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,308	98,866.62	425,917,398	100,600.00	433,384,800	2.33
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	424	845,720.15	358,585,343	1,020,000.00	432,480,000	2.32
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	597	633,729.53	378,336,529	705,000.00	420,885,000	2.26
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	962	360,807.03	347,096,362	407,000.00	391,534,000	2.10
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	405	783,237.82	317,211,319	910,000.00	368,550,000	1.98
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	582	521,976.83	303,790,515	608,000.00	353,856,000	1.90
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	741	342,274.89	253,625,693	440,500.00	326,410,500	1.75
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,781	32,329.32	219,225,118	46,250.00	313,621,250	1.68
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	506	498,051.38	252,014,000	606,000.00	306,636,000	1.65
日本	投資証券	福岡リート投資法人	357	694,745.16	248,024,024	811,000.00	289,527,000	1.56
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	3,443	59,433.34	204,628,989	71,800.00	247,207,400	1.33
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	317	647,098.32	205,130,167	752,000.00	238,384,000	1.28
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	416	500,845.96	208,351,919	565,000.00	235,040,000	1.26
日本	投資証券	積水ハウス・S I 投資法人	413	432,848.85	178,766,579	495,500.00	204,641,500	1.10
日本	投資証券	プレミアム投資法人	509	354,052.81	180,212,880	402,000.00	204,618,000	1.10

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.72
合計	98.72

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
-------	-------	-----	---------	----	----	----------------	----------------	-------------	-------------

不動産投信指数先物取引	東証REIT指数先物	東京証券取引所	買建	円	162	228,606,700	237,978,000	237,978,000	1.28
-------------	------------	---------	----	---	-----	-------------	-------------	-------------	------

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	15,938,437,383	66.74
	オーストラリア	2,449,200,287	10.26
	イギリス	1,510,084,481	6.32
	フランス	1,289,142,282	5.40
	シンガポール	947,094,795	3.97
	カナダ	652,169,729	2.73
	香港	439,929,449	1.84
	オランダ	265,907,439	1.11
	ベルギー	138,848,189	0.58
	ニュージーランド	83,520,297	0.35
	ドイツ	48,327,211	0.20
	イタリア	21,193,234	0.09
	イスラエル	6,206,990	0.03
	ギリシャ	4,950,882	0.02
小計	23,795,012,648	99.64	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		86,704,916	0.36
合計(純資産総額)		23,881,717,564	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	94,270	15,226.58	1,435,410,151	15,353.76	1,447,399,765	6.06
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	29,590	23,657.36	700,021,408	26,039.47	770,508,065	3.23
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	43,970	14,746.79	648,416,488	16,513.23	726,086,780	3.04
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	606,700	1,000.83	607,204,360	1,012.86	614,502,283	2.57
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	151,890	3,512.37	533,494,814	3,944.34	599,105,863	2.51

アメリカ	投資証券	VENTAS INC	89,340	6,429.59	574,420,112	6,483.92	579,274,145	2.43
アメリカ	投資証券	HCP INC	138,650	4,393.22	609,120,324	4,167.95	577,887,390	2.42
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	87,380	6,105.71	533,517,740	6,365.71	556,236,281	2.33
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	102,120	5,538.14	565,554,981	5,235.80	534,680,559	2.24
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	45,980	10,271.64	472,290,344	10,349.46	475,868,198	1.99
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	53,050	7,859.33	416,937,941	8,786.10	466,102,971	1.95
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	37,100	13,008.80	482,626,687	12,478.26	462,943,509	1.94
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	228,960	1,514.96	346,866,765	1,824.40	417,715,814	1.75
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	238,300	1,308.19	311,743,556	1,571.80	374,560,297	1.57
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	166,730	1,920.58	320,218,886	2,128.80	354,935,007	1.49
香港	投資証券	LINK REIT	702,000	503.41	353,397,942	495.05	347,528,259	1.46
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	300,800	855.95	257,472,623	993.63	298,884,295	1.25
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	28,190	7,759.61	218,743,631	9,382.09	264,481,184	1.11
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	123,620	1,951.82	241,284,842	2,132.74	263,649,504	1.10
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	905,400	287.21	260,048,590	288.31	261,043,841	1.09
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	697,500	328.28	228,975,935	372.56	259,866,040	1.09
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	60,160	4,084.12	245,700,764	4,198.49	252,581,531	1.06
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	42,440	5,708.74	242,279,225	5,763.82	244,616,525	1.02
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	454,130	425.03	193,020,288	471.79	214,255,990	0.90
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,870	10,269.38	204,052,774	10,348.47	205,624,208	0.86
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	39,450	6,012.11	237,178,066	4,843.73	191,085,412	0.80
アメリカ	投資証券	UDR INC	75,110	2,350.32	176,533,093	2,457.82	184,607,198	0.77
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	215,600	759.09	163,661,046	856.19	184,596,159	0.77
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	11,590	14,447.73	167,449,288	15,822.67	183,384,817	0.77

