

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【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】	債券コア戦略ファンド
【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】	(1)当初自己設定額 50万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したこと等に伴い、平成27年2月3日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前>及び<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新・訂正後>に記載している内容は、当該内容にて原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」及び「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容です。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

（1）ファンドの目的及び基本的性格

<ファンドの特色>を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

<ファンドの特色>

1. 主として国内債券及び国内債券代替資産^{*1}を実質的な投資対象とする投資信託証券(以下「投資対象ファンド^{*2}」)に投資します。

- 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。
- 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、実質組入外貨建資産については投資対象ファンドにおいて原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を目指します。
- 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こともあります。

※1 当ファンドにおいて「国内債券代替資産」(注)とは、対円での為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図った先進国債券、新興国債券及び貸付債権(バンクローン*)等をいいます。

*バンクローンとは、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(Baa格相当未満)を有する企業への変動金利のローンです。詳しくは「ご参考情報」をご参照ください。

2 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。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

(注)当ファンドは国内債券だけでなく、国内債券代替資産にも実質的に投資を行います。

国内債券代替資産に含まれる先進国債券、新興国債券及びバンクローンは国内債券とリターン・リスク特性が一致するものではなく、国内債券に比べ相対的に大きな値動きとなることがあります。

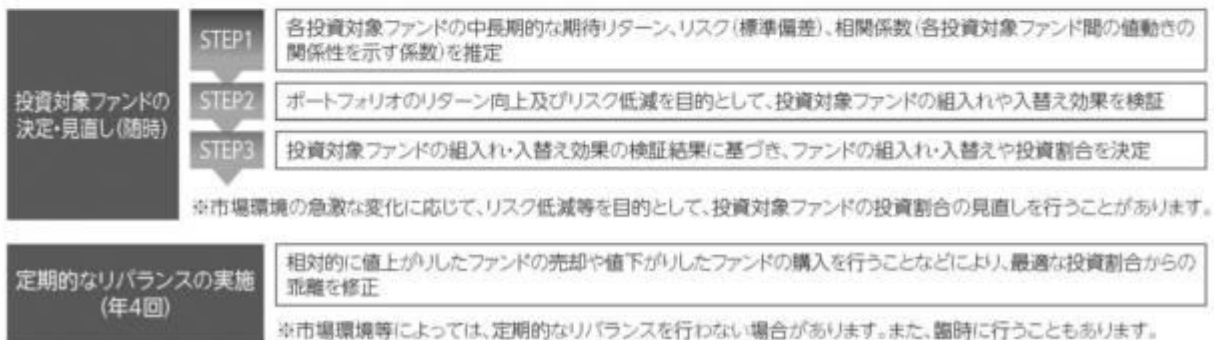
2.

各投資対象ファンドへの投資割合については、定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また、各投資対象ファンドは適宜見直しを行います。

- 各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。
- 投資対象ファンドについては、各投資対象ファンドに係る定性・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ることや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。
- 投資対象ファンドの選定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。

ポートフォリオ構築プロセス

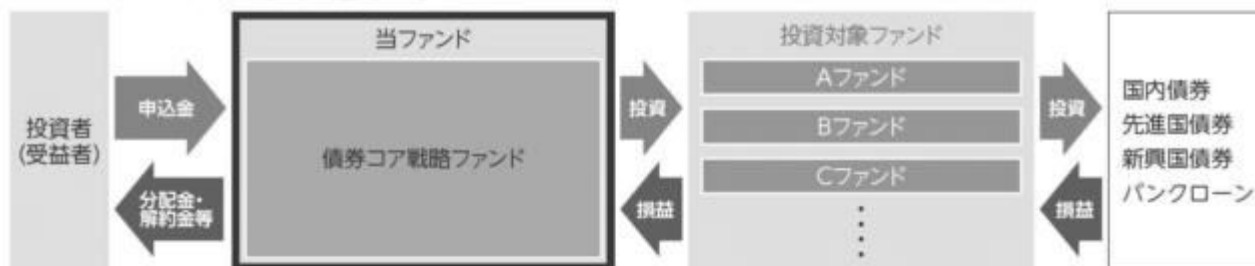
- 投資対象ファンドの選定、及び投資割合の決定は、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券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

