

【表紙】

| | |
|--|-------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成27年10月9日提出 |
| 【発行者名】 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 鈴木 郁也 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区芝3丁目3番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志 |
| 【電話番号】 | 03-6737-0521 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | コア投資戦略ファンド（切替型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | 10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

コア投資戦略ファンド（切替型）

愛称として、「コアラップ（切替型）」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、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。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「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。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

（ 7 ）【申込期間】

平成27年10月10日から平成28年 4月 8日までとします。

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

（ 8 ）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

- (2)特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

いう。

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

(1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

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

(2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

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

<ファンドの特色>

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

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

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

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

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

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

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資比率も予め定めているものでもありません。

従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更する運用を行います。

- 「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、75%未満とします。
- ※当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「投資リスク」の「ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。
- 市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ポートフォリオ構築プロセス

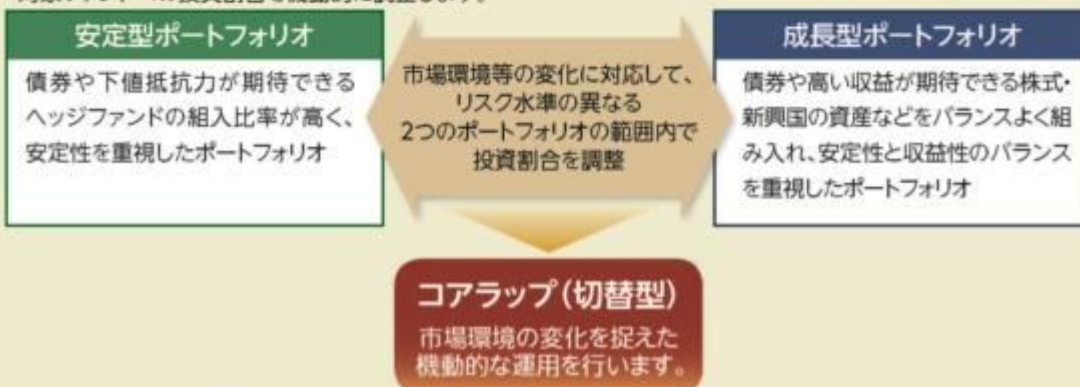
- 投資対象ファンドの選定、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の決定は、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

<(*)「コアラップ(切替型)」の切替機能のイメージ>

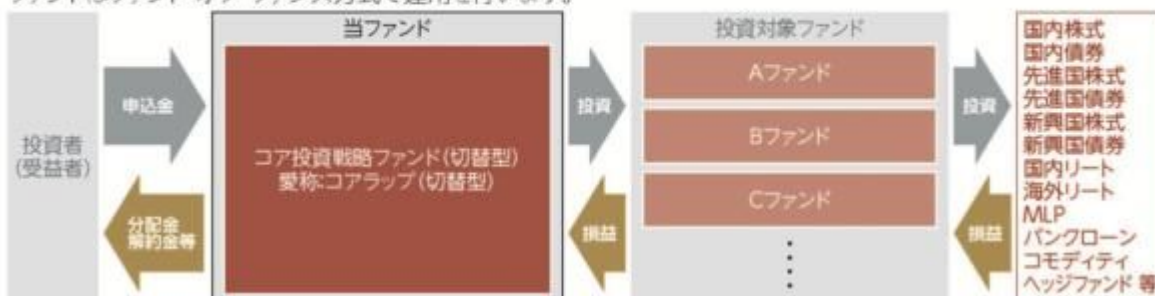
短期的な市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合を機動的に調整します。



※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

？ ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
 - 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。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

〈ご参考情報〉

MLP

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

バンクローン

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

コモディティ

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

ヘッジファンド

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

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

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

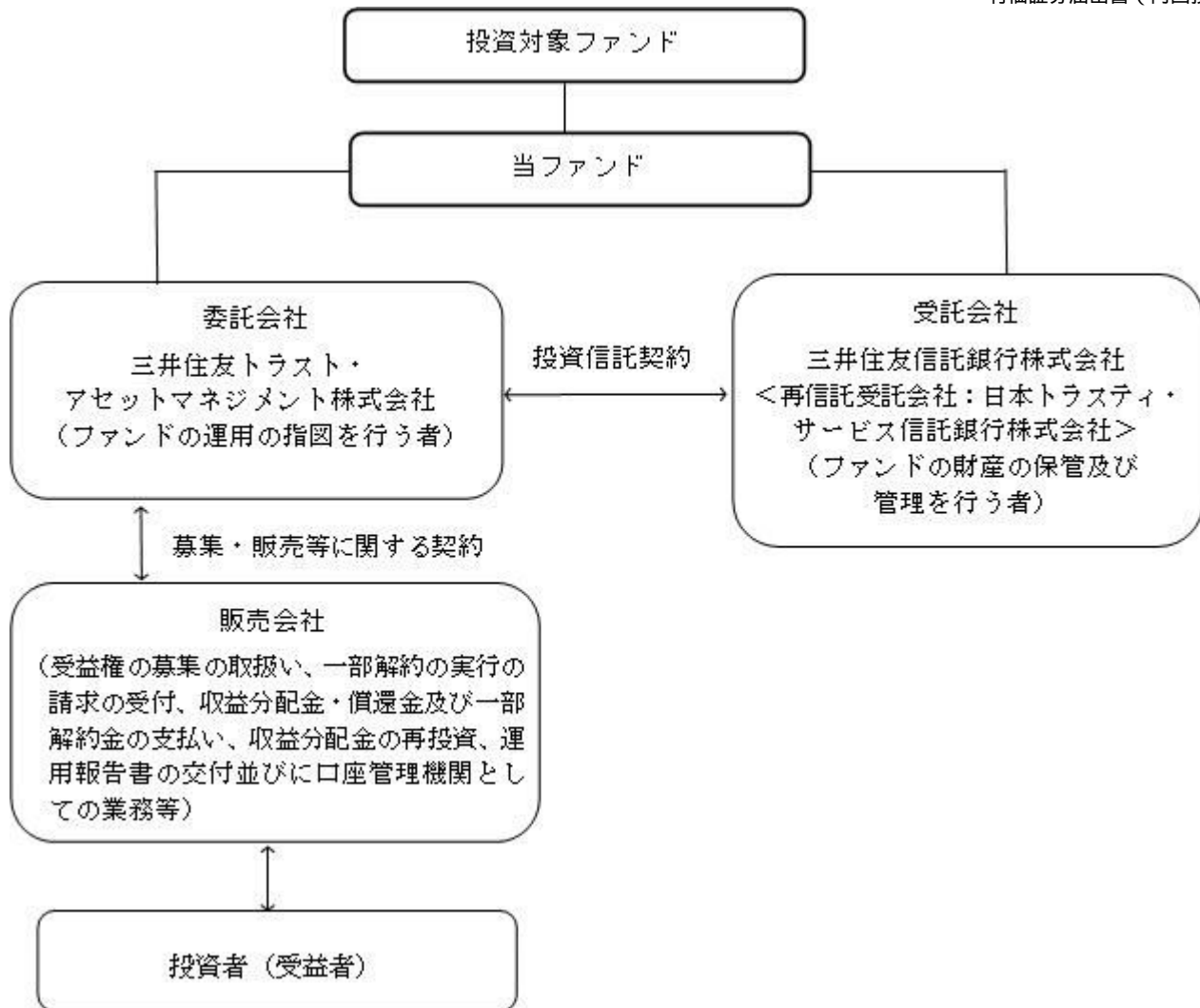
(2) 【ファンドの沿革】

平成25年10月17日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成27年 7月31日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

投資対象

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

投資態度

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

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

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

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

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

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、75%未満とします。

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

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

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

ヘ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ト．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

チ．ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

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

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

1.ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、主としてわが国の株式に投資し、投資信託財産の中長期的成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の株式 |
| 投資態度 | <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て機動的に行います。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。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> |

| | |
|---------------|---|
| <p>主な投資制限</p> | <p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 一部解約を行う日の一部解約又は追加信託の処理を行う前の投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を一部解約又は追加信託の処理を行う前の受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。 |
| 設定日 | 平成23年11月28日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

| | |
|------|--------------|
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |
|------|--------------|

2.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資するJPX日経インデックス400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。 |
| 投資態度 | <p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。</p> <p>このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | JPX日経インデックス400（配当込み） |
| 決算日 | 年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日） |

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

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

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

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

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

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

3.FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）

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

| | |
|---------|--|
| 主な投資制限 | <p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成27年2月2日 |
| 信託期間 | 原則として平成27年2月2日から平成37年4月10日 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

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

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

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

5. 国内債券インデックス マザーファンド

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の公社債 |
| 投資態度 | <p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p> |
| 主な投資制限 | <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | NOMURA-BPI総合 |
| 決算日 | 年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |

| | |
|------|--------------|
| 設定日 | 平成12年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

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

6.FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。 ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。 債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。 デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |

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

7. 外国株式インデックス マザーファンド

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

| | |
|------|--|
| 投資態度 | <p>原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。</p> |
|------|--|

| | |
|---------------|--|
| <p>主な投資制限</p> | <p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | MSCI コクサイ・インデックス（円ベース） |
| 決算日 | 年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成12年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

8. 外国債券インデックス マザーファンド

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

| | |
|---------|--|
| 運用の基本方針 | この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界の主要国の公社債 |
| 投資態度 | <p>シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> |
| 主な投資制限 | <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース） |

| | |
|---------|------------------------|
| 決算日 | 年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成12年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

9. 新興国株式インデックス マザーファンド

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。） |
| 投資態度 | <p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券））を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |

| | |
|---------|---|
| 主な投資制限 | <p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース） |
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。 |
| 設定日 | 平成20年12月12日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

10. FOFs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資する新興国株式セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の株式に直接投資することもあります。 |

| | |
|--------|---|
| 投資態度 | <p>マザーファンドへの投資を通じて、主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、個別銘柄の収益性、収益の安定性、財務の健全性等を勘案し、各銘柄への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日） |

| | |
|---------|--|
| 収益の分配 | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みません。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成26年10月8日 |
| 信託期間 | 原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

11.新興国債券インデックス マザーファンド

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 新興国の債券 |
| 投資態度 | <p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |

| | |
|---------|--|
| 主な投資制限 | <p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） |
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。 |
| 設定日 | 平成20年12月11日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

12. FOFs用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主として新興国の現地通貨建債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する新興国債券セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の現地通貨建債券に直接投資することもあります。 |

| | |
|--------|---|
| 投資態度 | <p>マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の現地通貨建債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、債券の時価総額や流動性等を勘案し、各国への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の現地通貨建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の現地通貨建債券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%） |

| | |
|---------|------------------------------|
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成26年10月8日 |
| 信託期間 | 原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

13.FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主として日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を含む世界各国の債券に直接投資することもあります。 |
| 投資態度 | <p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国の債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への実質投資割合を決定します。</p> <p>債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |

| | |
|---------|--|
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みません。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成26年10月8日 |
| 信託期間 | 原則として、平成26年10月8日から平成36年9月17日 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

14. 大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 大和住銀投信投資顧問株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みません。）への実質的な投資を行います。 |
| 主要投資対象 | マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | <p>主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みません。）への実質的な投資を行います。</p> <p>中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。</p> <p>世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> |

| | |
|---------|---|
| 主な投資制限 | <p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.7452%以内（税抜：0.69%以内） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成27年5月12日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

15. J-REITインデックス マザーファンド

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券 |
| 投資態度 | <p>わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |

| | |
|---------------|--|
| <p>主な投資制限</p> | <p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | 東証REIT指数（配当込み） |
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成20年1月9日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

