

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年4月11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（平成25年12月16日付及び平成26年2月3日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。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。

(5) 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。

（中略）

「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。
また、消費税率が8%になった場合は、3.24%（税込）となります。

<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、3.24%（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。

（中略）

「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。

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

「2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。」を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

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、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)ファンドの仕組み

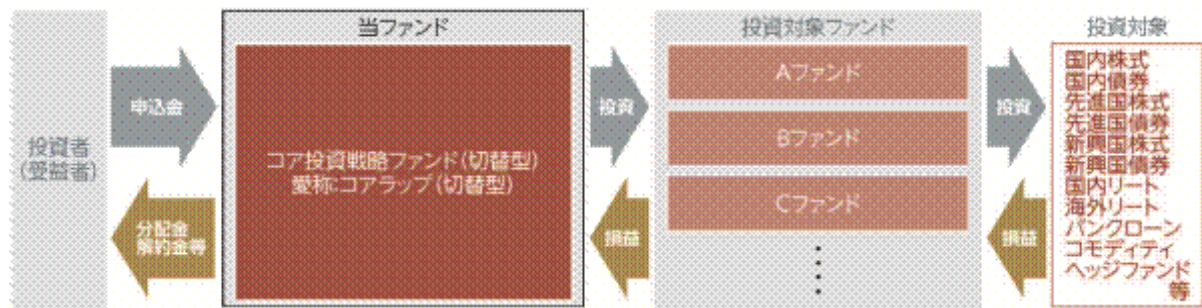
ファンド・オブ・ファンズでの運用

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・オブ・ファンズ方式（ ）で運用します。

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



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>

(前略)

イ．資本金の額：3億円（平成25年11月29日現在）

(中略)

ハ．大株主の状況（平成25年11月29日現在）

(後略)

<訂正後>

(前略)

イ．資本金の額：3億円（平成26年1月31日現在）

(中略)

ハ．大株主の状況（平成26年1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

「 - 投資対象ファンドの概要 - 」を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

投資対象ファンドとして予定しているファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、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。

各投資対象ファンドのうち、「1」から「12」、「14」から「17」及び「19」は、国内籍の契約型株式投資信託です。「13」及び「18」は、外国籍円建投資信託証券です。「1」、「3」、「5」から「6」、「8」から「9」、「11」から「12」、「14」及び「16」は、委託会社が設定・運用を行う親投資信託です。「2」、「4」、「7」、「10」、「15」及び「19」は、委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託です。「17」は、他の委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託です。「13」及び「18」は、他の投資顧問会社が設定・運用を行う外国籍円建投資信託証券です。以下の内容は、平成26年4月11日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

1.ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてわが国の株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式
投資態度	<p>主として、日経平均株価に採用されている株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。</p> <p>株式の売買の判断は、複数の投資判断モデルを組み合わせることで機動的に行います。その結果、株式の組入比率は、投資信託財産の純資産総額に対して大きく変動し、ゼロとなる場合もあります。</p> <p>株式以外の資産への投資は、わが国の円建短期公社債等を中心に行います。</p> <p>運用にあたっては、三井住友信託銀行株式会社の投資助言を受けます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の一部解約又は追加信託の処理を行う前の投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を一部解約又は追加信託の処理を行う前の受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成23年11月28日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

2.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資するJPX日経インデックス400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）
決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0756%（税抜 年0.07%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年2月3日
信託期間	原則として平成26年2月3日から平成35年10月20日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

JPX日経インデックス400とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開発された手法により、東京証券取引所第一部、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、JPXグループ及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

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

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

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

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

3. 国内債券インデックス マザーファンド

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

投資態度	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。 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。 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。 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。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。
主な投資制限	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。 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。 外貨建資産への投資は、行いません。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

4. FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	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	<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5%以下とします。</p> <p>転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年4月11日
信託期間	原則として平成26年4月11日から平成36年2月14日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

5. 外国株式インデックス マザーファンド

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

投資態度	<p>原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>
ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

6. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債

投資態度	<p>シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

7. FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券（以下本概要中において「マザーファンド受益証券」といいます。）

投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）（ ）に採用されている国・地域）の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）をベンチマークとし、その動きと連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>なお、世界の主要国の公社債（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）に採用されている国・地域の公社債）に直接投資する場合があります。実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行います。資産規模によっては全ての通貨に対してヘッジができない場合があります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ円ベース）
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.4104%（税抜 年0.38%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月8日
信託期間	原則として、平成24年8月8日から平成34年6月27日
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

8. 新興国株式インデックス マザーファンド

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

運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
投資態度	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。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。 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。 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。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	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。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 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。
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成20年12月12日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

9.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券

投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	平成20年12月11日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

10. FOFs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「米ドル建新興国債券インデックス マザーファンド」（以下本概要中において「マザーファンド」といいます。）の受益証券

投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建の新興国債券に投資し、パークレイズ・US・エマージング・ソブリン・マキシマム・レイティング・インベストメント・グレイド・インデックス（円ヘッジ・円ベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。</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、原則として為替ヘッジを行います。</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>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り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
ベンチマーク	パークレイズ・US・エマージング・ソブリン・マキシマム・レイティング・インベストメント・グレイド・インデックス（円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年5月2日
信託期間	原則として無期限
助言会社	マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「パークレイズ・US・エマージング・ソブリン・マキシマム・レイティング・インベストメント・グレイド・インデックス（円ヘッジ・円ベース）」とは、パークレイズ・バンク・ピーエルシーおよび関連会社（以下「パークレイズ」）が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、新興国が発行する米ドル建ての国債のうち、パークレイズが定める基準により投資適格格付が付与されていることなどの一定の要件を満たす国債から構成されます。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。

11. 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	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。 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。 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。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が30%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。
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。

12. グローバルREITインデックス マザーファンド

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

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」（以下「当インデックス」）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。

当インデックスはSPDJI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[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]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隨する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隨する、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。

13.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	<p>年率0.65%</p> <p>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、受託会社・管理事務代行会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。</p> <p>この他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年10月2日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・投資顧問会社 Credit Suisse Asset Management, LLC ・受託会社 G.A.S. (Cayman) Limited ・管理事務代行会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited ・保管受託銀行 State Street Bank and Trust Company

14. 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、主としてダウジョーンズUBSコモディティ・インデックス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、ダウジョーンズUBSコモディティ・インデックス（円ベース）（ ）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>ダウジョーンズUBSコモディティ・インデックス（円ベース）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。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

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

「ダウジョーンズUBSコモディティ・インデックス（円ベース）」は、「Dow Jones-UBS Commodity IndexesSM」をもとに当社が独自に円換算した指数です。「Dow Jones-UBS Commodity IndexesSM」とは、S&P Dow Jones Indices LLCの子会社であるDJI Opco, LLC（以下「DJI Opco」）とUBS Securities LLC（以下「UBS Securities」）の共同商品で、商品（コモディティ）市場全体の値動きを表す指数です。同指数は、DJI OpcoとUBS Securitiesの共同商品であり、それを利用するライセンスが供与されています。Dow Jones[®]およびDJ[®]はDow Jones Trademark Holdings, LLC（以下「Dow Jones」）の商標で、「UBS」はUBS AGの登録商標で、S&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC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DJI Opco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、Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それぞれの子会社または関連会社によって支援、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。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、当ファンドの受益者またはいかなる一般人に対しても、株式または商品全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性に関して、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。

