

【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7月14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、平成26年2月3日付及び平成26年4月11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>

（前略）

「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。

<訂正後>

（前略）

「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。

なお、当初自己設定においては、3.15%（税込）となります。

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訂正します。

（注）下線部 _____ は訂正部分を示します。

(3) ファンドの仕組み

<訂正前>

（前略）

委託会社の概況

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）

<訂正後>

（前略）

委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成26年5月30日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成26年5月30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訂正します。

(注) 下線部_____は訂正部分を示します。

(2) 投資対象

< 訂正前 >

(前略)

- 投資対象ファンドの概要 -

(中略)

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。

(中略)

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）

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

- 投資対象ファンドの概要 -

(中略)

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」、「18」及び「20」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」、「18」及び「20」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7月14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)

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）

(中略)

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

投資顧問会社	BlueBay Asset Management LLP
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未滿の格付の債券等に投資することもあります。

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

(3)運用体制

<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）

<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7月14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）

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）

< 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。

当初自己設定においては、3.15%となります。

（後略）

(3) 信託報酬等

< 訂正前 >

（前略）

（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
-------	------

（中略）

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%）
--------------------------------------	-----------------------

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

（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
-------	------

（中略）

FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%

（後略）

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

（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）

<訂正後>

（前略）

上記は、平成26年5月30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5月30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	2,006,898,721	31.84
	ケイマン	240,640,765	3.82
	小計	2,247,539,486	35.65
投資証券	ルクセンブルク	437,681,147	6.94
親投資信託受益証券	日本	3,559,700,701	56.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		59,138,700	0.94
合計(純資産総額)		6,304,060,034	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	投資信託 受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイ ド リンクファンド(適格機関 投資家専用)	629,933,296	1.0109	636,850,862	1.0041	632,516,022	10.03
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	341,366,278	1.6075	548,757,886	1.6768	572,402,974	9.08
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	227,216,878	2.4830	564,193,552	2.5063	569,473,661	9.03
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	398,323,112	1.3854	551,861,256	1.3830	550,880,863	8.74
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	270,826,125	1.6476	446,228,146	1.7012	460,729,403	7.31
ルクセン ブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^A , H, JPY	244,241.712	1,777.55	434,151,970	1,792.00	437,681,147	6.94
日本	投資信託 受益証券	ヘッジファンド・リターン・ ターゲットファンド・為替 ヘッジあり(適格機関投資家 専用)	409,366,760	1.0445	427,623,250	1.0535	431,267,881	6.84
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	380,018,027	0.8572	325,780,005	0.8830	335,555,917	5.32
日本	投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家 専用)	337,836,415	0.9617	324,917,950	0.9749	329,356,720	5.22
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	209,888,982	1.1902	249,829,388	1.2586	264,166,272	4.19
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	204,954,107	1.2194	249,929,589	1.2876	263,898,908	4.19
ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDク ラス	234,314.1888	1,020.57	239,134,067	1,027.00	240,640,765	3.82
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)	224,552,016	1.0246	230,095,028	1.0431	234,230,207	3.72
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	178,650,199	1.2865	229,850,023	1.2912	230,673,136	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)	199,492,567	0.9252	184,576,058	0.9744	194,385,557	3.08
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	82,240,903	2.1530	177,065,475	2.2907	188,389,236	2.99
日本	投資信託 受益証券	FOFs用JPX日経インデックス 400・オープン(適格機関投資 家専用)	136,442,100	1.0041	137,005,029	1.0195	139,102,720	2.21
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	258,864,902	0.4755	123,115,426	0.4772	123,530,331	1.96
日本	投資信託 受益証券	FOFs用日本物価連動国債ファ ンド(適格機関投資家専用)	45,606,354	1.0009	45,650,000	1.0095	46,039,614	0.73

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、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	35.65
投資証券	6.94
親投資信託受益証券	56.47
合計	99.06

(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	
2月末日	2,925,300,451		10,128	
3月末日	4,089,769,022		10,144	
4月末日	5,022,325,769		10,194	
5月末日	6,304,060,034		10,302	

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1期中間計算期間(平成25年10月17日～平成26年 4月16日)	1.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期中間計算期間 (平成25年10月17日～平成26年 4月16日)	4,437,752,855	4,145,862	4,433,606,993

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

(参考情報)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	5,039,647,000	14.88
国債証券	日本	16,998,636,000	50.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,837,439,477	34.94
合計(純資産総額)		33,875,722,477	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	99.99	12,999,688,000	0.0	2014/06/20	38.37
日本	国債証券	第419回国庫短期証券		2,000,000,000	99.97	1,999,494,000	99.97	1,999,568,000	0.0	2014/12/22	5.90
日本	国債証券	第438回国庫短期証券		2,000,000,000	99.96	1,999,266,000	99.96	1,999,380,000	0.0	2015/03/20	5.90
日本	株式	日本水産	水産・農林業	1,615,000	286.73	463,076,802	321.00	518,415,000			1.53
日本	株式	昭和シェル石油	石油・石炭製品	315,500	1,026.49	323,860,448	1,098.00	346,419,000			1.02
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	96,200	3,416.52	328,669,435	3,444.00	331,312,800			0.98
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,800	6,005.58	329,105,899	6,042.00	331,101,600			0.98
日本	株式	三菱商事	卸売業	163,700	1,971.03	322,658,134	2,009.00	328,873,300			0.97
日本	株式	小田急電鉄	陸運業	354,000	931.40	329,716,444	915.00	323,910,000			0.96
日本	株式	クラレ	化学	265,200	1,231.89	326,698,999	1,221.00	323,809,200			0.96
日本	株式	花王	化学	80,300	4,113.36	330,303,536	4,023.00	323,046,900			0.95
日本	株式	サッポロホールディングス	食料品	756,000	429.91	325,013,418	427.00	322,812,000			0.95
日本	株式	三井物産	卸売業	207,500	1,551.97	322,035,590	1,542.00	319,965,000			0.94
日本	株式	北越紀州製紙	パルプ・紙	641,200	512.54	328,646,713	496.00	318,035,200			0.94
日本	株式	キッコーマン	食料品	154,000	2,165.80	333,533,928	2,045.00	314,930,000			0.93