- 原則として7月10日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※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。
- 外貨建資産への直接投資は行いません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

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。

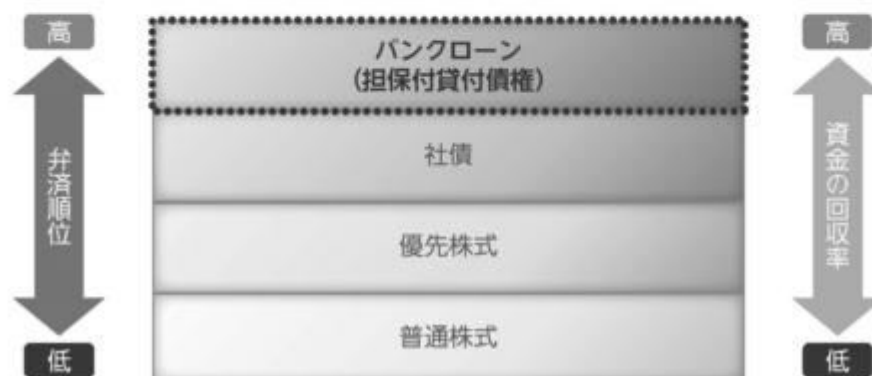
〈ご参考情報〉

一般的なバンクローンの特徴

- 投資適格未満の格付(Baa格相当未満)を有する企業に対するローンです。
- 最上位債務であり、他の債務に優先して金利・元本が支払われます。このため、無担保債務である債券と比較すると相対的にデフォルト(債務不履行)発生時や財務状況悪化時の資産回収率(資産保全性)が高い傾向があります。
- 市場金利に借入企業の信用力に応じた金利が上乗せされる変動金利となっています。

バンクローンの弁済順位

一般的に担保付の債権であり、企業がデフォルトとなった場合でも、他の社債・株式に優先して金利・元本が支払われるため、弁済順位の高い債権とされています。



上記は、一般的なバンクローンの弁済順位のイメージ図であり、全ての場合に当てはまるとは限りません。

(3) ファンドの仕組み

〈訂正前〉

(前略)

委託会社の概況(平成26年11月28日現在)

(後略)

〈訂正後〉

(前略)

委託会社の概況(平成27年7月31日現在)

(後略)

2 投資方針

(2) 投資対象

〈訂正前〉

(前略)

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

投資対象ファンドとして予定しているファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、平成27年2月3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、約款変更等により記載内容が変更となることがあります。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

（中略）

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、 <u>ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）</u> （以下「 <u>NOMURA-BPI総合</u> 」といいます。）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
---------	--

（中略）

「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（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。

（後略）

<訂正後>

（前略）

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

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、平成27年 7月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、約款変更等により記載内容が変更となることがあります。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

（中略）

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、 <u>NOMURA-BPI総合</u> と連動する投資成果を目標として運用を行います。
---------	---