Dow Jones、UBS AG、UBS 証券、DJI Opco、それらの子会社または関連会社と、ライセンシーとの間にある唯一の関係は、特定の商標、商標名、サービスマークおよびDow Jones-UBS Commodity IndexesSMのライセンス供与であり、これは当社または当ファンドには関係なく、UBS Securitiesと協力してDJI Opcoにより決定、構成および計算されます。UBS SecuritiesおよびDJI Opcoは、Dow Jones-UBS Commodity IndexSM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受益者の要求を考慮する義務を負いません。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それぞれの子会社または関連会社のいずれも、将来発行される当ファンドのタイミング、価格または数量の決定、あるいは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。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、いかなる義務または責任も負わないものとし、これには当ファンドの管理、マーケティングまたは取引に関する顧客に対するものが含まれますがこれに限定されません。上記にかかわらず、UBS AG、UBS Securities、S&P Dow Jones Indices LLCの関連会社であるCME Group Inc.、それぞれの子会社および関連会社は、当社により現在設定・運用されている当ファンドに関連しないが、これに類似または競合する金融商品を独自に発行または支援できるものとします。さらに、UBS AG、UBS Securities、CME Group Inc.、それらの子会社および関連会

社は、商品、商品指数および商品先物（Dow Jones-UBS Commodity IndexおよびDow Jones-UBS Commodity Index Total ReturnSMを含む）に加えて、かかる商品、商品指数および商品先物のパフォーマンスに関連するスワップ、オプションおよびデリバティブを積極的に取引します。この取引活動がDow Jones-UBS Commodity Indexと当ファンドの価値に影響を及ぼす可能性があります。

当ファンドの受益者は、Dow Jones-UBS Commodity Indexに先物契約が含まれることにより、Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社が当該先物契約または取引所で取引された対象の現物商品に対して、投資を推奨しているものと見なしてはなりません。Dow Jones-UBS Commodity Indexの構成要素に関する価格決定補完の情報は、公的に入手可能な文書からのみ得られています。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、当ファンドに関連するDow Jones-UBS Commodity Indexの構成要素について、適正評価のためのいかなる照会も行なっていません。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、これらの公的に入手可能な文書または、Dow Jones-UBS Commodity Indexの構成要素の価格に影響する要因の説明を含め、かかる構成要素に関する入手可能なその他の情報の正確性や完全性について、いかなる表明もしていません。

Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity Indexまたはそれに関するデータの正確性および完全性を保証せず、Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、その中の誤り、欠落または中断に対する責任を負わないものとします。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社は、Dow Jones-UBS Commodity IndexSMまたはそれに関連するデータを使用することによって当社、当ファンドの受益者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もしません。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社は、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、Dow Jones-UBS Commodity IndexSM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、Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社は、利益の逸失または間接的、懲罰的、特別または派生的な損害または損失に対して、その可能性を知らされていたとしても、責任を負わないものとします。UBS AGとDJI Opcoのライセンサーを除き、UBS Securities、DJI Opco、および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。

15. TCAファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数を対象とした先物取引（以下「株価指数先物取引」といいます。）及び債券先物取引を積極的に活用し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の円建短期公社債等並びに日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引（以下「先物取引等」といいます。）を行います。</p> <p>運用にあたっては、三井住友信託銀行株式会社から助言を受けます。</p> <p>先物取引等は、原則として定量的手法に基づき行います。</p> <p>先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の75の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の500の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>ここでいう投資額とは、投資信託財産における先物取引等の種類ごとに買建玉の時価総額と売建玉の時価総額の差額の絶対値を合計した額をいいます。</p> <p>先物取引等にかかる損益等の為替リスクに対しては、原則として為替予約を行い、為替リスクの低減をはかります。</p> <p>大量の追加設定又は解約が発生したとき、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき、投資信託財産の規模その他の要因等によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	6月・12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲 経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配対象額についての分配方針 委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用方針 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成22年2月25日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

16. 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	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。 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。 原則として、円建債券の組入比率は高位を保ちます。 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。
主な投資制限	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。 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。 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。 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。 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。 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。 外貨建資産への投資は行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：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

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

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

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

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

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

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

投資顧問会社	Standard Life Investments Limited
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等に投資します。

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

19.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」（以下本概要中において「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。 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により、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。 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。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への直接投資は行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

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

(3)運用体制

<訂正前>

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成26年2月3日現
在のものであり、今後変更されることがあります。

（後略）

<訂正後>

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成26年4月11日現
在のものであり、今後変更されることがあります。

（後略）

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。

(1)ファンドのリスク

<訂正前>

（前略）

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。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。

（後略）

<訂正後>

（前略）

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。

（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更新・訂正します。

(1) 申込手数料

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 >

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。

消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

（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、3.24%（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）

(3) 信託報酬等

該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

< 更新・訂正後 >

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 1.4904%（税抜 1.38%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.9504%	（税抜 0.88%）
販売会社	年率 0.486%	（税抜 0.45%）
受託会社	年率 0.054%	（税抜 0.05%）

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、換金（解約）手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	ありません。
FOFs用JPX日経インデックス400・オープン （適格機関投資家専用）	年率 0.0756% （税抜 0.07%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり （適格機関投資家専用）	年率 0.4104% （税抜 0.38%）
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり （適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 0.65%
グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	ありません。
TCAファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.864% （税抜 0.8%）
FRMシグマ リンク マザーファンド	ありません。
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド ・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.864% （税抜 0.8%）
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D ^{A, H} , JPY	年率 0.85%
FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）

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1.4904%～1.98186%程度（税抜 1.38%～1.8445%程度）

(5)課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

上記は、平成26年1月1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26年1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26年1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	461,264,426	29.55
	ケイマン	59,917,337	3.84
	小計	521,181,763	33.39
投資証券	ルクセンブルク	114,989,171	7.37
親投資信託受益証券	日本	905,537,347	58.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,061,335	1.22
合計(純資産総額)		1,560,769,616	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	117,109,294	1.4097	165,089,000	1.3881	162,559,411	10.42
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)	148,861,483	1.0174	151,461,000	1.0131	150,811,568	9.66
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	58,659,892	2.4688	144,823,000	2.4528	143,880,983	9.22
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	89,012,019	1.5955	142,021,000	1.5460	137,612,581	8.82
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	64,782.632	1,783.04	115,510,049	1,775.00	114,989,171	7.37
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	70,401,024	1.6312	114,839,000	1.5874	111,754,585	7.16
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)	104,232,586	1.0462	109,057,178	1.0343	107,807,763	6.91