日本	株式	京成電鉄	陸運業	327,000	898.59	293,839,256	941.00	307,707,000		0.91
日本	株式	清水建設	建設業	183,000	670.48	122,698,918	674.00	123,342,000		0.36
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	29,400	3,781.53	111,176,999	4,068.00	119,599,200		0.35
日本	株式	スズキ	輸送用機器	39,000	3,065.02	119,535,935	3,025.00	117,975,000		0.35
日本	株式	大平洋金属	鉄鋼	237,000	487.24	115,477,145	481.00	113,997,000		0.34
日本	株式	住友金属鉱山	非鉄金属	74,000	1,579.32	116,870,024	1,539.00	113,886,000		0.34
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	204,600	212.41	43,459,086	198.00	40,510,800		0.12

(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 (%)
株式	14.88
国債証券	50.18
合計	65.06

(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	1.53
		建設業	0.36
		食料品	2.86
		パルプ・紙	0.94
		化学	1.91
		石油・石炭製品	1.02
		鉄鋼	0.34
		非鉄金属	0.34
		輸送用機器	0.35
		陸運業	1.86
		情報・通信業	0.98
		卸売業	1.92
		小売業	0.35
銀行業	0.12		
合計			14.88

(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	202,294,222,050	78.64
	ポーランド	200,968,000	0.08
	小計	202,495,190,050	78.72
地方債証券	日本	16,201,344,567	6.30
特殊債券	日本	22,218,166,218	8.64
	アメリカ	209,146,000	0.08
	スウェーデン	100,979,000	0.04
	韓国	100,270,000	0.04
	小計	22,628,561,218	8.80
社債券	日本	13,174,415,930	5.12
	オーストラリア	405,859,000	0.16
	オランダ	405,712,000	0.16
	アメリカ	307,293,000	0.12
	スウェーデン	102,660,000	0.04
	イギリス	101,117,000	0.04
	小計	14,497,056,930	5.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,407,220,386	0.55
合計(純資産総額)		257,229,373,151	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	100.62	3,904,172,400	100.64	3,904,948,400	0.3	2018/06/20	1.52
日本	国債証券	第117回利付国債 (5年)	3,560,000,000	100.11	3,564,088,300	100.14	3,565,055,200	0.2	2019/03/20	1.39
日本	国債証券	第116回利付国債 (5年)	3,120,000,000	100.15	3,124,909,600	100.18	3,125,616,000	0.2	2018/12/20	1.22
日本	国債証券	第332回利付国債 (10年)	3,000,000,000	100.49	3,014,970,000	100.45	3,013,590,000	0.6	2023/12/20	1.17
日本	国債証券	第105回利付国債 (5年)	2,910,000,000	100.28	2,918,380,800	100.30	2,918,817,300	0.2	2017/06/20	1.13
日本	国債証券	第333回利付国債 (10年)	2,750,000,000	100.30	2,758,288,400	100.27	2,757,645,000	0.6	2024/03/20	1.07
日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	2,710,000,000	100.92	2,735,121,700	100.92	2,735,121,700	0.6	2023/03/20	1.06
日本	国債証券	第97回利付国債 (5年)	2,700,000,000	100.64	2,717,388,000	100.64	2,717,361,000	0.4	2016/06/20	1.06
日本	国債証券	第99回利付国債 (5年)	2,600,000,000	100.70	2,618,458,000	100.71	2,618,486,000	0.4	2016/09/20	1.02
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	2,430,000,000	104.89	2,548,997,100	104.91	2,549,361,600	1.5	2017/12/20	0.99
日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	2,360,000,000	102.88	2,428,038,800	102.88	2,428,015,200	0.8	2022/09/20	0.94
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	2,340,000,000	102.55	2,399,716,800	102.55	2,399,716,800	0.8	2023/06/20	0.93
日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	2,240,000,000	102.48	2,295,641,600	102.43	2,294,611,200	0.8	2023/09/20	0.89
日本	国債証券	第102回利付国債 (5年)	2,280,000,000	100.52	2,291,878,800	100.52	2,291,878,800	0.3	2016/12/20	0.89
日本	国債証券	第106回利付国債 (5年)	2,280,000,000	100.27	2,286,361,200	100.29	2,286,726,000	0.2	2017/09/20	0.89
日本	国債証券	第296回利付国債 (10年)	2,100,000,000	105.76	2,221,149,000	105.78	2,221,548,000	1.5	2018/09/20	0.86
日本	国債証券	第318回利付国債 (10年)	2,110,000,000	104.66	2,208,442,400	104.66	2,208,389,300	1.0	2021/09/20	0.86
日本	国債証券	第288回利付国債 (10年)	2,090,000,000	105.23	2,199,307,000	105.24	2,199,578,700	1.7	2017/09/20	0.86
日本	国債証券	第103回利付国債 (5年)	2,090,000,000	100.57	2,101,933,900	100.57	2,101,933,900	0.3	2017/03/20	0.82
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	1,990,000,000	104.47	2,079,092,300	104.47	2,079,012,700	1.7	2017/03/20	0.81
日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	1,960,000,000	106.03	2,078,344,800	106.03	2,078,286,000	1.3	2019/12/20	0.81

日本	国債証券	第115回利付国債 (5年)	1,960,000,000	100.19	1,963,763,200	100.21	1,964,174,800	0.2	2018/09/20	0.76
日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	1,840,000,000	102.75	1,890,673,600	102.75	1,890,673,600	0.8	2022/12/20	0.74
日本	国債証券	第96回利付国債 (5年)	1,770,000,000	100.75	1,783,328,100	100.75	1,783,310,400	0.5	2016/03/20	0.69
日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	1,660,000,000	105.12	1,745,091,600	105.14	1,745,440,200	1.3	2018/12/20	0.68
日本	国債証券	第320回利付国債 (10年)	1,620,000,000	104.66	1,695,589,200	104.66	1,695,556,800	1.0	2021/12/20	0.66
日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	1,590,000,000	104.65	1,663,966,800	104.65	1,663,935,000	1.0	2020/09/20	0.65
日本	国債証券	第321回利付国債 (10年)	1,520,000,000	104.57	1,589,555,200	104.57	1,589,524,800	1.0	2022/03/20	0.62
日本	国債証券	第147回利付国債 (20年)	1,470,000,000	103.22	1,517,451,600	103.06	1,515,114,300	1.6	2033/12/20	0.59
日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	1,390,000,000	106.35	1,478,265,000	106.34	1,478,223,300	1.4	2019/09/20	0.57

(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	78.72
地方債証券	6.30
特殊債券	8.80
社債券	5.64
合計	99.45