アメリカ	投資証券	COLE REAL ESTATE INVESTMENT	128,900	1,200.62	154,760,069	1,392.93	179,548,857	0.75
------	------	-----------------------------	---------	----------	-------------	----------	-------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.64
合計	99.64

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	イギリス	7,149,741,526	81.07
	ジャージー	1,292,609,210	14.66
	アメリカ	269,719,887	3.06
	小計	8,712,070,623	98.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		106,921,754	1.21
合計(純資産総額)		8,818,992,377	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率(%)	償還期限	投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額			
イギリス	社債券	CS USD COM 005 08/11/14	15,000,000	10,071.46	1,510,719,807	9,869.71	1,480,457,535	0.0	2014/08/11	16.79
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	99,860,000	1,343.57	1,341,696,359	1,294.42	1,292,609,210	0.0		14.66
イギリス	社債券	UBS USD COM 004 08/11/14	13,000,000	9,969.59	1,296,046,815	9,883.50	1,284,856,079	0.0	2014/08/11	14.57
イギリス	社債券	BAR USD COM 024 07/25/14	10,000,000	9,876.07	987,607,079	9,622.35	962,235,829	0.0	2014/07/25	10.91

イギリス	社債券	UBS USD COM 003 05/16/14	9,700,000	9,530.13	924,422,765	9,313.13	903,374,133	0.0	2014/05/16	10.24
イギリス	社債券	CS USD COM 006 10/24/14	6,000,000	9,905.18	594,310,830	9,741.65	584,499,234	0.0	2014/10/24	6.63
イギリス	社債券	BAR USD COM 025 08/29/14	6,000,000	9,806.99	588,419,932	9,549.16	572,949,921	0.0	2014/08/29	6.50
イギリス	社債券	BAR USD COM 022 04/25/14	5,000,000	9,822.35	491,117,861	9,441.09	472,054,994	0.0	2014/04/25	5.35
イギリス	社債券	BAR USD COM 023 06/27/14	5,000,000	9,763.52	488,176,156	9,363.37	468,168,775	0.0	2014/06/27	5.31
イギリス	社債券	BAR USD COM 021 01/31/14	3,000,000	9,503.75	285,112,567	9,149.11	274,473,487	0.0	2014/01/31	3.11
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	7,390,000	3,822.18	282,459,693	3,649.79	269,719,887	0.0	2036/06/12	3.06
イギリス	社債券	UBS USD COM 005 11/05/14	1,500,000	9,846.07	147,691,117	9,778.10	146,671,539	0.0	2014/11/05	1.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3)償還期限は、償還期限の定めがない場合「 」と記載しております。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	98.79
合計	98.79

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

FRM シグマ リンク マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ケイマン	4,147,711,100	95.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		184,520,147	4.26
合計(純資産総額)		4,332,231,247	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
ケイマン	社債券	QUART X 0% 03/3 1/22	4,810,000,000	89.30	4,295,767,100	86.23	4,147,711,100	0.0	2022/03/31	95.74