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	98,085,049	0.8728	85,616,916	0.8632	84,667,014	5.42
日本	投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	87,812,437	0.9661	84,835,739	0.9610	84,387,751	5.41
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	53,828,618	1.1816	63,608,990	1.1897	64,039,906	4.10
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	53,886,587	1.1660	62,835,000	1.1598	62,497,663	4.00
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	47,489,472	1.2823	60,896,547	1.2853	61,038,218	3.91
ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	58,877.0164	1,017.37	59,900,000	1,017.66	59,917,337	3.84
日本	投資信託 受益証券	F0Fs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	58,289,825	1.0130	59,051,734	1.0177	59,321,554	3.80
日本	投資信託 受益証券	F0Fs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	65,462,391	0.9041	59,187,343	0.9003	58,935,790	3.78
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	22,343,155	2.1458	47,945,000	2.0689	46,225,753	2.96
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	68,902,872	0.4550	31,354,000	0.4537	31,261,233	2.00

(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) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	33.39
投資証券	7.37
親投資信託受益証券	58.02
合計	98.78

(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	
11月末日	1,018,182		10,182	
12月末日	1,029,941		10,299	
平成26年 1月末日	1,560,769,616		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	11,956,328,400	38.57
国債証券	日本	12,997,569,000	41.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,043,217,507	19.50
合計(純資産総額)		30,997,114,907	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第375回国庫短期証券		13,000,000,000	99.97	12,996,568,000	99.98	12,997,569,000	0.0	2014/06/20	41.93
日本	株式	日本電気	電気機器	1,109,000	280.18	310,722,617	299.00	331,591,000			1.07
日本	株式	帝人	繊維製品	1,242,000	238.04	295,648,924	233.00	289,386,000			0.93
日本	株式	I H I	機械	581,000	496.38	288,399,831	472.00	274,232,000			0.88
日本	株式	コニカミノルタ	電気機器	230,000	1,013.91	233,200,573	1,092.00	251,160,000			0.81
日本	株式	T & Dホールディングス	保険業	198,400	1,366.88	271,189,777	1,265.00	250,976,000			0.81

日本	株式	第一生命保険	保険業	158,800	1,661.92	263,914,436	1,559.00	247,569,200			0.80
日本	株式	あおぞら銀行	銀行業	801,000	306.61	245,601,242	294.00	235,494,000			0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,200	4,184.62	239,360,396	4,102.00	234,634,400			0.76
日本	株式	日本製紙	パルプ・紙	123,800	1,877.98	232,495,110	1,863.00	230,639,400			0.74
日本	株式	TDK	電気機器	48,800	4,879.02	238,096,498	4,690.00	228,872,000			0.74
日本	株式	マツダ	輸送用機器	451,000	534.71	241,155,418	501.00	225,951,000			0.73
日本	株式	三菱倉庫	倉庫・運輸関連業	155,000	1,581.72	245,167,966	1,455.00	225,525,000			0.73
日本	株式	オークマ	機械	221,000	1,082.60	239,254,600	1,002.00	221,442,000			0.71
日本	株式	ジェイテクト	機械	141,600	1,665.72	235,866,000	1,543.00	218,488,800			0.70
日本	株式	ファナック	電気機器	12,400	19,241.79	238,598,202	16,770.00	207,948,000			0.67
日本	株式	サッポロホールディングス	食料品	529,000	462.06	244,433,386	391.00	206,839,000			0.67
日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	448,000	427.58	191,558,222	417.00	186,816,000			0.60
日本	株式	リコー	電気機器	170,000	1,123.83	191,051,927	1,091.00	185,470,000			0.60
日本	株式	住友金属鉱山	非鉄金属	136,000	1,408.11	191,503,141	1,345.00	182,920,000			0.59
日本	株式	明電舎	電気機器	436,000	419.14	182,748,363	416.00	181,376,000			0.59
日本	株式	いすゞ自動車	輸送用機器	277,000	634.75	175,828,493	619.00	171,463,000			0.55
日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	330,000	519.89	171,563,783	512.00	168,960,000			0.55
日本	株式	第一三共	医薬品	85,200	1,721.70	146,689,000	1,723.00	146,799,600			0.47
日本	株式	富士通	電気機器	234,000	505.04	118,179,360	578.00	135,252,000			0.44
日本	株式	東邦亜鉛	非鉄金属	370,000	325.97	120,608,900	365.00	135,050,000			0.44
日本	株式	清水建設	建設業	240,000	525.81	126,195,915	558.00	133,920,000			0.43
日本	株式	古河電気工業	非鉄金属	506,000	240.43	121,657,580	254.00	128,524,000			0.41
日本	株式	大日本住友製薬	医薬品	72,000	1,627.31	117,166,736	1,766.00	127,152,000			0.41
日本	株式	りそなホールディングス	銀行業	232,800	551.03	128,281,532	546.00	127,108,800			0.41

(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	38.57
国債証券	41.93
合計	80.50

(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。

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	水産・農林業	0.33
		鉱業	0.41
		建設業	0.82
		食料品	1.02
		繊維製品	0.93
		パルプ・紙	1.08
		化学	1.50
		医薬品	0.88
		石油・石炭製品	0.34
		ゴム製品	0.39
		ガラス・土石製品	0.74
		鉄鋼	0.35
		非鉄金属	2.57
		機械	3.83
		電気機器	8.43
		輸送用機器	2.45
		精密機器	0.33
		その他製品	0.38
		電気・ガス業	1.50
		海運業	0.37
		倉庫・運輸関連業	0.73
情報・通信業	1.46		
小売業	1.84		
銀行業	2.20		
証券、商品先物取引業	0.37		
保険業	1.95		
不動産業	1.38		
合計			38.57

(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	190,940,139,950	77.86
	ポーランド	200,076,000	0.08
	小計	191,140,215,950	77.94
地方債証券	日本	15,360,042,977	6.26
特殊債券	日本	21,388,336,619	8.72
	アメリカ	208,808,000	0.09
	韓国	201,000,000	0.08
	スウェーデン	101,087,000	0.04
	小計	21,899,231,619	8.93
社債券	日本	13,800,815,990	5.63
	オーストラリア	406,760,000	0.17
	オランダ	405,866,000	0.17
	アメリカ	207,424,000	0.08
	スウェーデン	102,556,000	0.04
	イギリス	101,248,000	0.04
	小計	15,024,669,990	6.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,818,984,311	0.74
合計(純資産総額)		245,243,144,847	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	3,880,000,000	100.37	3,894,591,100	100.54	3,901,029,600	0.3	2018/06/20	1.59
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	100.34	2,649,160,800	0.6	2023/03/20	1.08
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	2,590,000,000	100.71	2,608,540,800	100.72	2,608,699,800	0.4	2016/06/20	1.06
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	2,430,000,000	105.16	2,555,462,700	105.21	2,556,821,700	1.5	2017/12/20	1.04
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	2,460,000,000	99.91	2,458,022,800	100.23	2,465,781,000	0.2	2017/06/20	1.01