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	長期国債先物	大阪取引所	買建	円	3	436,380,972	436,500,000	436,500,000	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	89,563,408,927	53.05
	イギリス	15,009,024,952	8.89
	スイス	7,299,527,177	4.32
	カナダ	7,280,425,830	4.31
	フランス	6,936,416,903	4.11
	ドイツ	6,707,694,826	3.97
	オーストラリア	5,219,758,943	3.09
	オランダ	2,682,756,587	1.59
	スペイン	2,594,171,181	1.54
	スウェーデン	2,229,517,906	1.32
	イタリア	1,753,570,782	1.04
	香港	1,675,816,882	0.99
	アイルランド	1,458,910,192	0.86
	デンマーク	1,054,644,228	0.62
	シンガポール	1,037,304,261	0.61
	ジャージー	896,474,471	0.53
	ベルギー	880,752,663	0.52
	キュラソー	723,240,362	0.43
	フィンランド	630,217,561	0.37
	バミューダ	618,118,570	0.37
	ノルウェー	538,379,109	0.32
	イスラエル	371,062,633	0.22
	ルクセンブルク	301,944,750	0.18
	オーストリア	195,936,673	0.12
	ケイマン	185,587,684	0.11
	ポルトガル	117,910,615	0.07
	ニュージーランド	100,684,990	0.06
	英ヴァージン諸島	92,864,348	0.06
	パナマ	80,775,128	0.05
	リベリア	48,478,858	0.03
	ガーンジー	39,744,622	0.02
	マン島	34,019,156	0.02
モーリシャス	13,475,615	0.01	
小計	158,372,617,385	93.80	
投資信託受益証券	オーストラリア	87,796,800	0.05
	シンガポール	19,594,965	0.01
	香港	14,588,808	0.01
	小計	121,980,573	0.07
投資証券	アメリカ	2,453,296,917	1.45

オーストラリア	382,340,860	0.23
フランス	227,303,393	0.13
イギリス	222,806,416	0.13
香港	67,516,500	0.04
シンガポール	55,484,105	0.03
カナダ	36,149,514	0.02
オランダ	17,389,529	0.01
小計	3,462,287,234	2.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	6,875,378,145	4.07
合計(純資産総額)	168,832,263,337	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	46,945	63,436.85	2,978,043,233	64,592.73	3,032,305,747	1.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	226,856	10,273.75	2,330,664,007	10,295.10	2,335,507,065	1.38
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	413,638	4,067.41	1,682,438,067	4,100.96	1,696,314,712	1.00
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	148,510	10,196.49	1,514,281,917	10,243.26	1,521,226,780	0.90
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	526,964	2,710.25	1,428,207,131	2,718.38	1,432,492,824	0.85
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	262,421	5,127.73	1,345,624,139	5,110.44	1,341,088,927	0.79
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	168,891	7,923.23	1,338,163,335	7,923.23	1,338,163,335	0.79
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	100,148	12,455.38	1,247,381,716	12,435.05	1,245,345,507	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	142,341	8,142.96	1,159,077,923	8,173.46	1,163,419,039	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	198,797	5,637.04	1,120,628,032	5,664.49	1,126,084,652	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	220,837	5,056.56	1,116,677,395	5,054.53	1,116,228,389	0.66
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,816	30,050.53	1,106,340,349	30,050.53	1,106,340,349	0.66
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	120,620	9,152.21	1,103,940,293	9,152.21	1,103,940,293	0.65
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,010,293	1,070.08	1,081,094,776	1,067.86	1,078,861,109	0.64

アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	335,083	3,010.15	1,008,650,963	3,009.13	1,008,310,318	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	277,712	3,592.66	997,726,015	3,597.74	999,137,625	0.59
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	51,989	18,611.91	967,614,734	18,681.04	971,208,671	0.58
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	154,372	5,733.62	885,111,004	5,865.78	905,512,498	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	208,164	4,125.36	858,752,021	4,133.49	860,444,978	0.51
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	15,038	57,100.38	858,675,646	56,937.73	856,229,625	0.51
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,759	57,991.94	855,903,145	58,003.12	856,068,189	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	555,179	1,539.13	854,493,986	1,540.14	855,058,381	0.51
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	967,994	860.72	833,175,928	859.87	832,352,794	0.49
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	204,745	3,983.88	815,681,506	4,012.80	821,601,072	0.49
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	189,918	4,226.00	802,594,645	4,290.05	814,758,095	0.48
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	112,577	7,165.49	806,669,818	7,154.42	805,423,995	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	159,402	4,810.55	766,811,482	4,806.48	766,163,290	0.45
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,805	12,957.58	761,970,703	13,023.66	765,856,479	0.45
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	83,342	8,880.00	740,077,043	8,983.69	748,719,042	0.44
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	87,454	8,498.77	743,251,956	8,542.48	747,074,902	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	93.80
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.05
合計	95.93

(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	10.17
		素材	5.47
		資本財	7.26
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.76
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	1.62
		メディア	2.87
		小売	2.82
		食品・生活必需品小売り	2.05
		食品・飲料・タバコ	5.96
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		ヘルスケア機器・サービス	2.88
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.72
		銀行	9.39
		各種金融	3.83
		保険	4.06
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	6.39
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.97		
電気通信サービス	3.23		
公益事業	3.20		
半導体・半導体製造装置	1.45		
合計			93.80

(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	89	42,486,193	42,673,275	4,338,165,136	2.57
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	24	4,012,405.50	3,999,840	375,144,993	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	35	3,050,600	3,050,600	345,541,462	0.20
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	203	6,571,477.50	6,575,170	909,543,266	0.54
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	28	3,875,557	3,871,700	366,766,141	0.22
	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	72	4,921,488.75	4,939,200	840,009,744	0.50