16. グローバルREITインデックス マザーファンド

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券 |
| 投資態度 | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 |

| | |
|---------------|--|
| <p>主な投資制限</p> | <p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> |
| ベンチマーク | S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） |
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成20年1月9日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's^(R) およびS&P^(R) はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R) はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に

関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

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

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、別に定めるMLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | インデックス マザーファンドMLP受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券 |

| | |
|---------|---|
| 投資態度 | <p>主として、インデックス マザーファンドMLP 受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLP やMLP に関連する証券に投資を行ない、別に定めるMLP 市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。運用にあたって、対象指数に採用されていないMLP 等についても、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は投資を行ないます。また、対象指数に採用されているMLP 等の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合があります。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>< 別に定めるMLP 市場の動きをとらえる指数（平成27年10月 9日現在）> S&P MLP 指数（円換算ベース）</p> |
| 主な投資制限 | <p>株式：制限なし 投資信託証券：（マザーファンドおよび上場投資信託証券を除いて）5%以下 外貨建資産：制限なし</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> |
| ベンチマーク | S&P MLP 指数（円換算ベース）（平成27年10月 9日現在） |
| 決算日 | 年1回：11月20日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | <p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定する。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともある。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行なう。</p> |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.1512%（税抜 年0.14%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成26年10月8日 |
| 信託期間 | 平成26年10月8日から平成36年11月20日 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

「S&P MLP 指数」とはS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、ニューヨーク証券取引所やNASDAQなどに上場するMLP などのうち、GICS（世界産業分類基準）においてエネルギーセクターまたは公益事業セクターのガス産業に属する銘柄を対象とした、浮動株調整後の時価総額加重を基本とする指数です。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに日興アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。同指数はSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが日興アセットマネジメント株式会社に付与されています。

18.HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

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

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

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

19. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 米ドル建て債券 |
| 投資態度 | <p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |

| | |
|---------------|--|
| <p>主な投資制限</p> | <p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | ブルームバーグ商品指数（円換算ベース） |
| 決算日 | 年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成20年7月1日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

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

およびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（BloombergCommodity IndexSM）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

20.TCAファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数を対象とした先物取引（以下「株価指数先物取引」といいます。）及び債券先物取引を積極的に活用し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の円建短期公社債等並びに日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | <p>主として、わが国の円建短期公社債等に投資するとともに、日本、米国及び欧州を中心とする先進国の株価指数先物取引及び債券先物取引（以下「先物取引等」といいます。）を行います。</p> <p>運用にあたっては、三井住友信託銀行株式会社から助言を受けます。</p> <p>先物取引等は、原則として定量的手法に基づき行います。</p> <p>先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の75の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引にかかる投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額に100分の500の率を乗じて得られる額の範囲内とします。投資額が当該範囲を超えた場合には、すみやかに調整するものとします。</p> <p>ここでいう投資額とは、投資信託財産における先物取引等の種類ごとに買建玉の時価総額と売建玉の時価総額の差額の絶対値を合計した額をいいます。</p> <p>先物取引等にかかる損益等の為替リスクに対しては、原則として為替予約を行い、為替リスクの低減をはかります。</p> <p>大量の追加設定又は解約が発生したとき、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき、投資信託財産の規模その他の要因等によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |

| | |
|----------------|---|
| <p>主な投資制限</p> | <p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| <p>ベンチマーク</p> | <p>該当事項はありません。</p> |
| <p>決算日</p> | <p>6月・12月の各20日（休業日の場合は翌営業日）</p> |
| <p>収益の分配</p> | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲 経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配対象額についての分配方針 委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用方針 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> |
| <p>信託報酬</p> | <p>純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）</p> |
| <p>信託財産留保額</p> | <p>該当事項はありません。</p> |
| <p>設定日</p> | <p>平成22年2月25日</p> |
| <p>信託期間</p> | <p>原則として無期限</p> |
| <p>助言会社</p> | <p>三井住友信託銀行株式会社</p> |
| <p>受託会社</p> | <p>三井住友信託銀行株式会社</p> |

21.FRM シグマ リンク マザーファンド

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として積極的な運用を行います。 |
| 主要投資対象 | ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設定された海外籍特別目的会社の発行する円建債券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | <p>主として、円建債券への投資を通じて、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託「FRM Sigma MA Fund Limited（以下「FRM シグマファンド」といいます。）」の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM シグマファンドは、金利、債券、株式、商品、為替等の先物取引等を用いる複数のCTAのファンドを組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して積極的な運用を行います。</p> <p>原則として、円建債券の組入比率は高位を保ちます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |

| | |
|---------|-------------------------|
| 決算日 | 年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成24年8月7日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

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

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

| | |
|---------|------------------------------------|
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成24年8月8日 |
| 信託期間 | 原則として平成24年8月8日から平成34年6月27日 |
| 助言会社 | マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

「HFRI総合指数^(R)（HFRI Weighted Composite Index^(R)）」（以下「HFR指数」）は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク（HFR）の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」に関する使用のみ、BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR及びHFR指数（当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている）は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFRは、当該投資信託を發起、支持、販売又は推奨していません。HFRは、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日に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。

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

| | |
|---------|---|
| 投資顧問会社 | Standard Life Investments Limited |
| 運用の基本方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | 主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等に投資します。 |
| 投資態度 | 主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等の多様な資産に対して、様々な投資手法を活用した投資を行うことで、リスクの低減を図りつつ、日本円短期金利（円LIBOR 6ヶ月物）を上回る投資成果を目指します。 組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。 |
| 主な投資制限 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| ベンチマーク | 日本円短期金利（円LIBOR 6ヶ月物） |
| 決算日 | 毎年12月31日 |
| 収益の分配 | 収益の分配は行いません。 |
| 信託報酬 | 年率0.85% この他、投資信託財産に関する租税や、投資信託の運営・運用等に要する諸費用が発生します。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成23年6月14日 |

| | |
|------|--|
| 関係法人 | <ul style="list-style-type: none"> ・副投資顧問会社 Standard Life Investments (USA) Limited ・管理事務代行会社 / 保管受託銀行 The Bank of New York Mellon (Luxembourg) S.A. |
|------|--|

24.FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | FRM ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | <p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、FRM Investment Management Limited が実質的に運用する外国投資信託証券「FRM Diversified MA Fund Limited」（以下「FRM ダイバーシファイド ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM ダイバーシファイド ファンドは、様々なヘッジファンドに分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |

| | |
|---------|---|
| 決算日 | 年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 平成25年10月16日 |
| 信託期間 | 原則として、平成25年10月16日から平成35年10月10日 |
| 助言会社 | 該当事項はありません。 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

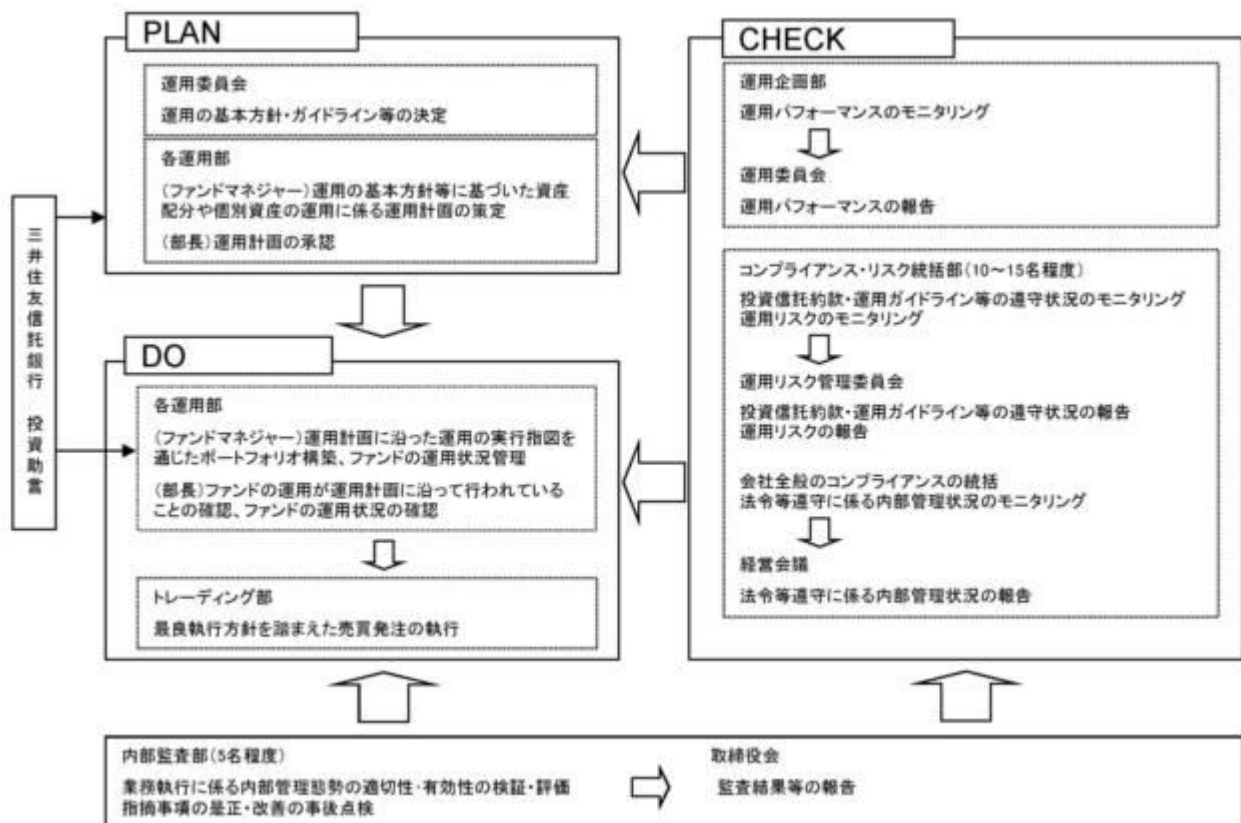
25.BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

| | |
|---------|---|
| 投資顧問会社 | BlueBay Asset Management LLP |
| 運用の基本方針 | 主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 |
| 主要投資対象 | <p>わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。</p> <p>なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。</p> |
| 投資態度 | <p>主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。</p> <p>債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 毎年6月30日（休業日の場合は前営業日） |
| 収益の分配 | 収益の分配は行いません。 |
| 信託報酬 | <p>年率0.74%</p> <p>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。</p> |

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

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【配分方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・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。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ．外国為替予約取引の指図

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

リ．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

<その他の投資制限>

イ. 当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

MLPの価格変動リスク

MLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）の多くは、エネルギー、天然資源に関わる事業を主な投資対象とするため、MLPの価格は、事業を取り巻く環境やエネルギー市況の変化、金

利変動等の要因により変動し、基準価額の変動要因となります。

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

仕組み債券に係るリスク

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

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

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

ブローカーの信用リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

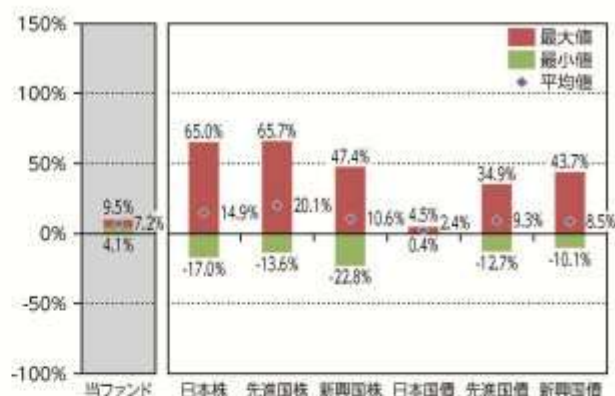
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