日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,340,000,000	100.64	2,355,179,000	102.00	2,386,800,000	0.8	2023/06/20	0.97
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	2,370,000,000	100.65	2,385,405,000	100.47	2,381,139,000	0.5	2015/03/20	0.97
日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	2,260,000,000	98.94	2,236,044,000	102.24	2,310,737,000	0.8	2022/12/20	0.94
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	101.59	2,275,648,700	101.86	2,281,798,400	0.8	2023/09/20	0.93
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	106.07	2,227,638,000	1.5	2018/09/20	0.91
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,230,000,000	99.49	2,218,664,400	99.81	2,225,829,900	0.6	2023/12/20	0.91
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,170,000,000	99.33	2,155,537,000	102.35	2,221,060,100	0.8	2022/09/20	0.91
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	105.64	2,207,959,600	1.7	2017/09/20	0.90
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,090,000,000	100.28	2,095,882,500	100.57	2,102,017,500	0.3	2017/03/20	0.86
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1,990,000,000	105.26	2,094,674,000	104.94	2,088,385,600	1.7	2017/03/20	0.85
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	101.67	2,033,440,000	1.3	2015/06/20	0.83
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1,900,000,000	105.22	1,999,196,700	106.23	2,018,408,000	1.3	2019/12/20	0.82
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	1,980,000,000	100.12	1,982,507,000	100.55	1,991,048,400	0.3	2016/12/20	0.81
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	1,960,000,000	100.03	1,960,664,700	100.06	1,961,332,800	0.2	2018/09/20	0.80
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	1,900,000,000	100.50	1,909,606,000	100.78	1,914,915,000	0.4	2016/09/20	0.78
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	100.21	1,884,060,800	0.2	2017/09/20	0.77
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	105.36	1,748,976,000	1.3	2018/12/20	0.71
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1,610,000,000	102.61	1,652,092,000	104.54	1,683,190,600	1.0	2020/09/20	0.69
日本	国債証券	第318回利付国債(10年)	1,610,000,000	101.29	1,630,916,700	104.24	1,678,360,600	1.0	2021/09/20	0.68
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1,530,000,000	106.37	1,627,497,500	106.61	1,631,209,500	1.4	2019/09/20	0.67
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	106.48	1,607,983,900	1.3	2021/03/20	0.66
日本	国債証券	第111回利付国債(5年)	1,570,000,000	100.21	1,573,297,000	100.96	1,585,087,700	0.4	2018/03/20	0.65
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1,470,000,000	104.11	1,530,478,000	105.84	1,555,950,900	1.2	2020/12/20	0.63
日本	国債証券	第96回利付国債(5年)	1,470,000,000	100.87	1,482,790,800	100.86	1,482,744,900	0.5	2016/03/20	0.60
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	1,460,000,000	99.90	1,458,685,800	100.02	1,460,350,400	0.2	2018/12/20	0.60

(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	77.94
地方債証券	6.26
特殊債券	8.93
社債券	6.13
合計	99.26

(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	4	578,361,260	578,960,000	578,960,000	0.24

(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	85,779,415,591	53.77
	イギリス	14,630,966,697	9.17
	スイス	6,947,987,692	4.36
	カナダ	6,800,443,675	4.26
	ドイツ	6,521,029,380	4.09
	フランス	6,356,731,408	3.98
	オーストラリア	4,678,772,545	2.93
	オランダ	2,556,335,822	1.60
	スペイン	2,357,580,319	1.48
	スウェーデン	2,227,129,243	1.40
	香港	1,564,661,660	0.98
	イタリア	1,528,175,530	0.96
	アイルランド	1,399,151,334	0.88
	シンガポール	954,800,099	0.60

	デンマーク	865,184,097	0.54
	ジャージー	853,486,716	0.53
	ベルギー	810,774,852	0.51
	キュラソー	637,723,247	0.40
	フィンランド	616,155,780	0.39
	バミューダ	586,283,913	0.37
	ノルウェー	457,480,653	0.29
	イスラエル	341,298,678	0.21
	ルクセンブルク	284,047,925	0.18
	ケイマン	198,793,598	0.12
	オーストリア	195,644,083	0.12
	ポルトガル	125,088,170	0.08
	英ヴァージン諸島	86,592,082	0.05
	ニュージーランド	84,788,617	0.05
	パナマ	82,345,576	0.05
	ガーンジー	44,348,292	0.03
	リベリア	41,058,419	0.03
	マン島	34,857,558	0.02
	モーリシャス	18,632,016	0.01
	小計	150,667,765,267	94.44
投資信託受益証券	オーストラリア	70,848,763	0.04
	シンガポール	15,322,025	0.01
	香港	12,822,940	0.01
	小計	98,993,728	0.06
投資証券	アメリカ	2,045,072,759	1.28
	オーストラリア	357,965,351	0.22
	イギリス	211,336,129	0.13
	フランス	202,168,103	0.13
	香港	58,090,500	0.04
	シンガポール	54,170,682	0.03
	カナダ	32,077,634	0.02
	オランダ	15,172,842	0.01
	小計	2,976,054,000	1.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,789,325,185	3.63
合計(純資産総額)		159,532,138,180	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	48,051	45,406.51	2,181,828,615	51,372.39	2,468,495,115	1.55
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	232,557	9,502.20	2,209,804,706	9,667.81	2,248,317,215	1.41
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,484	90,647.43	1,312,937,407	116,592.83	1,688,730,674	1.06
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	418,426	3,601.12	1,506,805,835	3,792.44	1,586,858,930	0.99
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	537,900	2,427.49	1,305,750,098	2,622.93	1,410,874,047	0.88
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	148,846	9,011.56	1,341,335,344	9,205.96	1,370,271,810	0.86
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	170,048	7,465.68	1,269,525,653	7,516.98	1,278,247,585	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	266,387	4,167.88	1,110,270,967	4,736.70	1,261,796,102	0.79
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	102,035	13,004.58	1,326,923,320	11,978.04	1,222,180,025	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	198,778	5,616.15	1,116,368,257	5,760.15	1,144,993,084	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	144,615	8,317.25	1,202,800,497	7,906.84	1,143,448,852	0.72
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	349,595	2,978.82	1,041,382,535	3,170.14	1,108,266,911	0.69
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	999,301	1,260.72	1,259,841,155	1,069.32	1,068,575,902	0.67
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	37,099	28,791.34	1,068,130,219	28,415.21	1,054,176,024	0.66
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	54,998	21,372.25	1,175,431,049	18,243.24	1,003,342,241	0.63
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	121,456	8,138.17	988,429,818	8,235.05	1,000,196,840	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	567,156	1,373.18	778,807,843	1,741.41	987,656,688	0.62
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	2,546,388	334.26	851,180,098	382.88	974,968,472	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	283,421	3,721.47	1,054,744,109	3,430.38	972,242,013	0.61
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	154,459	4,898.19	756,570,023	5,504.03	850,148,298	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	210,617	4,376.69	921,805,949	3,926.16	826,917,346	0.52
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	991,994	817.85	811,309,832	810.90	804,408,647	0.50

アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	19,291	27,493.44	530,376,132	41,416.57	798,967,225	0.50
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	160,531	5,327.11	855,167,804	4,968.13	797,540,161	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	152,673	5,227.34	798,074,473	4,899.22	747,978,889	0.47
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	201,188	3,824.58	769,461,049	3,643.87	733,104,527	0.46
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	183,436	3,551.75	651,519,876	3,846.96	705,671,688	0.44
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	85,421	9,603.00	820,298,683	8,135.19	694,916,697	0.44
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	258,635	3,023.69	782,034,028	2,675.00	691,849,969	0.43
アメリカ	株式	QUALCOMM	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	90,608	6,590.24	597,128,484	7,535.52	682,778,722	0.43