(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	83,057,823,665	37.30
	フランス	22,632,584,832	10.16
	イタリア	22,529,967,162	10.12
	ドイツ	18,766,748,505	8.43
	イギリス	17,145,726,972	7.70
	スペイン	12,207,304,221	5.48
	ベルギー	6,027,569,311	2.71
	オランダ	6,006,702,436	2.70
	カナダ	5,079,173,728	2.28
	オーストリア	3,804,001,434	1.71
	オーストラリア	3,526,798,864	1.58
	メキシコ	2,418,645,359	1.09
	アイルランド	1,856,287,580	0.83
	デンマーク	1,782,262,226	0.80
	フィンランド	1,489,343,944	0.67
	ポーランド	1,451,374,989	0.65
	スウェーデン	1,239,328,588	0.56
	マレーシア	1,135,698,443	0.51
	南アフリカ	1,096,852,135	0.49
	スイス	871,751,828	0.39
ノルウェー	803,640,781	0.36	
シンガポール	801,282,052	0.36	
	小計	215,730,869,055	96.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,943,910,908	3.12
合計(純資産総額)		222,674,779,963	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,345.09	2,875,936,786	10,343.11	2,875,384,810	1.375	2015/11/30	1.29
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/30/15	22,000,000	10,195.38	2,242,984,951	10,194.79	2,242,853,891	0.375	2015/06/30	1.01
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	10,194.79	2,059,347,663	10,193.99	2,059,187,242	0.375	2015/06/15	0.92
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,153.09	1,827,556,912	10,150.71	1,827,128,025	0.250	2016/04/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/15/17	16,000,000	10,213.25	1,634,120,966	10,207.69	1,633,231,433	0.875	2017/04/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,176.92	1,618,130,361	10,175.33	1,617,877,800	0.250	2015/10/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,359.59	1,553,938,624	10,358.20	1,553,730,140	1.750	2015/07/31	0.70
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,180.49	1,425,269,227	10,180.09	1,425,213,635	0.250	2015/07/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,212.66	1,358,283,821	10,211.27	1,358,098,978	0.625	2016/07/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,360.58	1,357,236,457	10,359.78	1,357,132,408	1.875	2015/06/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,673.70	1,334,213,046	10,671.71	1,333,964,843	4.250	2015/08/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	9,922.17	1,240,271,861	9,907.48	1,238,435,220	2.000	2023/02/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	10,203.12	1,224,375,562	10,198.36	1,223,803,725	0.750	2017/01/15	0.55
フランス	国債証券	BTNS 2.25% 02/25/16	8,000,000	14,344.75	1,147,580,146	14,342.19	1,147,375,418	2.250	2016/02/25	0.52
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	7,150,000	15,958.92	1,141,063,109	15,949.44	1,140,385,603	3.500	2020/04/25	0.51
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,284.65	1,105,896,393	11,277.90	1,105,234,812	4.500	2017/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	9,900.92	1,089,102,242	9,891.20	1,088,032,034	1.250	2020/02/29	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,463.83	1,077,774,704	10,461.25	1,077,508,835	2.000	2016/01/31	0.48
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	16,285.38	1,074,835,304	16,273.41	1,074,045,578	4.250	2019/04/25	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	10,815.07	1,027,432,154	10,809.51	1,026,903,994	3.000	2017/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	10,231.92	1,023,192,020	10,227.15	1,022,715,489	0.875	2017/01/31	0.46

アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	10,000,000	10,207.89	1,020,789,500	10,198.16	1,019,816,583	1.500	2019/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/28/19	10,000,000	10,199.95	1,019,995,281	10,191.01	1,019,101,791	1.500	2019/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	10,038.32	1,013,871,266	10,031.57	1,013,189,421	0.750	2018/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/31/17	10,000,000	10,068.70	1,006,870,822	10,060.96	1,006,096,458	0.750	2017/12/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	10,200,000	9,676.56	987,009,395	9,663.45	985,672,728	1.750	2023/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/31/19	10,000,000	9,861.61	986,161,561	9,853.07	985,307,780	1.125	2019/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/18	9,400,000	10,118.74	951,161,931	10,110.60	950,396,703	1.250	2018/11/30	0.43
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	5,800,000	16,303.57	945,607,280	16,288.21	944,716,711	3.750	2021/04/25	0.42
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	5,100,000	18,474.17	942,183,128	18,440.84	940,482,914	6.500	2027/11/01	0.42

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.88
合計	96.88

(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	53	6,354,293.79	6,350,062.50	645,547,353	0.29
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	29	3,645,039.77	3,643,125	370,360,087	0.17
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	18	2,481,668.25	2,478,375	251,951,602	0.11
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	35	3,872,859	3,872,400	535,669,092	0.24
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	40	5,075,208	5,073,200	701,775,756	0.32
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	55	8,086,240	8,081,150	1,117,865,479	0.50

(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	3,921,670,216	15.47
	台湾	2,905,167,457	11.46
	ブラジル	2,590,905,999	10.22
	中国	2,334,605,844	9.21
	南アフリカ	1,882,377,929	7.42
	インド	1,711,771,968	6.75
	ロシア	1,299,334,149	5.12
	メキシコ	1,223,049,378	4.82
	ケイマン	1,005,146,908	3.96
	香港	977,216,649	3.85
	マレーシア	925,720,570	3.65
	インドネシア	650,980,124	2.57
	タイ	525,886,793	2.07
	トルコ	438,462,834	1.73
	ポーランド	414,854,250	1.64
	チリ	384,494,525	1.52
	バミューダ	251,863,872	0.99
	フィリピン	235,819,456	0.93
	コロンビア	205,972,358	0.81
	ギリシャ	122,690,057	0.48
	チェコ	66,566,010	0.26
	ハンガリー	59,736,272	0.24
	エジプト	50,166,703	0.20
	アメリカ	28,778,795	0.11
ペルー	17,899,479	0.07	
ルクセンブルク	2,927,802	0.01	
小計		24,234,066,397	95.58
投資信託受益証券	アメリカ	264,011,020	1.04
	ブラジル	68,663,940	0.27
	南アフリカ	19,088,620	0.08
	メキシコ	9,303,101	0.04
	小計		361,066,681
投資証券	メキシコ	25,892,016	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		733,836,166	2.89
合計(純資産総額)		25,354,861,260	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	6,683	139,839.63	934,548,251	145,854.00	974,742,282	3.84
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体 製造装置	1,487,389	362.01	538,453,748	413.57	615,154,342	2.43
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・ サービス	310,000	1,100.92	341,287,514	1,439.47	446,238,180	1.76
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービ ス	365,000	1,045.54	381,625,234	998.32	364,389,172	1.44
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	4,331,620	76.55	331,627,636	74.46	322,553,216	1.27
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	356,509	900.45	321,019,122	848.65	302,554,100	1.19
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,425,515	67.72	299,722,594	65.81	291,252,878	1.15
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	23,928	9,327.91	223,198,356	11,514.62	275,522,040	1.09
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	150,190	1,465.82	220,152,625	1,634.62	245,504,779	0.97
南アフリ カ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービ ス	102,339	1,951.25	199,689,516	2,205.57	225,716,595	0.89
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車 部品	9,393	24,664.96	231,678,033	22,977.00	215,822,961	0.85
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービ ス	2,105,340	108.98	229,448,694	100.93	212,495,334	0.84
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,477,200	46.14	206,591,344	47.45	212,479,853	0.84
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	668,352	254.90	170,365,103	316.96	211,844,191	0.84
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タ バコ	281,500	789.73	222,309,403	737.40	207,580,633	0.82
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	251,340	870.18	218,711,529	789.91	198,537,990	0.78
南アフリ カ	株式	SASOL LTD	エネルギー	33,302	5,012.23	166,917,517	5,827.80	194,077,562	0.77
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,066,000	196.06	209,003,825	178.03	189,784,030	0.75
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA- PREF	銀行	127,400	1,391.26	177,246,932	1,469.33	187,193,763	0.74
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	31,221	6,350.97	198,283,882	5,794.61	180,913,831	0.71
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	169,621	1,240.31	210,383,874	1,038.45	176,144,097	0.69
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,266,000	112.23	142,084,951	120.87	153,026,737	0.60