※当ファンドについては2014年10月～2015年7月の10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2010年8月～2015年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

※各資産クラスの指数

- 日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}
- 先進国株…… MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}
- 新興国株…… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{※3}
- 日本国債…… NOMURA-BPI国債^{※4}
- 先進国債…… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}
- 新興国債…… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)^{※6}

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

- ※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- ※2 MSCIロクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- ※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（1）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。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

1：「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（以下同じ）。

「分配金再投資コース」（2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記及びの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.4904%（税抜 1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

| | | |
|------|--------------------------|---|
| 委託会社 | 年率 0.9504% （税抜 0.88%） | 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 |
| 販売会社 | 年率 0.486% （税抜 0.45%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| 受託会社 | 年率 0.054% （税抜 0.05%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

| ファンド名 | 信託報酬 |
|---|--------------------------|
| ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド | ありません。 |
| FOFs用JPX日経インデックス400・オープン （適格機関投資家専用） | 年率 0.0756% （税抜 0.07%） |
| FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用） | 年率 0.0648% （税抜 0.06%） |
| F O F s 用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド （適格機関投資家専用） | 年率 0.3672% （税抜 0.34%） |
| 国内債券インデックス マザーファンド | ありません。 |
| FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家 専用） | 年率 0.0648% （税抜 0.06%） |
| 外国株式インデックス マザーファンド | ありません。 |
| 外国債券インデックス マザーファンド | ありません。 |
| 新興国株式インデックス マザーファンド | ありません。 |
| FOFs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資 家専用） | 年率 0.0648% （税抜 0.06%） |
| 新興国債券インデックス マザーファンド | ありません。 |
| FOFs用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資 家専用） | 年率 0.0648% （税抜 0.06%） |
| FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替 ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 年率 0.0648% （税抜 0.06%） |
| 大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド（適格 機関投資家専用） | 年率 0.7452%以内（税抜 0.69%以内） |
| J-REITインデックス マザーファンド | ありません。 |
| グローバルREITインデックス マザーファンド | ありません。 |
| F O F s 用MLPインデックスファンド（適格機関 投資家専用） | 年率 0.1512% （税抜 0.14%） |
| HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス | 年率 0.65% |
| グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザー ファンド | ありません。 |
| TCAファンド（適格機関投資家専用） | 年率 0.864% （税抜 0.8%） |
| FRMシグマ リンク マザーファンド | ありません。 |
| ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド ・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 年率 0.864% （税抜 0.8%） |
| Global Absolute Return Strategies Fund- Class D ^{A, H, JPY} | 年率 0.85% |
| FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド（適 格機関投資家専用） | 年率 0.0648% （税抜 0.06%） |

| | |
|--|----------|
| BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY | 年率 0.74% |
|--|----------|

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

実質的な信託報酬率：年率1.4904%～1.98186%程度（税抜 1.38%～1.8445%程度）

（４）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

| | 税 率（内 訳） |
|---------------|---------------------------|
| 平成49年12月31日まで | 20.315%（所得税15.315%、住民税5%） |
| 平成50年1月1日以降 | 20%（所得税15%、住民税5%） |

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

八．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得から控除することが可能です。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能です。

なお、平成28年1月1日以降は、損益通算の対象に特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等が追加され、これらの所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）及び譲渡所得等との損益通算が可能となります。

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」（*）をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

*平成28年4月1日より適用開始される、20歳未満の方を対象とした非課税制度です。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

| | 税 率（所得税のみ） |
|---------------|------------|
| 平成49年12月31日まで | 15.315% |
| 平成50年1月1日以降 | 15% |

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

上記は、平成27年 7月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成27年 7月31日現在の状況について記載してあります。

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（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 | 15,422,390,855 | 53.75 |
| | ケイマン | 2,104,318,930 | 7.33 |
| | 小計 | 17,526,709,785 | 61.08 |
| 投資証券 | ルクセンブルク | 3,439,357,839 | 11.99 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 7,511,239,055 | 26.18 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 216,706,773 | 0.76 |
| 合計（純資産総額） | | 28,694,013,452 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|---------|----------|--|---------------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用) | 3,328,575,090 | 1.0236 | 3,407,201,962 | 1.0257 | 3,414,119,469 | 11.90 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 3,332,224,511 | 1.0138 | 3,378,369,654 | 1.0176 | 3,390,871,662 | 11.82 |
| ルクセンブルク | 投資証券 | Global Absolute Return Strategies A, H, JPY Fund-Class D | 1,182,299.001 | 1,923.16 | 2,273,757,947 | 1,939 | 2,292,477,762 | 7.99 |

| | | | | | | | | |
|---------|-----------|---|----------------|----------|---------------|----------|---------------|------|
| 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） | 2,198,766,466 | 1.0373 | 2,280,964,412 | 1.042 | 2,291,114,657 | 7.98 |
| ケイマン | 投資信託受益証券 | HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス | 1,984,814.0693 | 1,059.31 | 2,102,535,647 | 1,060.2 | 2,104,318,930 | 7.33 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックス マザーファンド | 1,541,919,242 | 1.3219 | 2,038,349,281 | 1.3247 | 2,042,580,419 | 7.12 |
| 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 | 798,049,812 | 2.0748 | 1,655,812,107 | 2.1699 | 1,731,688,287 | 6.04 |
| 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 | 468,486,776 | 2.8072 | 1,315,136,105 | 2.8753 | 1,347,040,027 | 4.69 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOfs用新興国債券セレクトファンド（適格機関投資家専用） | 1,361,008,857 | 0.9658 | 1,314,514,918 | 0.9785 | 1,331,747,166 | 4.64 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | TCAファンド（適格機関投資家専用） | 1,156,185,577 | 0.9918 | 1,146,737,315 | 0.9929 | 1,147,976,659 | 4.00 |
| ルクセンブルク | 投資証券 | BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY | 115,744.991 | 9,921.04 | 1,148,311,650 | 9,908.68 | 1,146,880,077 | 4.00 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | F R Mシグマ リンク マザーファンド | 1,080,411,456 | 1.0394 | 1,123,059,717 | 1.0513 | 1,135,836,563 | 3.96 |
| 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） | 683,971,287 | 1.3547 | 926,641,290 | 1.4092 | 963,852,337 | 3.36 |
| 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） | 845,350,827 | 0.9989 | 844,452,514 | 1.0022 | 847,210,598 | 2.95 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOfs用新興国株式セレクトファンド（適格機関投資家専用） | 681,545,258 | 1.0237 | 697,698,450 | 1.0563 | 719,916,256 | 2.51 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | J - R E I Tインデックス マザーファンド | 393,769,291 | 1.3715 | 540,086,944 | 1.4757 | 581,085,342 | 2.03 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | 大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用） | 463,840,757 | 1.0314 | 478,430,000 | 1.0338 | 479,518,574 | 1.67 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOfs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 408,055,943 | 1.1266 | 459,737,506 | 1.1674 | 476,364,507 | 1.66 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | グローバルR E I Tインデックス マザーファンド | 229,519,928 | 1.6263 | 373,268,372 | 1.6861 | 386,993,550 | 1.35 |
| 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 | 719,353,288 | 0.4167 | 299,789,209 | 0.3976 | 286,014,867 | 1.00 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | F O F s用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用） | 211,721,520 | 0.9002 | 190,595,360 | 0.906 | 191,819,697 | 0.67 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOfs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用） | 138,548,546 | 1.1345 | 157,186,276 | 1.2117 | 167,879,273 | 0.59 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 61.08 |
| 投資証券 | 11.99 |
| 親投資信託受益証券 | 26.18 |
| 合計 | 99.24 |

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

| | 純資産総額（円） | | 1万口当たりの純資産額（円） | |
|---------------------------|----------------|----------------|----------------|--------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第1期計算期間末 (平成26年 7月10日) | 8,047,177,409 | 8,047,177,409 | 10,389 | 10,389 |
| 第2期計算期間末 (平成27年 7月10日) | 27,366,014,831 | 27,366,014,831 | 10,787 | 10,787 |
| 平成26年 7月末日 | 8,780,529,350 | | 10,456 | |
| 8月末日 | 9,821,347,362 | | 10,508 | |
| 9月末日 | 11,117,646,052 | | 10,581 | |
| 10月末日 | 11,946,811,969 | | 10,500 | |
| 11月末日 | 13,534,965,513 | | 10,923 | |
| 12月末日 | 15,201,673,873 | | 10,902 | |
| 平成27年 1月末日 | 17,274,435,661 | | 10,892 | |
| 2月末日 | 19,946,272,069 | | 11,027 | |
| 3月末日 | 22,311,345,713 | | 11,012 | |
| 4月末日 | 24,287,732,359 | | 11,160 | |
| 5月末日 | 26,400,426,672 | | 11,241 | |
| 6月末日 | 27,348,567,423 | | 10,980 | |
| 7月末日 | 28,694,013,452 | | 10,979 | |

【分配の推移】

| | 期 間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---------|-------------------------|---------------|
| 第1期計算期間 | 平成25年10月17日～平成26年 7月10日 | 0 |
| 第2期計算期間 | 平成26年 7月11日～平成27年 7月10日 | 0 |

【収益率の推移】

| | 期 間 | 収益率（％） |
|---------|-------------------------|--------|
| 第1期計算期間 | 平成25年10月17日～平成26年 7月10日 | 3.9 |
| 第2期計算期間 | 平成26年 7月11日～平成27年 7月10日 | 3.8 |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 期 間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|---------|-------------------------|----------------|-------------|----------------|
| 第1期計算期間 | 平成25年10月17日～平成26年 7月10日 | 7,756,133,400 | 10,141,270 | 7,745,992,130 |
| 第2期計算期間 | 平成26年 7月11日～平成27年 7月10日 | 17,904,927,940 | 280,776,696 | 25,370,143,374 |