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	94.44
投資信託受益証券	0.06
投資証券	1.87
合計	96.37

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	9.66
		素材	5.44
		資本財	7.48
		商業・専門サービス	0.90
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	1.70
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	1.68
		メディア	2.96
		小売	3.04
		食品・生活必需品小売り	2.10
		食品・飲料・タバコ	5.82
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	2.97
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.90		

	銀行	7.66
	各種金融	5.84
	保険	4.10
	不動産	0.63
	ソフトウェア・サービス	6.61
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.78
	電気通信サービス	3.44
	公益事業	3.12
	半導体・半導体製造装置	1.47
合計		94.44

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該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	84	37,929,853	37,405,200	3,847,498,872	2.41
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	24	3,684,280	3,768,960	347,460,422	0.22
	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	37	2,953,879	3,004,030	342,399,339	0.21
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	166	4,991,927	5,014,860	699,272,078	0.44
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	31	3,976,692	3,981,950	361,441,601	0.23
	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	66	4,293,947.50	4,281,420	726,471,345	0.46

(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	85,532,012,693	38.81
	フランス	22,040,225,984	10.00
	イタリア	21,914,487,988	9.94
	ドイツ	19,520,682,311	8.86
	イギリス	17,373,250,601	7.88
	スペイン	11,618,927,957	5.27
	オランダ	6,109,751,521	2.77
	ベルギー	5,994,541,381	2.72

カナダ	5,011,082,345	2.27
オーストリア	3,712,640,190	1.68
オーストラリア	3,240,211,190	1.47
メキシコ	2,084,152,190	0.95
アイルランド	1,787,760,202	0.81
ポーランド	1,777,262,351	0.81
デンマーク	1,716,582,128	0.78
フィンランド	1,428,202,727	0.65
スウェーデン	1,219,721,394	0.55
マレーシア	1,106,605,396	0.50
南アフリカ	958,094,972	0.43
スイス	811,638,014	0.37
シンガポール	765,910,982	0.35
ノルウェー	707,134,017	0.32
小計	216,430,878,534	98.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	3,953,355,611	1.79
合計(純資産総額)	220,384,234,145	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/30/15	34,400,000	10,290.11	3,539,799,353	10,312.51	3,547,506,413	0.375	2015/06/30	1.61
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,536.97	2,929,279,995	10,488.10	2,915,692,871	1.375	2015/11/30	1.32
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	10,295.04	2,079,599,085	10,312.31	2,083,088,165	0.375	2015/06/15	0.95
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	10,664.29	2,047,544,009	10,531.09	2,021,970,459	2.375	2015/02/28	0.92
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	10,261.08	1,990,651,196	10,223.52	1,983,362,990	0.750	2017/06/30	0.90
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,218.69	1,839,365,821	10,248.23	1,844,681,606	0.250	2016/04/15	0.84
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,267.11	1,632,471,619	10,282.98	1,634,994,854	0.250	2015/10/15	0.74
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,603.62	1,590,543,070	10,521.05	1,578,157,671	1.750	2015/07/31	0.72
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,270.73	1,437,902,447	10,291.82	1,440,855,653	0.250	2015/07/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,620.89	1,391,337,592	10,529.08	1,379,310,407	1.875	2015/06/30	0.63

アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,297.31	1,369,542,841	10,313.12	1,371,645,132	0.625	2016/07/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	11,172.76	1,396,595,716	10,922.84	1,365,356,002	4.250	2015/08/15	0.62
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000	14,837.53	1,305,702,773	14,567.15	1,281,909,847	3.250	2015/07/04	0.58
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	10,141.20	1,267,650,774	9,783.55	1,222,944,121	2.000	2023/02/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	10,302.47	1,184,784,469	10,311.31	1,185,801,021	0.375	2015/04/15	0.54
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	14,833.41	1,171,840,025	14,508.66	1,146,184,320	3.500	2015/04/25	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,790.93	1,155,511,155	11,497.61	1,126,766,611	4.500	2017/05/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	10,000,000	11,392.77	1,139,277,360	11,065.68	1,106,568,682	3.125	2019/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,714.51	1,103,595,188	10,625.11	1,094,387,005	2.000	2016/01/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	10,102.28	1,111,251,229	9,885.60	1,087,417,036	1.250	2020/02/29	0.49
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	16,475.47	1,087,381,565	16,203.62	1,069,439,263	4.250	2019/04/25	0.49
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000	14,906.74	1,028,565,076	15,278.09	1,054,188,361	4.500	2018/08/01	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	11,160.91	1,060,286,701	10,979.09	1,043,014,459	3.000	2017/02/28	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	10,179.02	1,028,081,585	10,095.54	1,019,650,380	0.750	2018/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/31/17	10,000,000	10,198.81	1,019,881,010	10,128.49	1,012,849,562	0.750	2017/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	9,500,000	10,703.61	1,016,843,102	10,565.24	1,003,698,641	2.500	2015/03/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/31/19	10,000,000	10,031.23	1,003,123,223	9,857.08	985,708,181	1.125	2019/12/31	0.45
イギリス	国債証券	UKT 1% 09/07/17	5,800,000	17,051.14	988,966,305	16,777.61	973,101,904	1.000	2017/09/07	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	10,200,000	9,607.40	979,955,007	9,520.77	971,119,341	1.750	2023/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/18	9,400,000	10,068.75	946,463,409	10,169.88	955,968,787	1.250	2018/11/30	0.43

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.21
合計	98.21

(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	10	1,196,680.65	1,204,765.60	123,922,189	0.06
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	6	743,414.63	752,718.78	77,424,653	0.04
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	3	390,043.25	399,843.75	41,127,928	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	661,879	663,510	92,519,834	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	750,164	758,520	105,768,028	0.05
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金 融先物取引所	買建	ユーロ	9	1,269,466	1,289,070	179,747,920	0.08

(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	3,256,270,650	15.64
	台湾	2,404,250,084	11.55
	中国	2,062,118,091	9.91
	ブラジル	2,016,359,673	9.69
	南アフリカ	1,417,246,875	6.81
	インド	1,299,401,050	6.24
	ロシア	1,197,161,547	5.75
	メキシコ	1,068,645,464	5.13
	ケイマン	929,381,935	4.47
	香港	874,478,072	4.20
	マレーシア	783,111,120	3.76
	インドネシア	497,386,653	2.39
	タイ	457,347,593	2.20
	ポーランド	340,307,401	1.64
	チリ	309,960,592	1.49
トルコ	289,292,922	1.39	