台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体 製造装置	84,804	1,454.52	123,349,723	1,688.21	143,167,808	0.56
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	76,239	1,524.91	116,258,230	1,867.97	142,412,698	0.56
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,531,400	83.02	127,138,935	92.68	141,941,943	0.56
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・ サービス	27,461	5,885.52	161,622,375	5,088.62	139,738,868	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS- PFD	半導体・半導体 製造装置	1,230	98,747.84	121,459,851	113,486.40	139,588,272	0.55
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	88,072	1,418.03	124,889,391	1,560.60	137,445,691	0.54
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	111,615	1,487.42	166,018,659	1,216.38	135,766,521	0.54
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体 製造装置	31,890	3,278.05	104,537,142	4,255.73	135,715,548	0.54

(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	95.58
投資信託受益証券	1.42
投資証券	0.10
合計	97.11

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	10.41
		素材	8.53
		資本財	4.66
		商業・専門サービス	0.11
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	3.60
		耐久消費財・アパレル	0.97
		消費者サービス	0.85
		メディア	1.78
		小売	1.60
		食品・生活必需品小売り	2.03
		食品・飲料・タバコ	4.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.03
		ヘルスケア機器・サービス	0.60
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.06
		銀行	18.20
		各種金融	2.36
		保険	3.11
		不動産	1.70
		ソフトウェア・サービス	4.13
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.53		
電気通信サービス	6.72		
公益事業	3.34		
半導体・半導体製造装置	8.84		
合計			95.58

(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	157	8,009,239	8,159,290	829,473,421	3.27

(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	南アフリカ	3,566,830,592	9.89
	メキシコ	3,554,399,070	9.85
	マレーシア	3,547,584,078	9.84
	ポーランド	3,538,366,193	9.81
	トルコ	3,500,858,530	9.71
	ブラジル	3,497,478,510	9.70
	ロシア	3,430,147,555	9.51
	インドネシア	2,848,487,123	7.90
	タイ	2,581,697,788	7.16
	ハンガリー	2,059,938,395	5.71
	コロンビア	1,477,449,066	4.10
	ナイジェリア	611,724,454	1.70
	ペルー	608,841,312	1.69
	フィリピン	167,708,217	0.46
	チリ	38,209,538	0.11
	小計	35,029,720,421	97.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,040,472,916	2.88
合計(純資産総額)		36,070,193,337	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	RUSS1A 7.85% 03/10/18	420,000,000	297.74	1,250,522,385	290.05	1,218,210,462	7.850	2018/03/10	3.38
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	305,500,000	297.22	908,036,916	283.47	866,020,004	7.600	2021/04/14	2.40
ロシア	国債証券	RFLB 7% 06/03/15	248,100,000	297.92	739,140,735	292.59	725,938,342	7.000	2015/06/03	2.01
コロン ビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	11,050,000,000	6.01	664,538,081	5.85	647,125,293	12.000	2015/10/22	1.79
南アフ リカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	54,600,000	1,140.31	622,614,717	1,154.49	630,355,075	10.500	2026/12/21	1.75
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	217,500,000	302.99	659,017,287	285.04	619,978,747	8.150	2027/02/03	1.72
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	12,500,000	4,901.30	612,663,713	4,937.87	617,234,000	9.000	2017/03/08	1.71
コロン ビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	9,180,000,000	6.05	555,459,968	6.09	559,263,042	7.750	2021/04/14	1.55
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	176,000,000	312.45	549,926,833	317.34	558,522,536	3.250	2017/06/16	1.55
ブラジ ル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	15,400,000	3,602.61	554,802,457	3,622.46	557,860,309	0.000	2016/01/01	1.55
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	12,200,000	4,291.95	523,618,102	4,327.83	527,995,869	7.100	2023/03/08	1.46
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	146,000,000	316.92	462,717,788	321.19	468,943,386	3.875	2019/06/13	1.30
ブラジ ル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	4,816.05	457,525,414	4,802.99	456,284,831	12.500	2016/01/05	1.26
南アフ リカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	45,500,000	959.37	436,515,477	958.81	436,262,203	7.250	2020/01/15	1.21
ブラジ ル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000	4,327.86	411,147,157	4,402.52	418,240,025	10.000	2017/01/01	1.16
トルコ	国債証券	TURKGB 8.3% 06/20/18	8,500,000	4,562.39	387,803,190	4,822.67	409,927,074	8.300	2018/06/20	1.14
ブラジ ル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000	3,936.85	403,527,213	3,956.83	405,575,554	0.000	2015/04/01	1.12
インド ネシア	国債証券	INDOGB 6.625% 05/15/33	56,250,000,000	0.69	393,237,020	0.71	404,043,750	6.625	2033/05/15	1.12
南アフ リカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	40,000,000	1,013.84	405,537,608	1,006.44	402,578,712	8.250	2017/09/15	1.12
南アフ リカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	39,600,000	1,006.71	398,658,196	998.50	395,407,492	8.000	2018/12/21	1.10
インド ネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	40,000,000,000	0.88	353,984,400	0.90	360,360,000	8.375	2024/03/15	1.00