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	95.74
合計	95.74

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

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。


投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報)交付目論見書に記載するファンドの運用実績

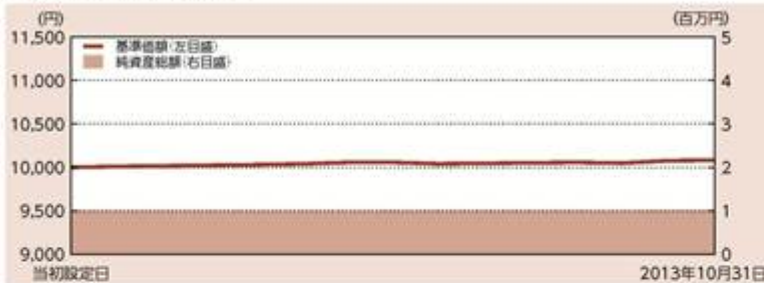


運用実績

当初設定日：2013年10月17日
作成基準日：2013年10月31日



基準価額・純資産の推移



基準価額	10,082円
純資産総額	1百万円

※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

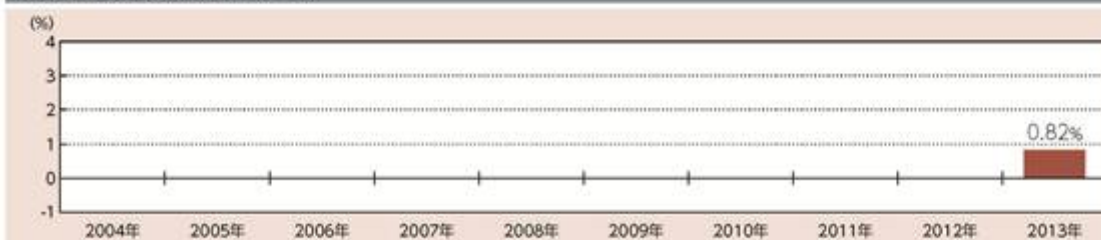
決算期	—	—	—	—	—
分配金	—	—	—	—	—

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	11.0%
外国債券インデックス マザーファンド	9.1%
新興国債券インデックス マザーファンド	9.1%
FRM シグマリンク マザーファンド	7.2%
外国株式インデックス マザーファンド	7.2%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ¹ A ² R ³ FY	6.9%
TCAファンド(適格機関投資家専用)	6.9%
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)	6.8%
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)	6.8%
国内債券インデックス マザーファンド	6.1%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1 申込（販売）手続等

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第2 管理及び運営」「1 申込（販売）手続等」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

(1)申込手続

<訂正前>

（前略）

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。）

（後略）

<訂正後>

（前略）

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

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

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。）

（後略）

2 換金（解約）手続等

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第2 管理及び運営」「2 換金（解約）手続等」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

(4)解約価額

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額とします（信託財産留保額の控除はありません。）。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先にお問い合わせください。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差し引いた金額となります。

（後略）

<訂正後>

（前略）

(4) 解約価額

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額とします（信託財産留保額の控除はありません。）。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先にお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差し引いた金額となります。

（後略）

3 資産管理等の概要

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第2 管理及び運営」「3 資産管理等の概要」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 資産の評価

（中略）

基準価額の算出頻度及び照会方法

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。

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、上記「1申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

（後略）

<訂正後>

(1) 資産の評価

（中略）

基準価額の算出頻度及び照会方法

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。

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、上記「1申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（後略）

4 受益者の権利等

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第2 管理及び運営」「4 受益者の権利等」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1)収益分配金に対する請求権

（中略）

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（後略）

<訂正後>

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1)収益分配金に対する請求権

（中略）

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（後略）

第3【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

（1）当ファンドは、平成25年10月17日から運用を開始する予定であり、該当事項はありません。

当ファンドの会計監査は、有限責任監査法人トーマツが行います。

（後略）

<訂正後>

（1）当ファンドは、平成25年10月17日から運用を開始していますが、基準日（平成25年10月31日）現在、該当事項はありません。

当ファンドの会計監査は、有限責任監査法人トーマツが行います。

（後略）

2 ファンドの現況

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「2 ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