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|-------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 262,952,326,550 | 80.26 |
| | ポーランド | 201,626,000 | 0.06 |
| | メキシコ | 101,120,000 | 0.03 |
| | 小計 | 263,255,072,550 | 80.35 |
| 地方債証券 | 日本 | 19,426,312,713 | 5.93 |
| 特殊債券 | 日本 | 26,504,972,820 | 8.09 |
| | アメリカ | 208,922,000 | 0.06 |
| | 小計 | 26,713,894,820 | 8.15 |
| 社債券 | 日本 | 15,083,493,490 | 4.60 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------------|--------|
| | アメリカ | 505,629,000 | 0.15 |
| | オーストラリア | 503,046,000 | 0.15 |
| | オランダ | 404,874,000 | 0.12 |
| | スウェーデン | 302,241,000 | 0.09 |
| | フランス | 100,313,000 | 0.03 |
| | 小計 | 16,899,596,490 | 5.16 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 1,350,666,891 | 0.41 |
| 合計（純資産総額） | | 327,645,543,464 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資 比率 （％） |
|--------|---------------|------|-------------|-----------------|
| 債券先物取引 | 買建 | 日本 | 147,550,000 | 0.05 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|------|------|----------------|---------------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本 | 国債証券 | 第118回利付国債(5年) | 4,880,000,000 | 100.62 | 4,910,548,800 | 100.58 | 4,908,304,000 | 0.200 | 2019/6/20 | 1.50 |
| 日本 | 国債証券 | 第122回利付国債(5年) | 4,900,000,000 | 100.13 | 4,906,664,000 | 100.13 | 4,906,370,000 | 0.100 | 2019/12/20 | 1.50 |
| 日本 | 国債証券 | 第123回利付国債(5年) | 4,640,000,000 | 100.06 | 4,643,193,600 | 100.09 | 4,644,268,800 | 0.100 | 2020/3/20 | 1.42 |
| 日本 | 国債証券 | 第117回利付国債(5年) | 4,520,000,000 | 100.64 | 4,549,108,800 | 100.57 | 4,546,170,800 | 0.200 | 2019/3/20 | 1.39 |
| 日本 | 国債証券 | 第113回利付国債(5年) | 4,390,000,000 | 100.93 | 4,430,827,000 | 100.81 | 4,425,954,100 | 0.300 | 2018/6/20 | 1.35 |
| 日本 | 国債証券 | 第120回利付国債(5年) | 4,240,000,000 | 100.62 | 4,266,372,800 | 100.57 | 4,264,422,400 | 0.200 | 2019/9/20 | 1.30 |
| 日本 | 国債証券 | 第116回利付国債(5年) | 4,200,000,000 | 100.67 | 4,228,174,800 | 100.57 | 4,224,066,000 | 0.200 | 2018/12/20 | 1.29 |
| 日本 | 国債証券 | 第338回利付国債(10年) | 3,680,000,000 | 100.08 | 3,683,050,600 | 100.13 | 3,685,115,200 | 0.400 | 2025/3/20 | 1.12 |
| 日本 | 国債証券 | 第105回利付国債(5年) | 3,500,000,000 | 100.42 | 3,514,700,000 | 100.37 | 3,513,125,000 | 0.200 | 2017/6/20 | 1.07 |
| 日本 | 国債証券 | 第106回利付国債(5年) | 3,260,000,000 | 100.47 | 3,275,354,600 | 100.41 | 3,273,529,000 | 0.200 | 2017/9/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債(10年) | 3,010,000,000 | 104.35 | 3,141,085,500 | 104.32 | 3,140,242,700 | 0.800 | 2022/9/20 | 0.96 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第335回利付国債（10年） | 3,040,000,000 | 101.28 | 3,079,137,400 | 101.37 | 3,081,678,400 | 0.500 | 2024/9/20 | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第355回利付国債（2年） | 3,030,000,000 | 100.18 | 3,035,570,600 | 100.18 | 3,035,726,700 | 0.100 | 2017/8/15 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第334回利付国債（10年） | 2,950,000,000 | 102.32 | 3,018,646,500 | 102.32 | 3,018,676,000 | 0.600 | 2024/6/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第333回利付国債（10年） | 2,750,000,000 | 102.39 | 2,815,862,500 | 102.43 | 2,816,990,000 | 0.600 | 2024/3/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第332回利付国債（10年） | 2,700,000,000 | 102.50 | 2,767,500,000 | 102.53 | 2,768,445,000 | 0.600 | 2023/12/20 | 0.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第99回利付国債（5年） | 2,600,000,000 | 100.53 | 2,613,858,000 | 100.45 | 2,611,726,000 | 0.400 | 2016/9/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第328回利付国債（10年） | 2,540,000,000 | 102.75 | 2,609,977,000 | 102.77 | 2,610,408,800 | 0.600 | 2023/3/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第289回利付国債（10年） | 2,490,000,000 | 103.83 | 2,585,591,100 | 103.54 | 2,578,195,800 | 1.500 | 2017/12/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第103回利付国債（5年） | 2,500,000,000 | 100.55 | 2,513,925,000 | 100.48 | 2,512,175,000 | 0.300 | 2017/3/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第115回利付国債（5年） | 2,460,000,000 | 100.66 | 2,476,236,000 | 100.56 | 2,473,825,200 | 0.200 | 2018/9/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第321回利付国債（10年） | 2,330,000,000 | 105.75 | 2,464,068,200 | 105.57 | 2,459,897,500 | 1.000 | 2022/3/20 | 0.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債（10年） | 2,300,000,000 | 104.25 | 2,397,911,000 | 104.24 | 2,397,704,000 | 0.800 | 2023/6/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債（10年） | 2,240,000,000 | 104.21 | 2,334,483,200 | 104.21 | 2,334,416,000 | 0.800 | 2023/9/20 | 0.71 |
| 日本 | 国債証券 | 第312回利付国債（10年） | 2,170,000,000 | 105.98 | 2,299,852,800 | 105.85 | 2,297,053,500 | 1.200 | 2020/12/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第102回利付国債（5年） | 2,280,000,000 | 100.48 | 2,290,944,000 | 100.41 | 2,289,416,400 | 0.300 | 2016/12/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債（10年） | 2,160,000,000 | 105.60 | 2,281,024,800 | 105.36 | 2,275,948,800 | 1.300 | 2019/12/20 | 0.69 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債（10年） | 2,100,000,000 | 104.93 | 2,203,614,000 | 104.61 | 2,196,831,000 | 1.500 | 2018/9/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第288回利付国債（10年） | 2,090,000,000 | 103.92 | 2,172,011,600 | 103.60 | 2,165,386,300 | 1.700 | 2017/9/20 | 0.66 |
| 日本 | 国債証券 | 第324回利付国債（10年） | 2,020,000,000 | 104.41 | 2,109,161,200 | 104.35 | 2,107,930,600 | 0.800 | 2022/6/20 | 0.64 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-------|--------|---------------|----|----|-------------|-------------|-----------------|
| 債券先物取引 | 大阪取引所 | 長期国債先物 | 買建 | | 1円 | 147,580,324 | 147,550,000 | 0.05 |

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------|-------------|-----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 146,672,988,440 | 57.17 |
| | イギリス | 20,634,230,908 | 8.04 |
| | スイス | 10,633,686,006 | 4.14 |
| | フランス | 9,658,965,530 | 3.76 |
| | ドイツ | 9,469,396,595 | 3.69 |
| | カナダ | 9,225,731,133 | 3.60 |
| | オーストラリア | 6,368,186,069 | 2.48 |
| | アイルランド | 4,366,309,995 | 1.70 |
| | オランダ | 4,286,629,230 | 1.67 |
| | スペイン | 3,744,562,659 | 1.46 |
| | スウェーデン | 3,052,040,750 | 1.19 |
| | 香港 | 2,390,736,594 | 0.93 |
| | イタリア | 2,339,723,554 | 0.91 |
| | デンマーク | 1,815,291,930 | 0.71 |
| | シンガポール | 1,560,848,504 | 0.61 |
| | ベルギー | 1,387,809,314 | 0.54 |
| | ジャージー | 1,330,242,619 | 0.52 |
| | バミューダ | 1,019,739,564 | 0.40 |
| | フィンランド | 884,995,064 | 0.34 |
| | キュラソー | 858,010,718 | 0.33 |
| | イスラエル | 721,692,256 | 0.28 |
| | ケイマン | 669,630,470 | 0.26 |
| | ノルウェー | 609,861,697 | 0.24 |
| | ルクセンブルク | 386,366,902 | 0.15 |
| | オーストリア | 201,337,260 | 0.08 |
| | パナマ | 170,751,469 | 0.07 |
| | ポルトガル | 163,841,892 | 0.06 |
| ニュージーランド | 141,668,950 | 0.06 | |
| リベリア | 114,433,226 | 0.04 | |

| | | | |
|---------------------|----------|-----------------|--------|
| | 英ヴァージン諸島 | 72,725,942 | 0.03 |
| | マン島 | 34,171,105 | 0.01 |
| | モーリシャス | 12,112,787 | 0.00 |
| | 小計 | 244,998,719,132 | 95.49 |
| 投資信託受益証券 | オーストラリア | 153,588,388 | 0.06 |
| | 香港 | 28,603,520 | 0.01 |
| | シンガポール | 24,281,450 | 0.01 |
| | 小計 | 206,473,358 | 0.08 |
| 投資証券 | アメリカ | 4,280,234,469 | 1.67 |
| | オーストラリア | 547,073,253 | 0.21 |
| | イギリス | 382,189,929 | 0.15 |
| | フランス | 366,925,450 | 0.14 |
| | 香港 | 105,362,800 | 0.04 |
| | シンガポール | 100,935,617 | 0.04 |
| | カナダ | 45,931,830 | 0.02 |
| | 小計 | 5,828,653,348 | 2.27 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 5,544,122,932 | 2.16 |
| 合計(純資産総額) | | 256,577,968,770 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------|---------|---------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 10,111,539,235 | 3.94 |
| | 買建 | カナダ | 725,963,427 | 0.28 |
| | 買建 | ドイツ | 2,763,074,104 | 1.08 |
| | 買建 | イギリス | 1,575,818,337 | 0.61 |
| | 買建 | オーストラリア | 813,895,264 | 0.32 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|---------|------|----------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 10,937,418,990 | 4.26 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|----------|----|------------------------|------------------------|-----------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 379,610 | 16,328.62 | 6,198,509,564 | 15,178.77 | 5,762,014,702 | 2.25 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 507,712 | 5,879.49 | 2,985,090,673 | 5,814.99 | 2,952,342,843 | 1.15 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL | エネルギー | 272,393 | 10,554.56 | 2,874,989,243 | 10,296.56 | 2,804,710,977 | 1.09 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 317,787 | 6,974.76 | 2,216,490,980 | 7,212.92 | 2,292,174,115 | 0.89 |
| アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 180,521 | 12,536.72 | 2,263,141,737 | 12,384.15 | 2,235,599,792 | 0.87 |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO | 資本財 | 653,433 | 3,424.74 | 2,237,841,008 | 3,239.92 | 2,117,073,782 | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 242,036 | 8,217.64 | 1,988,967,135 | 8,563.72 | 2,072,728,921 | 0.81 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA - REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 209,439 | 9,437.53 | 1,976,588,542 | 9,346.50 | 1,957,523,498 | 0.76 |
| スイス | 株式 | NOVARTIS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 149,393 | 12,604.32 | 1,882,997,940 | 12,821.00 | 1,915,367,653 | 0.75 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 397,780 | 4,269.45 | 1,698,304,526 | 4,431.94 | 1,762,940,753 | 0.69 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 395,093 | 4,288.70 | 1,694,436,959 | 4,316.59 | 1,705,455,283 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM | 小売 | 25,614 | 52,915.46 | 1,355,376,695 | 66,579.71 | 1,705,372,702 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 175,279 | 9,842.57 | 1,725,196,528 | 9,599.45 | 1,682,582,978 | 0.66 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING GENUSS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 45,623 | 36,151.37 | 1,649,334,122 | 35,732.12 | 1,630,206,830 | 0.64 |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL C | ソフトウェア・サービス | 20,011 | 66,914.61 | 1,339,028,429 | 78,466.46 | 1,570,192,403 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS | 電気通信サービス | 269,667 | 6,136.25 | 1,654,746,502 | 5,788.94 | 1,561,087,917 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO | メディア | 104,774 | 13,712.62 | 1,436,726,257 | 14,888.52 | 1,559,929,920 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | ソフトウェア・サービス | 131,010 | 9,946.76 | 1,303,126,023 | 11,809.84 | 1,547,208,239 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 18,676 | 68,711.95 | 1,283,264,527 | 82,432.02 | 1,539,500,450 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 682,616 | 2,070.22 | 1,413,170,483 | 2,248.84 | 1,535,097,715 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | CITIGROUP | 銀行 | 196,847 | 6,772.58 | 1,333,162,843 | 7,303.47 | 1,437,667,183 | 0.56 |
| イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC (GB) | 銀行 | 1,266,187 | 1,203.19 | 1,523,472,146 | 1,116.34 | 1,413,498,030 | 0.55 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|-----------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | GILEAD SCIENCES INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 96,637 | 14,020.24 | 1,354,874,049 | 14,624.31 | 1,413,250,025 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 121,993 | 12,792.24 | 1,560,564,368 | 11,539.44 | 1,407,731,050 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO | 食品・飲料・タバコ | 269,118 | 5,099.28 | 1,372,309,219 | 5,031.06 | 1,353,949,451 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 184,132 | 7,397.74 | 1,362,161,693 | 7,258.82 | 1,336,581,192 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 74,941 | 17,934.94 | 1,344,062,608 | 17,719.11 | 1,327,888,122 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 小売 | 85,480 | 13,908.60 | 1,188,907,572 | 14,445.69 | 1,234,818,299 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | INTL BUSINESS MACHINES CORP | ソフトウェア・サービス | 61,107 | 21,281.54 | 1,300,451,236 | 19,965.47 | 1,220,030,489 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 127,762 | 8,624.50 | 1,101,883,522 | 9,474.17 | 1,210,439,572 | 0.47 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内／外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|--------------------|-------|------------------------|-------------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 7.27 |
| | | 素材 | 4.55 |
| | | 資本財 | 6.82 |
| | | 商業・専門サービス | 0.89 |
| | | 運輸 | 1.85 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.68 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.78 |
| | | 消費者サービス | 1.76 |
| | | メディア | 3.15 |
| | | 小売 | 3.66 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 2.15 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 5.75 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 2.07 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 3.54 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 10.46 |
| | | 銀行 | 9.41 |
| | | 各種金融 | 4.11 |
| | | 保険 | 4.29 |
| | | 不動産 | 0.71 |
| ソフトウェア・サービス | 7.55 | | |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.27 | | |
| 電気通信サービス | 3.12 | | |