ブラジル	国債証券	BRAZIL 10.25% 01/10/28	7,100,000	4,692.58	333,173,714	4,887.74	347,029,766	10.250	2028/01/10	0.96
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	10,800,000	3,144.06	339,558,930	3,132.20	338,278,485	3.314	2017/10/31	0.94
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	35,400,000	929.92	329,192,197	937.21	331,772,932	8.750	2048/02/28	0.92
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 10/25/19	8,900,000	3,652.05	325,032,653	3,715.33	330,664,768	5.500	2019/10/25	0.92
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000	48.41	326,808,272	48.98	330,624,181	7.000	2019/10/23	0.92
トルコ	国債証券	TURKGB 10.5% 01/15/20	6,200,000	5,267.62	326,592,751	5,264.50	326,399,549	10.500	2020/01/15	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	9,350,000	3,260.74	304,879,569	3,442.76	321,898,531	4.000	2023/10/25	0.89
トルコ	国債証券	TURKGB 6.3% 02/14/18	7,050,000	4,431.47	312,419,092	4,530.72	319,416,198	6.300	2018/02/14	0.89
ハンガリー	国債証券	HGB 6.0% 11/24/23	629,000,000	47.58	299,292,552	50.63	318,472,575	6.000	2023/11/24	0.88

(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	97.12
合計	97.12

(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	26,061,032,540	98.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		338,992,138	1.28
合計(純資産総額)		26,400,024,678	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	4,477	587,164.28	2,628,734,524	596,000.00	2,668,292,000	10.11
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,968	540,211.54	2,143,559,412	595,000.00	2,360,960,000	8.94
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	7,319	197,372.66	1,444,570,561	223,900.00	1,638,724,100	6.21
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,547	146,451.12	1,105,266,609	162,900.00	1,229,406,300	4.66
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,959	191,596.31	950,126,127	222,800.00	1,104,865,200	4.19
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	4,122	219,790.12	905,974,911	251,200.00	1,035,446,400	3.92
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,616	332,582.55	870,035,964	365,500.00	956,148,000	3.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,573	485,552.41	763,773,956	552,000.00	868,296,000	3.29
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	6,235	122,874.88	766,124,939	135,900.00	847,336,500	3.21
日本	投資証券	G L P 投資法人	6,652	99,507.16	661,921,677	107,800.00	717,085,600	2.72
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	796	799,630.74	636,506,074	854,000.00	679,784,000	2.57
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	4,186	169,889.40	711,157,048	160,800.00	673,108,800	2.55
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,255	434,514.59	545,315,816	516,000.00	647,580,000	2.45
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5,280	101,476.72	535,797,134	116,100.00	613,008,000	2.32
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	4,391	132,599.92	582,246,276	137,700.00	604,640,700	2.29
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,632	206,001.32	542,195,481	227,300.00	598,253,600	2.27
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	1,122	457,186.82	512,963,618	532,000.00	596,904,000	2.26
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,181	475,944.00	562,089,865	474,500.00	560,384,500	2.12
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,463	347,608.39	508,551,079	371,000.00	542,773,000	2.06
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	3,846	122,346.61	470,545,077	138,500.00	532,671,000	2.02
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,186	409,632.92	485,824,645	445,000.00	527,770,000	2.00
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	525	875,312.64	459,539,139	908,000.00	476,700,000	1.81
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	3,100	120,212.10	372,657,524	138,900.00	430,590,000	1.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	931	387,037.54	360,331,957	437,000.00	406,847,000	1.54
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,312	45,820.12	380,856,915	47,450.00	394,404,400	1.49
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,012	141,120.19	425,054,035	127,900.00	385,234,800	1.46
日本	投資証券	福岡リート投資法人	2,188	158,459.21	346,708,757	173,600.00	379,836,800	1.44
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,067	143,169.11	295,930,570	150,000.00	310,050,000	1.17
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	4,677	64,759.98	302,882,430	64,500.00	301,666,500	1.14
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	510	555,385.65	283,246,685	570,000.00	290,700,000	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	大阪取引所	買建	円	217	320,041,700	339,171,000	339,171,000	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	21,265,859,080	66.96
	オーストラリア	3,009,095,129	9.47
	イギリス	2,148,965,828	6.77
	フランス	1,648,661,520	5.19
	シンガポール	1,211,561,748	3.81
	カナダ	844,093,309	2.66
	香港	560,301,600	1.76
	オランダ	371,096,499	1.17
	ベルギー	170,485,838	0.54
	ニュージーランド	108,847,607	0.34
	アイルランド	62,410,346	0.20
	ドイツ	50,111,895	0.16
	イタリア	37,636,604	0.12
	マン島	29,481,464	0.09
	イスラエル	10,679,760	0.03
	ギリシャ	8,144,178	0.03
	小計	31,537,432,405	99.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		222,082,286	0.70
合計(純資産総額)		31,759,514,691	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	111,990	14,844.80	1,662,469,577	16,803.38	1,881,810,682	5.93
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	34,710	26,420.70	917,062,785	28,094.82	975,171,306	3.07
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	51,640	16,349.86	844,307,106	17,281.18	892,400,310	2.81
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	119,070	5,374.17	639,903,398	6,260.22	745,404,728	2.35
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	177,180	3,972.70	703,883,357	4,202.62	744,620,991	2.34
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	695,220	1,017.50	707,388,646	1,027.82	714,561,368	2.25
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	104,380	6,273.29	654,806,649	6,754.29	705,012,831	2.22
アメリカ	投資証券	HCP INC	162,170	4,018.38	651,662,058	4,230.07	685,990,873	2.16
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	62,300	9,145.35	569,755,347	10,821.70	674,192,346	2.12
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	54,290	10,422.02	565,811,642	12,146.33	659,424,624	2.08
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	102,880	6,106.55	628,242,138	6,371.03	655,451,792	2.06
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	43,540	12,550.84	546,463,582	14,268.99	621,272,155	1.96
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	270,860	1,922.21	520,651,787	2,216.18	600,276,681	1.89
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	277,200	1,681.33	466,065,025	1,806.14	500,662,950	1.58
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	187,000	2,109.65	394,506,050	2,404.25	449,596,433	1.42
香港	投資証券	LINK REIT	820,000	495.64	406,428,825	540.13	442,908,240	1.39
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	354,990	1,066.47	378,587,937	1,219.40	432,875,480	1.36
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	21,930	16,152.89	354,232,967	18,251.01	400,244,864	1.26
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	33,870	9,460.47	320,426,168	11,080.93	375,311,437	1.18
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	78,980	4,100.53	323,860,372	4,407.97	348,142,070	1.10
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	147,360	2,149.55	316,758,524	2,316.83	341,408,275	1.07
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	50,560	5,873.31	296,954,753	6,681.09	337,796,173	1.06
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	1,059,850	287.83	305,065,213	306.92	325,294,673	1.02
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	253,700	1,379.87	350,073,766	1,254.48	318,262,692	1.00
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	816,210	375.87	306,796,882	368.49	300,773,140	0.95
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,500	10,808.16	253,991,882	12,097.54	284,292,190	0.90
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,600	4,864.42	231,546,844	5,835.28	277,759,518	0.87
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	554,800	472.27	262,020,204	485.01	269,087,764	0.85
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	251,000	891.02	223,647,213	1,010.21	253,564,165	0.80
アメリカ	投資証券	UDR INC	89,010	2,448.01	217,897,477	2,796.66	248,931,294	0.78