	フィリピン	198,802,121	0.96
	バミューダ	194,407,251	0.93
	コロンビア	171,142,027	0.82
	ギリシャ	88,509,113	0.43
	チェコ	61,687,613	0.30
	ハンガリー	55,177,955	0.27
	エジプト	45,721,088	0.22
	ペルー	21,941,889	0.11
	アメリカ	18,437,284	0.09
	ルクセンブルク	4,073,701	0.02
	小計	20,062,619,764	96.39
投資信託受益証券	ブラジル	34,554,290	0.17
	南アフリカ	13,460,740	0.06
	メキシコ	9,161,981	0.04
	小計	57,177,011	0.27
投資証券	メキシコ	24,040,139	0.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		670,001,585	3.22
合計(純資産総額)		20,813,838,499	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	6,075	134,247.28	815,552,275	122,112.00	741,830,400	3.56
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,359,389	359.42	488,593,689	355.94	483,874,514	2.32
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	56,400	5,361.67	302,398,745	7,195.94	405,851,016	1.95
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	334,000	1,064.62	355,586,055	980.42	327,460,948	1.57
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	330,080	924.39	305,123,620	863.50	285,027,281	1.37
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,929,620	78.03	306,629,447	71.36	280,431,829	1.35
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,018,515	69.03	277,427,171	63.68	255,916,716	1.23
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	21,690	8,510.56	184,594,049	10,247.21	222,262,149	1.07
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,955,340	106.28	207,825,470	110.42	215,925,067	1.04
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	8,666	23,667.44	205,102,083	22,371.29	193,869,685	0.93
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,125,200	46.82	193,176,654	43.55	179,692,061	0.86
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	160,100	1,277.39	204,511,733	1,122.20	179,664,636	0.86

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	613,352	251.75	154,413,560	287.81	176,529,452	0.85
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	138,090	1,369.87	189,166,035	1,259.91	173,981,469	0.84
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	256,200	740.77	189,785,674	677.33	173,532,355	0.83
南アフリ カ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	93,480	1,827.36	170,821,820	1,839.37	171,945,102	0.83
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	29,266	6,484.44	189,773,893	5,868.16	171,737,658	0.83
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	979,000	201.19	196,969,534	161.52	158,135,912	0.76
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サー ビス	25,580	5,604.23	143,356,434	6,149.05	157,292,826	0.76
南アフリ カ	株式	SASOL LTD	エネルギー	30,263	4,663.85	141,142,309	4,943.66	149,610,242	0.72
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	223,140	838.23	187,043,802	627.39	139,997,143	0.67
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	107,615	1,394.96	150,118,721	1,270.15	136,687,924	0.66
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	118,500	1,307.51	154,940,079	1,097.72	130,080,957	0.62
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	422,000	273.29	115,330,620	280.68	118,450,336	0.57
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,182,000	113.63	134,312,953	99.43	117,529,096	0.56
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,435,400	83.25	119,501,492	81.82	117,449,021	0.56
韓国	株式	HYUNDAI MOBIS	自動車・自動車部品	3,820	29,074.67	111,065,260	29,574.00	112,972,680	0.54
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	79,339	1,343.52	106,593,612	1,376.38	109,201,326	0.52
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造 装置	30,000	3,099.11	92,973,457	3,610.89	108,326,700	0.52
韓国	株式	POSCO	素材	3,713	30,922.11	114,813,814	28,476.89	105,734,729	0.51

(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	96.39
投資信託受益証券	0.27
投資証券	0.12
合計	96.78

(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

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	10.59
		素材	9.32
		資本財	4.72
		商業・専門サービス	0.14
		運輸	1.58

自動車・自動車部品	3.72
耐久消費財・アパレル	0.91
消費者サービス	0.77
メディア	1.76
小売	1.63
食品・生活必需品小売り	1.99
食品・飲料・タバコ	5.00
家庭用品・パーソナル用品	1.02
ヘルスケア機器・サービス	0.57
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.10
銀行	17.60
各種金融	2.32
保険	3.30
不動産	1.82
ソフトウェア・サービス	4.51
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.46
電気通信サービス	7.08
公益事業	3.22
半導体・半導体製造装置	8.24
合計	96.39

(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	148	7,053,606	6,834,640	703,011,070	3.38

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

新興国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	2,666,744,445	10.03
	ブラジル	2,650,478,508	9.97
	マレーシア	2,632,344,498	9.90
	ロシア	2,569,739,621	9.66
	ポーランド	2,566,592,747	9.65
	トルコ	2,561,674,129	9.63

南アフリカ	2,559,641,509	9.63
タイ	2,176,685,028	8.19
インドネシア	1,869,648,544	7.03
ハンガリー	1,541,670,741	5.80
コロンビア	885,521,153	3.33
ナイジェリア	535,268,715	2.01
ペルー	464,124,251	1.75
フィリピン	140,042,096	0.53
チリ	38,008,499	0.14
小計	25,858,184,484	97.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	731,366,533	2.75
合計(純資産総額)	26,589,551,017	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	297.92	739,140,735	296.28	735,074,252	7.000	2015/06/03	2.76
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	230,000,000	305.73	703,197,285	296.11	681,072,021	7.850	2018/03/10	2.56
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	223,000,000	302.49	674,561,961	287.21	640,481,734	7.600	2021/04/14	2.41
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	176,000,000	305.52	537,723,177	291.54	513,111,614	8.150	2027/02/03	1.93
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	8,840,000,000	5.78	511,819,171	5.71	504,797,052	12.000	2015/10/22	1.90
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	14,000,000	3,356.61	469,926,176	3,313.29	463,860,659	0.000	2016/01/01	1.74
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	12,200,000	3,994.89	487,376,718	3,760.88	458,827,384	7.100	2023/03/08	1.73
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	42,000,000	1,080.66	453,879,167	1,035.61	434,957,002	10.500	2026/12/21	1.64
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	4,501.73	427,665,016	4,433.27	421,161,438	12.500	2016/01/05	1.58
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000	4,045.40	384,313,637	3,984.13	378,492,643	10.000	2017/01/01	1.42
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000	3,679.91	377,191,008	3,658.19	374,964,991	0.000	2015/04/01	1.41
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	115,000,000	312.94	359,882,093	315.99	363,399,816	3.250	2017/06/16	1.37
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	104,500,000	317.22	331,505,015	319.87	334,270,879	3.875	2019/06/13	1.26

ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000	49.01	330,830,045	47.18	318,531,713	7.000	2019/10/23	1.20
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	33,600,000	950.22	319,275,313	912.75	306,687,356	8.000	2018/12/21	1.15
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	9,000,000	3,419.70	307,773,201	3,395.24	305,571,818	5.500	2015/04/25	1.15
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,437.10	304,183,699	3,402.03	301,080,393	4.750	2016/10/25	1.13
マレーシア	国債証券	MGS 3.172% 07/15/16	9,550,000	3,084.97	294,615,430	3,076.37	293,793,845	3.172	2016/07/15	1.10
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	9,600,000	3,063.93	294,138,190	3,048.96	292,700,252	3.314	2017/10/31	1.10
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	33,400,000	909.02	303,613,885	870.08	290,608,799	7.250	2020/01/15	1.09
トルコ	国債証券	TURKGB 10.5% 01/15/20	6,200,000	4,903.03	303,988,160	4,605.37	285,533,130	10.500	2020/01/15	1.07
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.625% 05/15/33	43,500,000,000	0.67	292,228,087	0.63	275,694,843	6.625	2033/05/15	1.04
トルコ	国債証券	TURKGB 8.3% 06/20/18	6,500,000	4,227.65	274,797,366	4,182.80	271,882,611	8.300	2018/06/20	1.02
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000	3,639.73	274,799,676	3,563.70	269,060,007	5.750	2022/09/23	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	28,000,000	960.13	268,836,419	928.44	259,965,249	8.250	2017/09/15	0.98
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	81,500,000	304.08	247,828,228	303.10	247,026,663	3.625	2023/06/16	0.93
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	24,000,000	1,035.00	248,400,186	1,004.22	241,014,734	13.500	2015/09/15	0.91
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	5,500,000	4,584.77	252,162,632	4,364.33	240,038,626	9.000	2017/03/08	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 3.75% 04/25/18	7,300,000	3,321.85	242,495,278	3,278.90	239,360,106	3.750	2018/04/25	0.90
マレーシア	国債証券	MGS 3.741% 02/27/15	7,700,000	3,112.28	239,645,610	3,104.59	239,053,511	3.741	2015/02/27	0.90

(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	97.25
合計	97.25

(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	20,390,499,050	98.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		260,712,647	1.26
合計(純資産総額)		20,651,211,697	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	3,743	592,108.04	2,216,260,417	583,000.00	2,182,169,000	10.57
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,214	541,058.31	1,738,961,414	529,000.00	1,700,206,000	8.23
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	6,243	196,242.76	1,225,143,593	205,700.00	1,284,185,100	6.22
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,438	145,379.49	935,953,163	152,900.00	984,370,200	4.77
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	846	938,232.61	793,744,793	1,035,000.00	875,610,000	4.24
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,231	329,864.35	735,927,381	351,000.00	783,081,000	3.79
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3,354	219,299.11	735,529,238	217,200.00	728,488,800	3.53
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,341	476,407.74	638,862,788	527,000.00	706,707,000	3.42
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,564	121,487.68	554,469,799	136,000.00	620,704,000	3.01
日本	投資証券	G L P 投資法人	5,674	98,642.28	559,696,302	106,300.00	603,146,200	2.92
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	714	858,991.65	613,320,040	831,000.00	593,334,000	2.87
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	679	793,116.39	538,526,035	855,000.00	580,545,000	2.81
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,070	421,767.98	451,291,747	487,500.00	521,625,000	2.53
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,245	202,309.99	454,185,942	227,300.00	510,288,500	2.47
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,746	132,084.04	494,786,836	135,900.00	509,081,400	2.47
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,504	100,428.73	452,331,025	108,200.00	487,332,800	2.36
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	899	443,284.48	398,512,755	511,000.00	459,389,000	2.22
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,008	482,718.25	486,579,999	452,500.00	456,120,000	2.21
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	624	692,789.51	432,300,656	710,000.00	443,040,000	2.15
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,011	407,754.90	412,240,207	427,500.00	432,202,500	2.09

日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	3,258	120,750.17	393,404,065	122,200.00	398,127,600	1.93
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	423	882,120.66	373,137,041	846,000.00	357,858,000	1.73
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,090	45,491.02	322,531,390	49,500.00	350,955,000	1.70
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,569	143,687.68	369,133,667	132,300.00	339,878,700	1.65
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	2,644	118,989.67	314,608,690	123,300.00	326,005,200	1.58
日本	投資証券	福岡リート投資法人	373	785,063.57	292,828,715	860,000.00	320,780,000	1.55
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	331	749,522.28	248,091,877	861,000.00	284,991,000	1.38
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	3,990	64,961.47	259,196,288	64,000.00	255,360,000	1.24
日本	投資証券	プレミアム投資法人	592	399,426.51	236,460,494	398,000.00	235,616,000	1.14
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	435	557,820.92	242,652,101	534,000.00	232,290,000	1.12

(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	98.74
合計	98.74

(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

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	174	248,802,100	259,521,000	259,521,000	1.26

(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	17,009,654,260	67.52
	オーストラリア	2,355,815,591	9.35
	イギリス	1,736,853,187	6.89
	フランス	1,304,761,268	5.18
	シンガポール	944,435,057	3.75

カナダ	705,103,343	2.80
香港	428,898,544	1.70
オランダ	293,549,594	1.17
ベルギー	147,183,742	0.58
ニュージーランド	87,955,349	0.35
ドイツ	43,388,388	0.17
イタリア	24,103,602	0.10
アイルランド	16,314,480	0.06
マン島	9,285,738	0.04
ギリシャ	7,728,462	0.03
イスラエル	6,497,730	0.03
小計	25,121,528,335	99.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	69,175,202	0.27
合計(純資産総額)	25,190,703,537	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	98,180	15,750.63	1,546,397,665	15,732.43	1,544,610,664	6.13
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	30,780	26,574.92	817,976,187	24,883.06	765,900,833	3.04
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	45,820	16,393.93	751,170,001	16,129.47	739,052,617	2.93
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	157,090	3,991.60	627,041,711	3,991.99	627,102,745	2.49
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	105,560	5,329.56	562,588,812	5,671.70	598,704,694	2.38
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	92,620	6,310.25	584,455,688	6,359.83	589,047,806	2.34
アメリカ	投資証券	HCP INC	144,820	4,060.28	588,010,699	4,000.22	579,312,642	2.30
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	612,600	978.29	599,302,109	921.31	564,397,875	2.24
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	48,540	10,349.72	502,375,794	11,108.87	539,225,035	2.14
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	91,650	6,164.90	565,013,562	5,868.16	537,817,138	2.13
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	55,250	9,085.85	501,993,366	9,399.34	519,313,910	2.06
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	38,660	12,523.82	484,171,098	12,565.37	485,777,498	1.93
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	240,360	1,917.23	460,826,595	1,885.42	453,180,464	1.80
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	247,900	1,658.77	411,209,465	1,756.18	435,359,005	1.73
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	317,400	1,048.18	332,694,638	1,136.00	360,568,812	1.43
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	171,180	2,102.77	359,953,024	2,056.17	351,975,420	1.40
香港	投資証券	LINK REIT	725,000	500.85	363,117,705	464.72	336,924,900	1.34
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	30,040	9,407.26	282,594,386	9,642.09	289,648,575	1.15
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	129,770	2,155.77	279,755,057	2,143.60	278,175,283	1.10
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	65,310	4,106.04	268,166,121	4,193.60	273,884,159	1.09

オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	956,400	275.07	263,077,065	275.03	263,041,656	1.04
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	44,540	5,827.88	259,574,144	5,773.53	257,153,106	1.02
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	736,500	363.89	268,007,602	334.03	246,015,746	0.98
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	20,440	10,805.10	220,856,263	11,147.96	227,864,441	0.90
アメリカ	投資証券	COLE REAL ESTATE INVESTMENT	132,800	1,393.80	185,097,632	1,566.55	208,038,875	0.83
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	40,380	4,744.47	191,581,990	5,137.85	207,466,665	0.82
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	483,730	454.97	220,083,708	422.98	204,612,081	0.81
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	223,300	878.81	196,239,287	897.60	200,435,687	0.80
アメリカ	投資証券	UDR INC	78,260	2,442.30	191,135,057	2,509.78	196,415,695	0.78
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	12,040	15,916.64	191,636,440	16,084.21	193,653,987	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。