| | | | |
|----------|--|-------------|-------|
| | | 公益事業 | 3.01 |
| | | 半導体・半導体製造装置 | 1.61 |
| | | 小計 | 95.49 |
| 投資信託受益証券 | | | 0.08 |
| 投資証券 | | | 2.27 |
| 合計 | | | 97.84 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|---------|--------------------|---------------|---------|-----|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | シカゴ商業取引所 | S&P 500 FUTU | 買建 | 155 | アメリカドル | 81,084,247.5 | 10,057,690,060 | 81,518,375 | 10,111,539,235 | 3.94 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 | 買建 | 45 | カナダドル | 7,593,902.5 | 724,989,872 | 7,604,100 | 725,963,427 | 0.28 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | SWISS MKT IX | 買建 | 65 | スイスフラン | 6,024,315 | 772,377,426 | 6,094,400 | 781,363,024 | 0.30 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJ EURO STOXX | 買建 | 408 | ユーロ | 14,439,096 | 1,960,107,282 | 14,598,240 | 1,981,711,080 | 0.77 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 FUTU | 買建 | 64 | オーストラリアドル | 8,916,473 | 807,921,619 | 8,982,400 | 813,895,264 | 0.32 |
| | イギリス | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FTSE 100 | 買建 | 123 | イギリスポンド | 8,110,416.25 | 1,568,878,919 | 8,146,290 | 1,575,818,337 | 0.61 |

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

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

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|------------|---------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 56,600,000.00 | 7,020,198,000 | 7,020,098,000 | 2.73 |
| | カナダドル | 買建 | 3,527,000.00 | 336,659,204 | 336,687,420 | 0.13 |
| | ユーロ | 買建 | 10,400,000.00 | 1,411,874,100 | 1,411,800,000 | 0.55 |
| | イギリスポンド | 買建 | 4,876,000.00 | 943,116,988 | 943,115,920 | 0.36 |
| | スイスフラン | 買建 | 3,448,000.00 | 442,062,340 | 442,101,160 | 0.17 |
| | スウェーデンクローナ | 買建 | 9,330,000.00 | 134,370,660 | 134,352,000 | 0.05 |
| | ノルウェークローネ | 買建 | 2,114,000.00 | 32,162,396 | 32,153,940 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----------|----|--------------|-------------|-------------|------|
| デンマーククローネ | 買建 | 4,877,000.00 | 88,765,815 | 88,712,630 | 0.03 |
| オーストラリアドル | 買建 | 3,467,000.00 | 314,027,275 | 314,040,860 | 0.12 |
| 香港ドル | 買建 | 9,158,000.00 | 146,528,000 | 146,436,420 | 0.05 |
| シンガポールドル | 買建 | 752,000.00 | 67,912,368 | 67,920,640 | 0.02 |

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|-------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 93,422,739,014 | 41.77 |
| | イタリア | 21,299,456,551 | 9.52 |
| | フランス | 21,000,633,545 | 9.39 |
| | イギリス | 18,905,181,804 | 8.45 |
| | ドイツ | 16,594,260,337 | 7.42 |
| | スペイン | 11,563,283,309 | 5.17 |
| | オランダ | 5,644,301,935 | 2.52 |
| | ベルギー | 5,583,947,825 | 2.50 |
| | カナダ | 4,643,482,342 | 2.08 |
| | オーストラリア | 3,517,581,574 | 1.57 |
| | オーストリア | 3,506,199,410 | 1.57 |
| | メキシコ | 2,152,348,688 | 0.96 |
| | アイルランド | 1,729,464,338 | 0.77 |
| | デンマーク | 1,517,430,950 | 0.68 |
| | フィンランド | 1,278,803,778 | 0.57 |
| | ポーランド | 1,255,182,590 | 0.56 |
| | マレーシア | 1,169,767,149 | 0.52 |
| | 南アフリカ | 1,131,801,783 | 0.51 |
| | スウェーデン | 1,046,346,693 | 0.47 |
| | シンガポール | 842,469,653 | 0.38 |
| スイス | 688,092,454 | 0.31 | |
| ノルウェー | 628,902,618 | 0.28 | |
| | 小計 | 219,121,678,340 | 97.97 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 4,544,853,111 | 2.03 |
| 合計(純資産総額) | | 223,666,531,451 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|---------|--------|-------------|---------|
| 債券先物取引 | 買建 | アメリカ | 550,857,763 | 0.25 |
| | 買建 | ドイツ | 857,257,177 | 0.38 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|---------|--------|---------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 2,003,844,600 | 0.89 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率 (%) | 償還期限 | 投資比率 (%) |
|--------|------|-------------------|------------|------------|---------------|-----------|---------------|--------|------------|----------|
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 01/15/17 | 12,000,000 | 12,452.45 | 1,494,294,375 | 12,439.61 | 1,492,753,560 | 0.750 | 2017/1/15 | 0.67 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 04/30/17 | 11,600,000 | 12,456.96 | 1,445,007,949 | 12,451.48 | 1,444,372,157 | 0.875 | 2017/4/30 | 0.65 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 08/15/44 | 10,250,000 | 12,767.91 | 1,308,711,425 | 12,812.45 | 1,313,277,136 | 3.125 | 2044/8/15 | 0.59 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 01/31/17 | 10,000,000 | 12,475.95 | 1,247,595,288 | 12,461.90 | 1,246,190,150 | 0.875 | 2017/1/31 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 12/15/16 | 10,000,000 | 12,429.92 | 1,242,992,238 | 12,419.74 | 1,241,974,725 | 0.625 | 2016/12/15 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 04/30/18 | 10,000,000 | 12,275.24 | 1,227,524,648 | 12,283.83 | 1,228,383,625 | 0.625 | 2018/4/30 | 0.55 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.375% 04/30/20 | 10,000,000 | 12,276.04 | 1,227,604,034 | 12,281.65 | 1,228,165,586 | 1.375 | 2020/4/30 | 0.55 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 02/28/17 | 9,500,000 | 12,933.59 | 1,228,691,298 | 12,874.23 | 1,223,052,574 | 3.000 | 2017/2/28 | 0.55 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 12/31/17 | 9,100,000 | 13,011.60 | 1,184,055,804 | 12,961.21 | 1,179,470,200 | 2.750 | 2017/12/31 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 02/15/24 | 9,100,000 | 13,087.78 | 1,190,988,452 | 12,948.12 | 1,178,279,704 | 2.750 | 2024/2/15 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/43 | 9,300,000 | 12,309.72 | 1,144,804,852 | 12,206.55 | 1,135,209,474 | 2.875 | 2043/5/15 | 0.51 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 08/31/16 | 8,700,000 | 12,806.88 | 1,114,199,233 | 12,752.86 | 1,109,499,037 | 3.000 | 2016/8/31 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1% 06/30/19 | 9,000,000 | 12,254.27 | 1,102,885,188 | 12,235.86 | 1,101,228,086 | 1.000 | 2019/6/30 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 08/15/17 | 8,800,000 | 12,448.57 | 1,095,474,765 | 12,433.79 | 1,094,174,279 | 0.875 | 2017/8/15 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 08/15/24 | 8,500,000 | 12,684.05 | 1,078,145,025 | 12,545.96 | 1,066,407,248 | 2.375 | 2024/8/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 05/15/24 | 8,400,000 | 12,824.33 | 1,077,243,793 | 12,689.63 | 1,065,929,014 | 2.500 | 2024/5/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 01/31/20 | 8,520,000 | 12,288.43 | 1,046,975,023 | 12,249.43 | 1,043,651,819 | 1.250 | 2020/1/31 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 05/31/17 | 8,000,000 | 12,928.02 | 1,034,241,640 | 12,870.84 | 1,029,667,670 | 2.750 | 2017/5/31 | 0.46 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 02/15/25 | 8,400,000 | 12,267.22 | 1,030,447,140 | 12,127.33 | 1,018,695,940 | 2.000 | 2025/2/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 11/15/24 | 8,150,000 | 12,535.55 | 1,021,647,345 | 12,404.72 | 1,010,985,229 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.375% 05/15/44 | 7,500,000 | 13,558.15 | 1,016,861,513 | 13,431.44 | 1,007,358,637 | 3.375 | 2044/5/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 08/31/17 | 7,900,000 | 12,721.61 | 1,005,007,210 | 12,688.17 | 1,002,366,032 | 1.875 | 2017/8/31 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.5% 05/31/19 | 8,000,000 | 12,472.59 | 997,807,530 | 12,471.59 | 997,727,370 | 1.500 | 2019/5/31 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1% 09/30/16 | 7,900,000 | 12,500.42 | 987,533,317 | 12,483.70 | 986,212,724 | 1.000 | 2016/9/30 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.625% 08/31/19 | 7,500,000 | 12,543.54 | 940,765,875 | 12,506.47 | 937,985,878 | 1.625 | 2019/8/31 | 0.42 |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 4.25% 03/01/20 | 5,800,000 | 15,619.61 | 905,937,738 | 15,723.85 | 911,983,568 | 4.250 | 2020/3/1 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 08/15/16 | 7,300,000 | 12,440.33 | 908,144,810 | 12,431.37 | 907,490,447 | 0.625 | 2016/8/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 11/15/23 | 6,900,000 | 13,108.02 | 904,453,646 | 12,971.14 | 895,008,927 | 2.750 | 2023/11/15 | 0.40 |
| イギリス | 国債証券 | UKT 4.75% 03/07/20 | 3,950,000 | 22,491.26 | 888,405,118 | 22,260.68 | 879,297,189 | 4.750 | 2020/3/7 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 08/31/17 | 7,000,000 | 12,377.59 | 866,431,510 | 12,366.69 | 865,668,379 | 0.625 | 2017/8/31 | 0.39 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.97 |
| 合計 | 97.97 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|------|-------------------------------|--------------|---------|----|------------|----------------|-------------|----------------|-------------|-----------------|
| 債券先 物取引 | アメリカ | シカゴ商品 取引所 | US 5YR NOTE | 買建 | 19 | アメリカ ドル | 2,267,943.19 | 281,315,673 | 2,269,906.25 | 281,559,171 | 0.13 |
| | アメリカ | シカゴ商品 取引所 | US 10YR NOTE | 買建 | 11 | アメリカ ドル | 1,390,794.01 | 172,514,089 | 1,395,281.25 | 173,070,686 | 0.08 |
| | アメリカ | シカゴ商品 取引所 | US LONG BOND | 買建 | 5 | アメリカ ドル | 753,082.5 | 93,412,353 | 775,781.25 | 96,227,906 | 0.04 |
| | ドイツ | ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所 | EURO-SCHATZ | 買建 | 11 | ユーロ | 1,224,219 | 166,187,729 | 1,224,410 | 166,213,657 | 0.07 |
| | ドイツ | ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所 | EURO-BOBL FU | 買建 | 13 | ユーロ | 1,687,872 | 229,128,624 | 1,694,420 | 230,017,515 | 0.10 |
| | ドイツ | ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所 | EURO-BUND | 買建 | 22 | ユーロ | 3,355,468 | 455,504,781 | 3,396,140 | 461,026,005 | 0.21 |