(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	99.30
合計	99.30

(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

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	9,819,140,654	78.09
	ジャージー	2,157,904,695	17.16
	アメリカ	348,688,005	2.77
	小計	12,325,733,354	98.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		248,571,753	1.98
合計(純資産総額)		12,574,305,107	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	152,930,000	1,421.20	2,173,451,559	1,411.04	2,157,904,695	0.0		17.16
イギリス	社債券	CS USD COM 006 10/24/14	15,000,000	10,787.14	1,618,071,390	10,710.89	1,606,634,640	0.0	2014/10/24	12.78
イギリス	社債券	UBS USD COM 004 08/11/14	13,000,000	10,949.79	1,423,473,818	10,871.52	1,413,297,652	0.0	2014/08/11	11.24
イギリス	社債券	CS USD COM 005 08/11/14	11,000,000	10,929.46	1,202,241,326	10,852.20	1,193,742,550	0.0	2014/08/11	9.49
イギリス	社債券	BAR USD COM 026 11/28/14	10,000,000	10,955.59	1,095,559,322	10,877.11	1,087,711,170	0.0	2014/11/28	8.65
イギリス	社債券	UBS USD COM 005 11/05/14	10,000,000	10,833.90	1,083,390,620	10,756.64	1,075,664,460	0.0	2014/11/05	8.55
イギリス	社債券	BAR USD COM 024 07/25/14	10,000,000	10,678.67	1,067,867,138	10,602.22	1,060,222,306	0.0	2014/07/25	8.43
イギリス	社債券	BAR USD COM 025 08/29/14	8,500,000	10,599.68	900,972,932	10,523.94	894,535,313	0.0	2014/08/29	7.11
イギリス	社債券	UBS USD COM 006 04/30/15	7,000,000	9,971.82	698,028,058	9,900.66	693,046,718	0.0	2015/04/30	5.51
イギリス	社債券	BAR USD COM 023 06/27/14	5,000,000	10,391.27	519,563,928	10,316.86	515,843,172	0.0	2014/06/27	4.10
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	8,690,000	4,045.11	351,520,557	4,012.52	348,688,005	0.0	2036/06/12	2.77
イギリス	社債券	BAR USD COM 027 03/27/15	2,800,000	10,015.84	280,443,749	9,944.38	278,442,673	0.0	2015/03/27	2.21

(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	98.02
合計	98.02

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

FRM シグマ リンク マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ケイマン	6,565,787,200	90.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		672,121,035	9.29
合計(純資産総額)		7,237,908,235	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% 03/31/22	7,520,000,000	85.97	6,465,586,650	87.31	6,565,787,200	0.0	2022/03/31	90.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	90.71
合計	90.71

(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5月30日



基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	10,302円
純資産総額	63.04億円

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

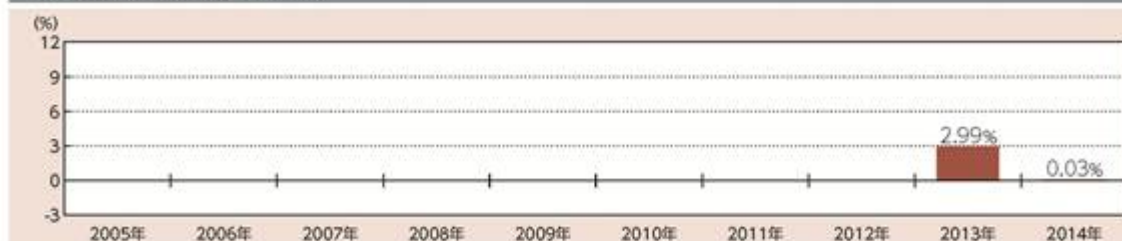
決算期	—	—	—	—	—
分配金	—	—	—	—	—

※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
FOFs用FRM ダイバーシファイド リングファンド(適格機関投資家専用)	10.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	9.1%
外国債券インデックス マザーファンド	9.0%
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	8.7%
外国株式インデックス マザーファンド	7.3%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{AM, APY}	6.9%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6.8%
FRM シグマ リング マザーファンド	5.3%
TCAファンド(適格機関投資家専用)	5.2%
J-REITインデックス マザーファンド	4.2%

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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26年1月31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5月30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5月30日現在)

資産総額	6,333,663,487 円
負債総額	29,603,453 円
純資産総額(-)	6,304,060,034 円
発行済口数	6,119,084,093 口
1口当たり純資産額(/)	1.0302 円
1万口当たり純資産額	10,302 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	36,435,799,917 円
負債総額	2,560,077,440 円
純資産総額(-)	33,875,722,477 円
発行済口数	24,495,146,911 口
1口当たり純資産額(/)	1.3830 円
1万口当たり純資産額	13,830 円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	264,812,544,893 円
負債総額	7,583,171,742 円
純資産総額(-)	257,229,373,151 円
発行済口数	199,216,389,431 口
1口当たり純資産額(/)	1.2912 円
1万口当たり純資産額	12,912 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	170,960,889,778 円
負債総額	2,128,626,441 円
純資産総額(-)	168,832,263,337 円
発行済口数	99,243,956,313 口
1口当たり純資産額(/)	1.7012 円
1万口当たり純資産額	17,012 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	222,990,908,397 円
負債総額	316,128,434 円
純資産総額(-)	222,674,779,963 円
発行済口数	88,844,919,833 口
1口当たり純資産額(/)	2.5063 円
1万口当たり純資産額	25,063 円

新興国株式インデックス マザーファンド

資産総額	25,631,214,938 円
負債総額	276,353,678 円
純資産総額(-)	25,354,861,260 円
発行済口数	11,068,375,553 口
1口当たり純資産額(/)	2.2907 円
1万口当たり純資産額	22,907 円