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	99.73
合計	99.73

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該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	8,101,513,320	80.62
	ジャージー	1,547,832,651	15.40
	アメリカ	279,577,800	2.78
	小計	9,928,923,771	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		119,753,425	1.19
合計(純資産総額)		10,048,677,196	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
ジャー ジー	社債 券	ETFS ALL COMMODITIES	115,310,000	1,394.06	1,607,496,103	1,342.32	1,547,832,651	0.0		15.40
イギリス	社債 券	CS USD COM 005 08/11/14	14,700,000	10,519.74	1,546,402,383	10,287.02	1,512,193,204	0.0	2014/08/11	15.05
イギリス	社債 券	UBS USD COM 004 08/11/14	13,000,000	10,409.82	1,353,277,590	10,288.05	1,337,447,436	0.0	2014/08/11	13.31
イギリス	社債 券	BAR USD COM 024 07/25/14	10,000,000	10,312.17	1,031,217,787	10,039.85	1,003,985,602	0.0	2014/07/25	9.99
イギリス	社債 券	CS USD COM 006 10/24/14	9,500,000	10,291.84	977,725,444	10,152.28	964,466,790	0.0	2014/10/24	9.60
イギリス	社債 券	UBS USD COM 003 05/16/14	9,200,000	9,941.97	914,661,978	9,698.66	892,277,584	0.0	2014/05/16	8.88
イギリス	社債 券	BAR USD COM 025 08/29/14	8,500,000	10,176.48	865,001,170	9,966.20	847,127,702	0.0	2014/08/29	8.43
イギリス	社債 券	BAR USD COM 022 04/25/14	5,000,000	10,256.09	512,804,621	9,847.40	492,370,248	0.0	2014/04/25	4.90
イギリス	社債 券	BAR USD COM 023 06/27/14	5,000,000	10,194.66	509,733,016	9,768.30	488,415,281	0.0	2014/06/27	4.86
イギリス	社債 券	BAR USD COM 026 11/28/14	3,000,000	10,281.88	308,456,568	10,293.50	308,805,263	0.0	2014/11/28	3.07
アメリカ	社債 券	IPATH DOW COMM 06/12/36	7,390,000	3,990.96	294,932,535	3,783.19	279,577,800	0.0	2036/06/12	2.78
イギリス	社債 券	UBS USD COM 005 11/05/14	2,500,000	10,234.36	255,859,107	10,176.96	254,424,210	0.0	2014/11/05	2.53

(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	98.81
合計	98.81

(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	4,072,799,000	92.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		350,050,759	7.91
合計(純資産総額)		4,422,849,759	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
ケイマン	社債券	QUART X 0% 0 3 / 3 1 / 2 2	4,780,000,000	86.93	4,155,503,800	85.20	4,072,799,000	0.0	2022/03/31	92.09

(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、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	92.09
合計	92.09

(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：2014年1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	15.61億円

※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	-	-	-	-	-
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	10.4%
FOFシグマFRM ダイバーシファイディングファンド(適格機関投資家専用)	9.7%
外国債券インデックス マザーファンド	9.2%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.8%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D(ADR)	7.4%
外国株式インデックス マザーファンド	7.2%
ヘッジファンド/リターンターゲットファンド/為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6.9%
FRM シグマリリング マザーファンド	5.4%
TCAファンド(適格機関投資家専用)	5.4%
J-REITインデックス マザーファンド	4.1%

年別収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2014年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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日から運用を開始していますが、基準日（平成25年11月29日）現在、該当事項はありません。

（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26年1月31日）現在、該当事項はありません。

（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26年1月31日現在)

資産総額	1,596,614,328 円
負債総額	35,844,712 円
純資産総額(-)	1,560,769,616 円
発行済口数	1,548,102,178 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	31,640,808,630 円
負債総額	643,693,723 円
純資産総額(-)	30,997,114,907 円
発行済口数	22,330,044,850 口
1口当たり純資産額(/)	1.3881 円
1万口当たり純資産額	13,881 円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	247,346,552,971 円
負債総額	2,103,408,124 円
純資産総額(-)	245,243,144,847 円
発行済口数	190,808,636,440 口
1口当たり純資産額(/)	1.2853 円
1万口当たり純資産額	12,853 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	159,836,603,310 円
負債総額	304,465,130 円
純資産総額(-)	159,532,138,180 円
発行済口数	100,497,898,048 口
1口当たり純資産額(/)	1.5874 円
1万口当たり純資産額	15,874 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	220,943,820,892 円
負債総額	559,586,747 円
純資産総額(-)	220,384,234,145 円
発行済口数	89,849,920,986 口
1口当たり純資産額(/)	2.4528 円
1万口当たり純資産額	24,528 円

新興国株式インデックス マザーファンド

資産総額	20,837,144,983 円
負債総額	23,306,484 円
純資産総額(-)	20,813,838,499 円
発行済口数	10,060,182,400 口
1口当たり純資産額(/)	2.0689 円
1万口当たり純資産額	20,689 円

新興国債券インデックス マザーファンド

資産総額	26,880,933,881 円
負債総額	291,382,864 円
純資産総額(-)	26,589,551,017 円
発行済口数	17,198,758,878 口

1口当たり純資産額(/)	1.5460 円
1万口当たり純資産額	15,460 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	20,916,024,037 円
負債総額	264,812,340 円
純資産総額(-)	20,651,211,697 円
発行済口数	17,358,905,156 口
1口当たり純資産額(/)	1.1897 円
1万口当たり純資産額	11,897 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	25,534,234,484 円
負債総額	343,530,947 円
純資産総額(-)	25,190,703,537 円
発行済口数	21,720,416,912 口
1口当たり純資産額(/)	1.1598 円
1万口当たり純資産額	11,598 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	10,354,690,202 円
負債総額	306,013,006 円
純資産総額(-)	10,048,677,196 円
発行済口数	22,145,928,205 口
1口当たり純資産額(/)	0.4537 円
1万口当たり純資産額	4,537 円

FRM シグマ リンク マザーファンド

資産総額	4,423,649,759 円
負債総額	800,000 円
純資産総額(-)	4,422,849,759 円
発行済口数	5,123,964,171 口
1口当たり純資産額(/)	0.8632 円
1万口当たり純資産額	8,632 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

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

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 資本金の額（平成25年11月29日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成26年2月3日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1) 資本金の額（平成26年1月31日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成26年4月11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、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11月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	343	4,568,647
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	343	4,568,647

<訂正後>

（前略）

平成26年1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>363</u>	<u>4,662,865</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>363</u>	<u>4,662,865</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)定款の変更

委託会社は、平成25年4月1日に取締役の役位としての会長を削除しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成26年2月3日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

<訂正後>

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成26年4月11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。