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

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

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|---------|---------------|--------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 7,870,000.00 | 974,297,079 | 976,037,400 | 0.43 |
| | カナダドル | 買建 | 900,000.00 | 86,266,298 | 85,896,000 | 0.03 |
| | ユーロ | 買建 | 5,400,000.00 | 732,214,031 | 733,050,000 | 0.32 |
| | イギリスポンド | 買建 | 1,080,000.00 | 208,727,635 | 208,861,200 | 0.09 |

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

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

J - R E I Tインデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券 | 日本 | 58,617,744,000 | 99.00 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 592,849,069 | 1.00 |
| 合計(純資産総額) | | 59,210,593,069 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|-------------|---------------|------|-------------|-----------------|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | 日本 | 587,673,000 | 0.99 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|------|------|--------------|-------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 7,928 | 578,564.8 | 4,586,861,757 | 554,000 | 4,392,112,000 | 7.42 |

| | | | | | | | | |
|----|------|--------------------|--------|------------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 7,352 | 566,100.21 | 4,161,968,771 | 556,000 | 4,087,712,000 | 6.90 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人 | 13,645 | 226,917.88 | 3,096,294,567 | 243,000 | 3,315,735,000 | 5.60 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 14,847 | 183,746.4 | 2,728,082,925 | 180,000 | 2,672,460,000 | 4.51 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 9,718 | 253,557.41 | 2,464,070,976 | 244,500 | 2,376,051,000 | 4.01 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 12,553 | 161,344.11 | 2,025,352,663 | 168,800 | 2,118,946,400 | 3.58 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 7,299 | 280,329.46 | 2,046,124,742 | 270,500 | 1,974,379,500 | 3.33 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 4,902 | 401,996.86 | 1,970,588,635 | 401,500 | 1,968,153,000 | 3.32 |
| 日本 | 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人 | 7,412 | 205,594 | 1,523,862,734 | 230,300 | 1,706,983,600 | 2.88 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 2,718 | 602,364.27 | 1,637,226,097 | 612,000 | 1,663,416,000 | 2.81 |
| 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 1,556 | 974,503.94 | 1,516,328,135 | 1,042,000 | 1,621,352,000 | 2.74 |
| 日本 | 投資証券 | GLP投資法人 | 13,423 | 131,342.04 | 1,763,004,210 | 119,300 | 1,601,363,900 | 2.70 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 2,785 | 517,010.75 | 1,439,874,961 | 540,000 | 1,503,900,000 | 2.54 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 17,632 | 75,053.12 | 1,323,336,713 | 80,200 | 1,414,086,400 | 2.39 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 9,350 | 147,824.25 | 1,382,156,817 | 148,900 | 1,392,215,000 | 2.35 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 | 2,273 | 619,163.64 | 1,407,358,974 | 574,000 | 1,304,702,000 | 2.20 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 8,815 | 157,756.63 | 1,390,624,721 | 145,300 | 1,280,819,500 | 2.16 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 2,720 | 418,678.03 | 1,138,804,242 | 440,500 | 1,198,160,000 | 2.02 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 17,792 | 47,748.81 | 849,546,996 | 66,000 | 1,174,272,000 | 1.98 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産オフィスファンド投資法人 | 2,092 | 498,443.04 | 1,042,742,858 | 530,000 | 1,108,760,000 | 1.87 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 4,198 | 251,172.63 | 1,054,422,723 | 261,500 | 1,097,777,000 | 1.85 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 1,980 | 524,136.43 | 1,037,790,133 | 552,000 | 1,092,960,000 | 1.85 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 4,660 | 251,310.2 | 1,171,105,560 | 233,500 | 1,088,110,000 | 1.84 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 1,969 | 533,870.42 | 1,051,190,874 | 489,000 | 962,841,000 | 1.63 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 | 7,073 | 145,624.56 | 1,030,002,534 | 135,800 | 960,513,400 | 1.62 |
| 日本 | 投資証券 | プレミアム投資法人 | 1,479 | 539,392.49 | 797,761,506 | 649,000 | 959,871,000 | 1.62 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 6,121 | 157,703.31 | 965,302,000 | 149,000 | 912,029,000 | 1.54 |
| 日本 | 投資証券 | 福岡リート投資法人 | 4,194 | 206,068.86 | 864,252,836 | 208,500 | 874,449,000 | 1.48 |
| 日本 | 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人 | 5,489 | 151,200.18 | 829,937,822 | 143,200 | 786,024,800 | 1.33 |
| 日本 | 投資証券 | 日本賃貸住宅投資法人 | 9,209 | 79,145.77 | 728,853,457 | 82,100 | 756,058,900 | 1.28 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 99.00 |
| 合計 | 99.00 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|-------------|-------|------------|---------------|-----|----|-------------|-------------|-----------------|
| 不動産投信指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証REIT指数先物 | 買建 | 334 | 円 | 599,601,200 | 587,673,000 | 0.99 |

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|----------|----------------|---------|
| 投資証券 | アメリカ | 39,769,037,653 | 69.89 |
| | オーストラリア | 4,473,671,569 | 7.86 |
| | イギリス | 4,127,856,786 | 7.25 |
| | フランス | 2,791,485,419 | 4.91 |
| | シンガポール | 1,850,647,463 | 3.25 |
| | カナダ | 1,118,121,789 | 1.96 |
| | 香港 | 965,620,960 | 1.70 |
| | オランダ | 322,156,864 | 0.57 |
| | ベルギー | 299,017,312 | 0.53 |
| | スペイン | 286,749,244 | 0.50 |
| | ニュージーランド | 248,160,539 | 0.44 |
| | アイルランド | 140,882,962 | 0.25 |
| | ドイツ | 95,905,751 | 0.17 |
| | イタリア | 57,940,491 | 0.10 |
| | マン島 | 42,405,926 | 0.07 |
| | イスラエル | 25,620,420 | 0.05 |
| | 小計 | 56,615,281,148 | 99.50 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 286,958,596 | 0.50 |
| 合計(純資産総額) | | 56,902,239,744 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|--------|---------------|------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 202,684,700 | 0.35 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|----------|------|-----------------------------|-----------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP | 142,530 | 22,466.52 | 3,202,154,277 | 23,088.80 | 3,290,847,462 | 5.78 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 66,270 | 23,314.49 | 1,545,051,901 | 25,182.60 | 1,668,850,955 | 2.93 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 166,090 | 8,779.72 | 1,458,224,957 | 9,214.93 | 1,530,507,989 | 2.69 |
| フランス | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO SE | 44,940 | 28,596.40 | 1,285,122,432 | 33,197.66 | 1,491,902,953 | 2.62 |
| アメリカ | 投資証券 | HEALTH CARE REIT INC | 160,300 | 8,895.63 | 1,425,970,103 | 8,535.19 | 1,368,191,342 | 2.40 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 60,720 | 19,861.80 | 1,206,008,614 | 21,239.36 | 1,289,654,498 | 2.27 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 152,050 | 8,628.58 | 1,311,976,713 | 8,231.29 | 1,251,568,314 | 2.20 |
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 239,470 | 5,147.39 | 1,232,645,656 | 4,986.40 | 1,194,095,124 | 2.10 |
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES | 70,120 | 16,009.49 | 1,122,585,925 | 15,299.09 | 1,072,772,443 | 1.89 |
| アメリカ | 投資証券 | HCP INC | 211,180 | 5,307.90 | 1,120,923,800 | 4,744.52 | 1,001,949,845 | 1.76 |
| アメリカ | 投資証券 | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 287,910 | 3,251.97 | 936,276,299 | 3,336.67 | 960,662,387 | 1.69 |
| アメリカ | 投資証券 | VORNADO REALTY TRUST | 80,060 | 12,423.47 | 994,623,452 | 11,961.17 | 957,611,847 | 1.68 |
| イギリス | 投資証券 | LAND SECURITIES GROUP PLC | 366,640 | 2,217.54 | 813,039,188 | 2,481.83 | 909,940,058 | 1.60 |
| オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP | 2,437,420 | 327.54 | 798,361,321 | 358.81 | 874,584,320 | 1.54 |
| アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 346,770 | 2,772.10 | 961,282,365 | 2,424.98 | 840,911,008 | 1.48 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST | 29,920 | 25,583.69 | 765,464,293 | 27,757.67 | 830,509,522 | 1.46 |
| オーストラリア | 投資証券 | WESTFIELD CORP | 876,040 | 760.20 | 665,969,936 | 905.19 | 792,986,064 | 1.39 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 1,055,000 | 746.42 | 787,479,027 | 719.20 | 758,756,000 | 1.33 |
| イギリス | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC | 469,060 | 1,455.92 | 682,917,871 | 1,604.58 | 752,646,546 | 1.32 |
| アメリカ | 投資証券 | SL GREEN REALTY CORP | 45,220 | 14,423.13 | 652,214,166 | 14,166.60 | 640,614,032 | 1.13 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 106,180 | 5,873.59 | 623,657,837 | 5,905.54 | 627,050,704 | 1.10 |
| アメリカ | 投資証券 | MACERICH CO/THE | 64,290 | 8,972.66 | 576,852,791 | 9,685.04 | 622,651,427 | 1.09 |
| アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 187,780 | 3,095.67 | 581,305,864 | 3,032.77 | 569,495,053 | 1.00 |
| フランス | 投資証券 | KLEPIERRE | 97,100 | 5,150.98 | 500,160,311 | 5,675.70 | 551,111,198 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 31,420 | 16,635.22 | 522,678,722 | 16,938.90 | 532,220,313 | 0.94 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 62,860 | 8,398.97 | 527,959,855 | 8,017.94 | 504,008,060 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 119,990 | 3,822.42 | 458,652,830 | 4,145.41 | 497,408,562 | 0.87 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 50,950 | 7,466.57 | 380,422,237 | 9,033.83 | 460,273,802 | 0.81 |
| イギリス | 投資証券 | HAMMERSON PLC | 357,720 | 1,196.33 | 427,953,746 | 1,267.03 | 453,242,687 | 0.80 |
| アメリカ | 投資証券 | AMERICAN REALTY CAPITAL PRO | 410,470 | 1,099.29 | 451,226,340 | 1,066.74 | 437,866,410 | 0.77 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 投資証券 | 99.50 |
| 合計 | 99.50 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|------------|---------------|------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 990,000.00 | 122,826,200 | 122,789,700 | 0.21 |
| | ユーロ | 買建 | 70,000.00 | 9,501,730 | 9,502,500 | 0.01 |
| | イギリスポンド | 買建 | 170,000.00 | 32,880,210 | 32,881,400 | 0.05 |
| | オーストラリアドル | 買建 | 200,000.00 | 18,115,000 | 18,116,000 | 0.03 |
| | ニュージーランドドル | 買建 | 40,000.00 | 3,279,880 | 3,280,000 | 0.00 |
| | 香港ドル | 買建 | 330,000.00 | 5,280,000 | 5,276,700 | 0.00 |
| | シンガポールドル | 買建 | 120,000.00 | 10,837,080 | 10,838,400 | 0.01 |