新興国債券インデックス マザーファンド

資産総額	36,970,643,746 円
負債総額	900,450,409 円
純資産総額(-)	36,070,193,337 円
発行済口数	21,510,820,587 口
1口当たり純資産額(/)	1.6768 円
1万口当たり純資産額	16,768 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	26,848,172,818 円
負債総額	448,148,140 円
純資産総額(-)	26,400,024,678 円
発行済口数	20,974,964,621 口
1口当たり純資産額(/)	1.2586 円
1万口当たり純資産額	12,586 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	32,235,979,043 円
負債総額	476,464,352 円
純資産総額(-)	31,759,514,691 円
発行済口数	24,666,292,571 口
1口当たり純資産額(/)	1.2876 円
1万口当たり純資産額	12,876 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	12,726,239,027 円
負債総額	151,933,920 円
純資産総額(-)	12,574,305,107 円
発行済口数	26,351,888,943 口
1口当たり純資産額(/)	0.4772 円
1万口当たり純資産額	4,772 円

FRM シグマ リンク マザーファンド

資産総額	7,237,908,235 円
負債総額	円
純資産総額(-)	7,237,908,235 円
発行済口数	8,196,678,369 口
1口当たり純資産額(/)	0.8830 円
1万口当たり純資産額	8,830 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。

<訂正後>

(1)資本金の額（平成26年5月30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7月14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>

< 訂正後 >

（前略）

平成26年5月30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>374</u>	<u>4,968,020</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>374</u>	<u>4,968,020</u>

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

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」「3 委託会社等の経理状況」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>

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

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

(2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

[次へ](#)

(1)貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	19,992	13,353
未払金	1,459,757	1,723,999
未払手数料	942,503	1,169,997
その他未払金	517,254	554,001
未払費用	82,209	44,167
未払法人税等	204,363	1,467,469
未払消費税等	11,940	129,007
賞与引当金	92,832	94,659
その他	21,231	14,376
流動負債合計	1,892,326	3,487,033
固定負債		
資産除去債務	12,281	12,492
退職給付引当金	268,531	313,992
繰延税金負債	303,555	-
固定負債合計	584,368	326,485
負債合計	2,476,694	3,813,518
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	59,500	62,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	5,731,912	7,452,293
利益剰余金合計	7,891,412	9,614,793
株主資本合計	8,541,412	10,264,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	4,998	2,715
評価・換算差額等合計	4,998	2,715
純資産合計	8,546,410	10,267,508
負債・純資産合計	11,023,105	14,081,027

(2)損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		19,128,296		22,773,831
運用受託報酬		94,659		55,511
営業収益合計		19,222,955		22,829,342
営業費用				
支払手数料		9,030,246		10,451,296
広告宣伝費		73,287		76,961
公告費		2,244		-
調査費		4,132,154		5,091,105
調査費		207,030		259,236
委託調査費		3,922,394		4,830,390
図書費		2,729		1,479
営業雑経費		1,294,879		1,264,334
通信費		21,905		17,246
印刷費		330,735		327,214
協会費		21,939		22,524
諸会費		757		773
情報機器関連費		874,151		837,859
その他営業雑経費		45,391		58,716
営業費用合計		14,532,812		16,883,698
一般管理費				
給料		2,259,238		2,201,964
役員報酬		78,205		102,330
給料・手当		1,967,177		1,846,450
賞与		213,855		253,183
退職給付費用		64,787		72,029
役員退職慰労金		-		1,070
福利費		190,716		207,122
交際費		879		2,758
旅費交通費		45,160		45,973
租税公課		25,420		42,862
不動産賃借料		129,096		130,938
寄付金		-		3,385
減価償却費		129,966		119,445
諸経費	1	257,947	1	219,615
一般管理費合計		3,103,213		3,047,165
営業利益		1,586,929		2,898,479

（単位：千円）

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,919	-
受取利息	6,475	7,464
収益分配金	-	3,234
投資有価証券売却益	924	553
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	2,552	1,775
営業外収益合計	14,873	16,027
営業外費用		
長期前払費用償却	-	1 23,222
支払補償費	-	14,648
投資有価証券売却損	14,182	284
その他	361	2,112
営業外費用合計	14,544	40,268
経常利益	1,587,257	2,874,238
特別利益		
投資有価証券売却益	30,000	-
特別利益合計	30,000	-
特別損失		
統合関連損失	484,725	-
特別損失合計	484,725	-
税引前当期純利益	1,132,532	2,874,238
法人税、住民税及び事業税	369,828	1,623,332
法人税等調整額	56,358	502,474
法人税等合計	426,187	1,120,857
当期純利益	706,344	1,753,381

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859	9,859	4,962,913
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			706,344
合併による増加			2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	14,857	14,857	14,857
当期変動額合計	14,857	14,857	3,583,496

当期末残高	4,998	4,998	8,546,410
-------	-------	-------	-----------

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

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

（リ - ス取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
（2）未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	47,112	47,112	-
（4）未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	10,457,599	10,457,599	-
（2）未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	69,583	69,583	-
（4）未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
（5）未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1） 金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

（注2） 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
114,040	30,924	14,182

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成25年3月31日）		当事業年度 （平成26年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	16,142	千円	102,368	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	11,347	〃	10,277	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	35,285	〃	33,736	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	95,704	〃	111,906	〃
減価償却超過額	1,067	〃	-	〃
その他	11,680	〃	13,094	〃
繰延税金資産 小計	171,228	〃	271,384	〃
評価性引当額	11,347	〃	-	〃
繰延税金資産 合計	159,881	〃	271,384	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	2,767	〃	1,503	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925	〃	7,953	〃
繰延税金負債 合計	401,693	〃	9,457	〃
繰延税金資産（負債）の純額	241,812	〃	261,926	〃

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

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

3．法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディン グス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導料 の支払	97,199	-	-

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディン グス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導料 の支払	73,276	-	-

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟 会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上の 取引 役員の 兼任	投信販売 代行手数料等 の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用 の支払	2,226,006	その他 未払金	221,229

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成25年3月31日）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

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

（企業結合等関係）

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

（ 1株当たり情報）

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

[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 >

(前略)

(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。

< 訂正後 >

(前略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成26年7月14日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」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 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（平成25年9月末日現在）

（中略）

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年9月末日現在）	事業の内容

（中略）

3 資本関係

（中略）

（参考）再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成25年9月末日現在）

（後略）

<訂正後>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（平成26年3月末日現在）

（中略）

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年3月末日現在）	事業の内容

（中略）

3 資本関係

（中略）

（参考）再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成26年3月末日現在）

（後略）

独立監査人の監査報告書

平成26年 6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川 芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤 浩之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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