純資産額計算書(平成25年10月31日現在)

資産総額	1,008,728 円
負債総額	551 円
純資産総額(-)	1,008,177 円
発行済口数	1,000,000 口
1口当たり純資産額(/)	1.0082 円
1万口当たり純資産額	10,082 円

(参考情報)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

資産総額	30,148,736,352 円
負債総額	730,119,036 円
純資産総額(-)	29,418,617,316 円
発行済口数	21,234,957,798 口
1口当たり純資産額(/)	1.3854 円
1万口当たり純資産額	13,854 円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	255,384,828,257 円
負債総額	2,943,950,800 円
純資産総額(-)	252,440,877,457 円
発行済口数	197,107,423,245 口
1口当たり純資産額(/)	1.2807 円
1万口当たり純資産額	12,807 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	165,188,776,578 円
負債総額	486,923,473 円
純資産総額(-)	164,701,853,105 円
発行済口数	108,914,271,807 口
1口当たり純資産額(/)	1.5122 円
1万口当たり純資産額	15,122 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	230,208,615,836 円
負債総額	780,230,785 円
純資産総額(-)	229,428,385,051 円
発行済口数	97,597,460,298 口
1口当たり純資産額(/)	2.3508 円
1万口当たり純資産額	23,508 円

新興国株式インデックス マザーファンド

資産総額	22,803,939,868 円
負債総額	16,634,899 円
純資産総額(-)	22,787,304,969 円
発行済口数	10,349,233,920 口
1口当たり純資産額(/)	2.2018 円
1万口当たり純資産額	22,018 円

新興国債券インデックス マザーファンド

資産総額	26,321,487,076 円
負債総額	419,698,582 円
純資産総額(-)	25,901,788,494 円
発行済口数	15,896,875,559 口

1口当たり純資産額(/)	1.6294 円
1万口当たり純資産額	16,294 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	18,741,813,797 円
負債総額	128,848,833 円
純資産総額(-)	18,612,964,964 円
発行済口数	16,052,433,890 口
1口当たり純資産額(/)	1.1595 円
1万口当たり純資産額	11,595 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	23,947,335,062 円
負債総額	65,617,498 円
純資産総額(-)	23,881,717,564 円
発行済口数	20,777,801,353 口
1口当たり純資産額(/)	1.1494 円
1万口当たり純資産額	11,494 円

グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド

資産総額	9,266,129,385 円
負債総額	447,137,008 円
純資産総額(-)	8,818,992,377 円
発行済口数	20,212,902,743 口
1口当たり純資産額(/)	0.4363 円
1万口当たり純資産額	4,363 円

FRM シグマ リンク マザーファンド

資産総額	4,332,261,247 円
負債総額	30,000 円
純資産総額(-)	4,332,231,247 円
発行済口数	4,978,020,631 口
1口当たり純資産額(/)	0.8703 円
1万口当たり純資産額	8,703 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「1 委託会社等の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 資本金の額（平成25年7月31日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成25年10月1日現在（予定）のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1) 資本金の額（平成25年10月31日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成25年12月16日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部 _____ は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

（前略）

平成25年7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>320</u>	<u>4,361,531</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>1</u>	<u>64</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>321</u>	<u>4,361,595</u>

< 訂正後 >

（前略）

平成25年10月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>337</u>	<u>4,549,168</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>0</u>	<u>0</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>337</u>	<u>4,549,168</u>

[次へ](#)

5 その他

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「5 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1)（省略）

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成25年9月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

<訂正後>

(1)（省略）

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成25年12月16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3【その他】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第3 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

(注) 下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(前略)

(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。

(中略)

__ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(中略)

(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) (略)

(8) (略)

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

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

<訂正後>

(前略)

(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。

(中略)

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

__ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(中略)

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。)を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)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。

(8) (略)

(9) (略)

(10)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。