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

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|--------|----------------|---------|
| 社債券 | イギリス | 13,805,776,040 | 47.04 |
| | アイルランド | 10,241,275,772 | 34.90 |
| | ジャージー | 3,730,065,759 | 12.71 |
| | アメリカ | 1,157,865,520 | 3.95 |
| | 小計 | 28,934,983,091 | 98.60 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 412,237,811 | 1.40 |
| 合計(純資産総額) | | 29,347,220,902 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|------------|-----|-----------------------------|-------------|---------------|----------------|--------------|----------------|-----------|------------|-----------------|
| アイルラ ンド | 社債券 | STAR HELIOS 001 04/18/16 | 91,000,000 | 12,256.47 | 11,153,391,508 | 11,254.14 | 10,241,275,772 | 0.000 | 2016/4/18 | 34.90 |
| ジャー ジー | 社債券 | ETFS ALL COMMODITIES | 320,250,000 | 1,290.01 | 4,131,276,240 | 1,164.73 | 3,730,065,759 | 0.000 | 9999/99/99 | 12.71 |
| イギリス | 社債券 | CS USD COM 011 01/29/16 | 18,000,000 | 12,505.71 | 2,251,028,304 | 11,305.00 | 2,034,901,008 | 0.000 | 2016/1/29 | 6.93 |
| イギリス | 社債券 | BAR USD COM 031 10/30/15 | 20,000,000 | 10,884.75 | 2,176,951,616 | 9,845.79 | 1,969,159,808 | 0.000 | 2015/10/30 | 6.71 |
| イギリス | 社債券 | CS USD COM 010 10/27/15 | 20,000,000 | 10,855.98 | 2,171,196,160 | 9,814.04 | 1,962,808,960 | 0.000 | 2015/10/27 | 6.69 |
| イギリス | 社債券 | JBS USD COM 008 09/25/15 | 20,000,000 | 10,338.73 | 2,067,746,800 | 9,343.93 | 1,868,786,640 | 0.000 | 2015/9/25 | 6.37 |
| イギリス | 社債券 | JBS USD COM 009 11/27/15 | 17,000,000 | 11,417.88 | 1,941,039,940 | 10,321.36 | 1,754,632,628 | 0.000 | 2015/11/27 | 5.98 |
| イギリス | 社債券 | JBS USD COM 007 08/12/15 | 17,000,000 | 9,948.00 | 1,691,161,360 | 8,990.41 | 1,528,371,264 | 0.000 | 2015/8/12 | 5.21 |
| イギリス | 社債券 | CS USD COM 009 08/28/15 | 15,000,000 | 10,125.38 | 1,518,807,780 | 9,152.91 | 1,372,936,740 | 0.000 | 2015/8/28 | 4.68 |
| イギリス | 社債券 | BAR USD COM 032 2/26/16 | 12,000,000 | 12,101.09 | 1,452,131,319 | 10,951.49 | 1,314,178,992 | 0.000 | 2016/2/26 | 4.48 |
| アメリカ | 社債券 | IPATH DOW COMM 06/12/36 | 35,930,000 | 3,614.52 | 1,298,699,047 | 3,222.55 | 1,157,865,520 | 0.000 | 2036/6/12 | 3.95 |

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----|---------|
| 社債券 | 98.60 |
| 合計 | 98.60 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

F R Mシグマ リンク マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 社債券 | ケイマン | 16,543,642,500 | 96.43 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 612,870,879 | 3.57 |
| 合計(純資産総額) | | 17,156,513,379 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|-----|------------------------------|----------------|-----------|----------------|----------|----------------|-------|-----------|---------|
| ケイマン | 社債券 | SIGNUM SIGMA2 0% 05/12/25 | 15,750,000,000 | 107.71 | 16,964,928,800 | 105.03 | 16,543,642,500 | 0.000 | 2025/5/12 | 96.43 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----|---------|
| 社債券 | 96.43 |
| 合計 | 96.43 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2013年10月17日
作成基準日：2015年7月31日

基準価額・純資産の推移



| | |
|-------|----------|
| 基準価額 | 10,979円 |
| 純資産総額 | 286.94億円 |

※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

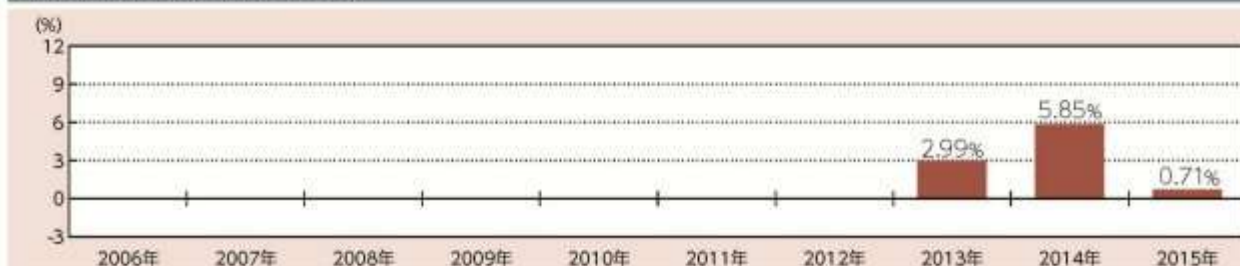
| 決算期 | 2014年7月 | 2015年7月 | - | - | - |
|-----|---------|---------|---|---|---|
| 分配金 | 0円 | 0円 | - | - | - |

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

主要な資産の状況

| 投資信託証券 | 投資比率 |
|--|-------|
| FOFs用FRM ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用) | 11.9% |
| FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 11.8% |
| Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{Asia} JPY | 8.0% |
| ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 8.0% |
| HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス | 7.3% |
| 国内債券インデックス マザーファンド | 7.1% |
| 外国株式インデックス マザーファンド | 6.0% |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 4.7% |
| FOFs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用) | 4.6% |
| TCAファンド(適格機関投資家専用) | 4.0% |

年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2015年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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。

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けませんとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

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

外国投資信託証券

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・信用取引

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

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。（平成25年10月17日設定）

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

(4)【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は平成25年10月17日から平成26年7月10日までとします。

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

(5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定

する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

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

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

1【財務諸表】

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第1期 （平成26年 7月10日現在） | 第2期 （平成27年 7月10日現在） |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 109,004,196 | 223,253,211 |
| 投資信託受益証券 | 2,871,585,216 | 15,558,180,621 |
| 投資証券 | 560,848,350 | 2,972,789,597 |
| 親投資信託受益証券 | 4,544,461,686 | 8,598,150,405 |
| 未収入金 | - | 905,012,365 |
| 未収利息 | 141 | 347 |
| 流動資産合計 | 8,085,899,589 | 28,257,386,546 |
| 資産合計 | 8,085,899,589 | 28,257,386,546 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 17,180,000 | 720,000,000 |
| 未払解約金 | - | 4,662,188 |
| 未払受託者報酬 | 777,698 | 6,018,403 |
| 未払委託者報酬 | 20,686,742 | 160,089,354 |
| その他未払費用 | 77,740 | 601,770 |
| 流動負債合計 | 38,722,180 | 891,371,715 |
| 負債合計 | 38,722,180 | 891,371,715 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 7,745,992,130 | 25,370,143,374 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 301,185,279 | 1,995,871,457 |
| （分配準備積立金） | 149,479,977 | 308,452,236 |
| 元本等合計 | 8,047,177,409 | 27,366,014,831 |
| 純資産合計 | 8,047,177,409 | 27,366,014,831 |
| 負債純資産合計 | 8,085,899,589 | 28,257,386,546 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期 | | 第2期 | |
|---|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
| | 自 | 平成25年10月17日 至 平成26年 7月10日 | 自 | 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | - | | 15,297,943 |
| 受取利息 | | 17,519 | | 106,685 |
| 有価証券売買等損益 | | 181,133,991 | | 409,217,755 |
| 営業収益合計 | | 181,151,510 | | 424,622,383 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 1,141,737 | | 9,131,146 |
| 委託者報酬 | | 30,370,719 | | 242,888,314 |
| その他費用 | | 114,105 | | 912,986 |
| 営業費用合計 | | 31,626,561 | | 252,932,446 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 149,524,949 | | 171,689,937 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 149,524,949 | | 171,689,937 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 149,524,949 | | 171,689,937 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 44,972 | | 10,252,119 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | - | | 301,185,279 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 151,861,149 | | 1,549,643,801 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 151,861,149 | | 1,549,643,801 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 155,847 | | 16,395,441 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 155,847 | | 16,395,441 |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 301,185,279 | | 1,995,871,457 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | 第1期 (平成26年 7月10日現在) | 第2期 (平成27年 7月10日現在) |
|----------------------------|--|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 7,745,992,130口 | 25,370,143,374口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | <p>1口当たり純資産額 1.0389円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (10,389円)</p> | <p>1口当たり純資産額 1.0787円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (10,787円)</p> |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第1期 自 平成25年10月17日 至 平成26年 7月10日 | 第2期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日 | | | | | | | | | | | | | |
|---|---------------------------------------|-------------|--|--------------|---|-------------|--|--|----|--|--|--------------|---|-------------|
| <p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="172 1966 754 2058"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>30,164,804円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 30,164,804円 | <p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="834 1966 1417 2058"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>63,617,388円</td> </tr> </tbody> </table> | | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 63,617,388円 |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 30,164,804円 | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 63,617,388円 | | | | | | | | | | | | |

| 第1期 自 平成25年10月17日 至 平成26年 7月10日 | | | 第2期 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日 | | |
|---------------------------------------|----------------|----------------|---------------------------------------|----------------|-----------------|
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 119,315,173円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 97,820,430円 |
| 収益調整金額 | C | 151,705,302円 | 収益調整金額 | C | 1,687,419,221円 |
| 分配準備積立金額 | D | - 円 | 分配準備積立金額 | D | 147,014,418円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 301,185,279円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,995,871,457円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 7,745,992,130口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 25,370,143,374口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 388円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 786円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | - 円 | 1万口当たり分配金額 | H | - 円 |
| 収益分配金金額 | I=F × H/10,000 | - 円 | 収益分配金金額 | I=F × H/10,000 | - 円 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | 第2期 (平成27年 7月10日現在) |
|----------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 第1期 | 第2期 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 平成25年10月17日 至 平成26年 7月10日 | 自 平成26年 7月11日 至 平成27年 7月10日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 1,000,000円 | 7,745,992,130円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,755,133,400円 | 17,904,927,940円 |
| 期中一部解約元本額 | 10,141,270円 | 280,776,696円 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第1期 (平成26年 7月10日現在) | 第2期 (平成27年 7月10日現在) |
|----|------------------------|------------------------|
| | | 計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |

| | | |
|-----------|-------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 46,100,417 | 25,414,188 |
| 投資証券 | 5,696,380 | 38,987,809 |
| 親投資信託受益証券 | 132,213,163 | 152,585,054 |
| 合計 | 184,009,960 | 166,158,675 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額(円) | 備考 |
|----------|---|---------------|---------------|----|
| 投資信託受益証券 | F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用) | 707,425,553 | 795,641,519 | |
| | F0Fs用MLPインデックスファンド(適格機関投資家専用) | 377,796,380 | 340,092,301 | |
| | TCAファンド(適格機関投資家専用) | 841,374,864 | 834,307,315 | |
| | ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 1,596,822,449 | 1,651,114,412 | |
| | F0Fs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 2,128,841,640 | 2,158,219,654 | |
| | F0Fs用新興国債券セレクトファンド(適格機関投資家専用) | 2,275,492,868 | 2,197,671,011 | |
| | F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用) | 1,201,456,252 | 1,626,411,328 | |
| | F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用) | 533,566,571 | 531,912,514 | |

| | | | |
|-------------|--|---------------------|----------------|
| | FOfs用新興国株式セレクトファンド(適格機関投資家専用) | 1,002,183,582 | 1,025,835,114 |
| | FOfs用日本株配当オープン(適格機関投資家専用) | 324,947,408 | 368,587,844 |
| | FOfs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用) | 2,623,950,267 | 2,682,201,962 |
| | HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス | 1,271,994.5316 | 1,346,185,647 |
| 投資信託受益証券合計 | | 13,615,129,828.5316 | 15,558,180,621 |
| 投資証券 | Global Absolute Return Strategies Fund- Class D <small>A, H, JPY</small> | 1,034,327.056 | 1,985,907,947 |
| | BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY | 99,456.366 | 986,881,650 |
| 投資証券合計 | | 1,133,783.422 | 2,972,789,597 |
| 親投資信託受益証券 | J - R E I T インデックス マザーファンド | 653,268,395 | 895,826,950 |
| | グローバル R E I T インデックス マザーファンド | 389,877,759 | 633,980,223 |
| | 外国株式インデックス マザーファンド | 1,163,631,545 | 2,413,022,734 |
| | 国内債券インデックス マザーファンド | 879,369,821 | 1,161,999,281 |
| | 外国債券インデックス マザーファンド | 767,214,259 | 2,153,570,425 |
| | グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド | 1,247,891,255 | 520,121,075 |
| | F R M シグマ リンク マザーファンド | 791,912,771 | 819,629,717 |
| 親投資信託受益証券合計 | | 5,893,165,805 | 8,598,150,405 |
| 合計 | | | 27,129,120,623 |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「コア投資戦略ファンド(切替型)」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」、「グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド」、「FRM シグマ リンク マザーファンド」の受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。各マザーファンドの平成27年 7月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成27年 7月10日現在 |
|--------------------|-----------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債証券、社債証券 |

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

(貸借対照表に関する注記)

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

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

（その他の注記）

元本の移動

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

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成27年 7月10日現在 |
|----|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成27年 7月10日現在)

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

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

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

（貸借対照表に関する注記）

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 平成27年 7月10日現在 |
|----------------|---------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |

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

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 7月10日現在）

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

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

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

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

有価証券明細表注記

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

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

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

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

(その他の注記)

元本の移動

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

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成27年 7月10日現在）

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

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

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

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

有価証券明細表注記

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

（貸借対照表に関する注記）

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

（金融商品に関する注記）

1.金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

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

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

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

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

有価証券明細表注記

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

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成27年 7月10日現在 |
|-------------------|---------------|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 社債券 |

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成27年 7月10日現在）

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

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

有価証券明細表注記

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

FRMシグマ リンク マザーファンド

貸借対照表

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

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

【純資産額計算書】

（平成27年 7月31日現在）

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 28,789,850,591円 |
| 負債総額 | 95,837,139円 |
| 純資産総額（ - ） | 28,694,013,452円 |
| 発行済口数 | 26,136,393,747口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0979円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,979円） |

（参考）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 7月31日現在）

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

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 7月31日現在）

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

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 7月31日現在)

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

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 7月31日現在)

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 7月31日現在)

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

グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 7月31日現在）

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

FRMシグマ リンク マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 7月31日現在）

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記

載又は記録が行われるよう通知するものとします。

八．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成27年 7月31日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 425 | 7,129,597 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 23 | 80,174 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 合計 | 448 | 7,209,771 |

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

す。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 未払金 | 1,723,999 | 2,578,595 |
| 未払手数料 | 1,169,997 | 1,896,826 |
| その他未払金 | 554,001 | 681,769 |
| 未払費用 | 44,167 | 52,291 |
| 未払法人税等 | 1,467,469 | 924,882 |
| 未払消費税等 | 129,007 | 354,256 |
| 賞与引当金 | 94,659 | 94,769 |
| その他 | 14,376 | 56,222 |
| 流動負債合計 | 3,487,033 | 4,074,887 |
| 固定負債 | | |
| 資産除去債務 | 12,492 | 12,707 |
| 退職給付引当金 | 313,992 | 342,831 |
| 固定負債合計 | 326,485 | 355,538 |
| 負債合計 | 3,813,518 | 4,430,425 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 300,000 | 300,000 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | 350,000 | 350,000 |
| 資本剰余金合計 | 350,000 | 350,000 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 62,500 | 65,500 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 2,100,000 | 2,100,000 |
| 繰越利益剰余金 | 7,452,293 | 10,419,991 |
| 利益剰余金合計 | 9,614,793 | 12,585,491 |
| 株主資本合計 | 10,264,793 | 13,235,491 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 2,715 | 3,235 |
| 評価・換算差額等合計 | 2,715 | 3,235 |
| 純資産合計 | 10,267,508 | 13,238,726 |
| 負債・純資産合計 | 14,081,027 | 17,669,152 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|--|--------------|------------|-------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| | | | |

| | | | |
|-------------------------|-------|-------|------------|
| 当期首残高 | 4,998 | 4,998 | 8,546,410 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 1,753,381 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 2,283 | 2,283 | 2,283 |
| 当期変動額合計 | 2,283 | 2,283 | 1,721,098 |
| 当期末残高 | 2,715 | 2,715 | 10,267,508 |

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

| | 株主資本 | | | | |
|-------------------------|--------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 62,500 | 2,100,000 | 7,452,293 | 9,614,793 | 10,264,793 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 3,000 | | 33,000 | 30,000 | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 3,000,697 | 3,000,697 | 3,000,697 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | | | | | |
| 当期変動額合計 | 3,000 | - | 2,967,697 | 2,970,697 | 2,970,697 |
| 当期末残高 | 65,500 | 2,100,000 | 10,419,991 | 12,585,491 | 13,235,491 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-------------------------|--------------|------------|------------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 2,715 | 2,715 | 10,267,508 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 3,000,697 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 520 | 520 | 520 |
| 当期変動額合計 | 520 | 520 | 2,971,217 |
| 当期末残高 | 3,235 | 3,235 | 13,238,726 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2外国税関連費用

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

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成27年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額（千円） | 配当金の原資 | 1株当たり配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----|-------|------------|--------|-------------|-----|-------|
|----|-------|------------|--------|-------------|-----|-------|

| | | | | | | |
|----------------------|------|--------|-------|--------|------------|------------|
| 平成27年6月30日 定時株主総会 | 普通株式 | 30,000 | 利益剰余金 | 10,000 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月30日 |
|----------------------|------|--------|-------|--------|------------|------------|

（リ - ス取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額(*) | 時価(*) | 差額 |
|----------------------|-------------|-------------|----|
| (1) 現金及び預金 | 12,314,170 | 12,314,170 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 4,518,944 | 4,518,944 | - |
| (3) 投資有価証券 其他有価証券 | 60,274 | 60,274 | - |
| (4) 未払金 | (2,578,595) | (2,578,595) | - |
| (5) 未払法人税等 | (924,882) | (924,882) | - |

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

| 区分 | 平成26年3月31日 | 平成27年3月31日 |
|-------|------------|------------|
| 非上場株式 | - | 3 |

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|----------------|------------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 12,314,170 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 4,518,944 | - | - | - |
| 投資有価証券 投資信託 | - | 1,576 | 16,038 | - |

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

| 区分 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|-------------------------|--------------|------|----|
| 貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの | | | |

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

当事業年度（平成27年3月31日現在）

（単位：千円）

| 区分 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|--------------------------|--------------|--------|-------|
| 貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの | | | |
| その他 | 58,207 | 53,306 | 4,901 |
| 小計 | 58,207 | 53,306 | 4,901 |
| 貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの | | | |
| その他 | 2,066 | 2,186 | 120 |
| 小計 | 2,066 | 2,186 | 120 |
| 合計 | 60,274 | 55,492 | 4,781 |

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|--------|---------|---------|
| 23,757 | 553 | 284 |

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）（単位：千円）

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|--------|---------|---------|
| 34,635 | 1,846 | 117 |

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

| | 前事業年度 （平成26年3月31日） | 当事業年度 （平成27年3月31日） |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | | |

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千円増加しております。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

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

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 又は氏名 | 所在地 | 資本金又は 出資金 (百万円) | 事業の内容 又は職業 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合(%) | 関連 当事者 との関係 | 取引の内 容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|----|----------------|-----|-----------------------|---------------|-------------------------------|-------------------|-----------|--------------|----|--------------|
|----|----------------|-----|-----------------------|---------------|-------------------------------|-------------------|-----------|--------------|----|--------------|

| | | | | | | | | | | |
|-----|----------------------|---------|---------|------|----------|-------|----------|--------|---|---|
| 親会社 | 三井住友トラスト・ホールディングス(株) | 東京都千代田区 | 261,608 | 持株会社 | (直接)100% | 役員の兼任 | 経営指導料の支払 | 73,276 | - | - |
|-----|----------------------|---------|---------|------|----------|-------|----------|--------|---|---|

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 経営指導料
 取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金(百万円) | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(千円) | 科目 | 期末残高(千円) |
|------|-------------|---------|---------------|------------|-------------------|-------------|---------------|-----------|--------|----------|
| 兄弟会社 | 三井住友信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 342,037 | 信託業務及び銀行業務 | - | 営業上の取引役員の兼任 | 投信販売代行手数料等の支払 | 6,745,672 | 未払手数料 | 794,830 |
| | | | | | | | 投資助言費用の支払 | 2,631,233 | その他未払金 | 239,120 |

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 投信販売代行手数料
 ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
 投資助言費用
 各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金(百万円) | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(千円) | 科目 | 期末残高(千円) |
|------|-------------|---------|---------------|------------|-------------------|-------------|---------------|-----------|--------|-----------|
| 兄弟会社 | 三井住友信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 342,037 | 信託業務及び銀行業務 | - | 営業上の取引役員の兼任 | 投信販売代行手数料等の支払 | 8,852,826 | 未払手数料 | 1,374,578 |
| | | | | | | | 投資助言費用の支払 | 3,428,200 | その他未払金 | 381,755 |

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 投信販売代行手数料
 ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
 投資助言費用
 各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(平成27年3月末日現在)

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

(2)販売会社

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

の業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成27年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等による

レーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

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

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月 5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

山田信之

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型）の平成26年7月11日から平成27年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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