（中略）

「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

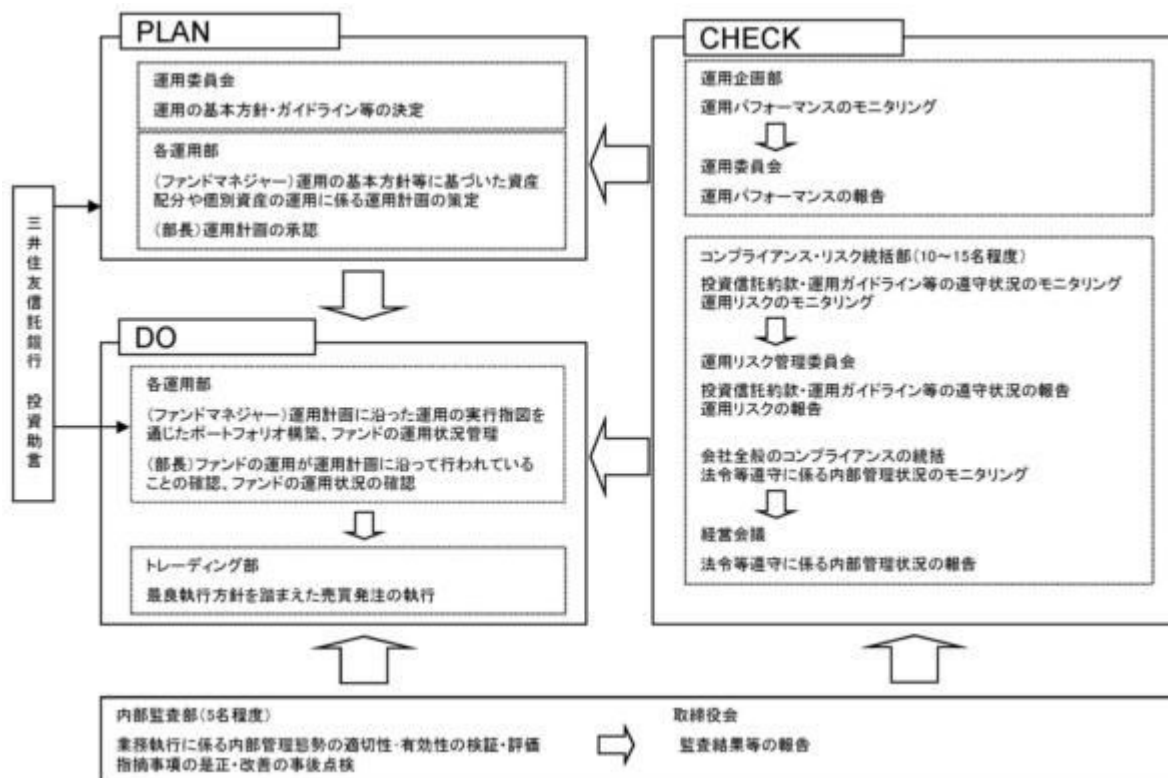
社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

（後略）

（3）運用体制

運用体制の図を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>



3 投資リスク

<訂正前>

(2) リスクの管理体制

（中略）

運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、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。

（後略）

<訂正後>

(2) リスクの管理体制

（中略）

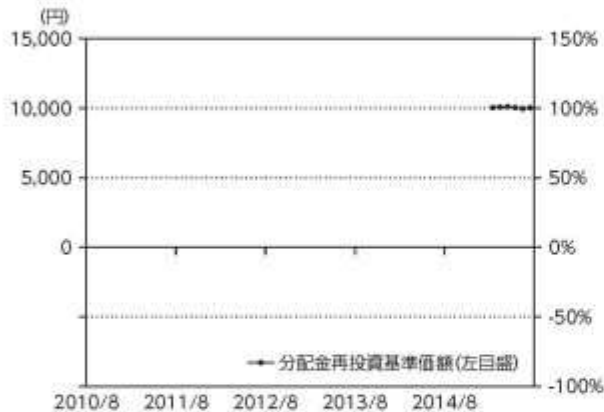
運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

（後略）

〔参考情報〕を以下の内容に更新・訂正します。

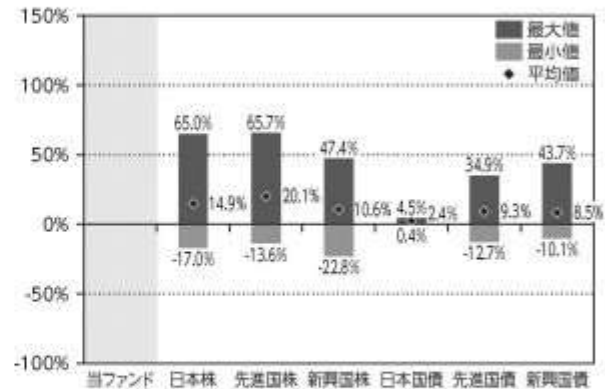
<更新・訂正後>

〔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

*当ファンドは設定から基準日まで1年経過していないため、表示に必要とする年間騰落率のデータが不足しております。従って、当ファンドの年間騰落率は記載していません。

*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

*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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、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。

*当ファンドは設定から基準日まで1年経過していないため、表示に必要とする年間騰落率のデータが不足しております。従って、当ファンドの年間騰落率は記載していません。

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{*1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{*2}

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

日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{*5}

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・レディバース・ファイブ(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買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

※2 MSCIコクサイ・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買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

※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

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

個人の受益者に対する課税

（中略）

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、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。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となります。

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円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5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、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。

（中略）

上記は、平成26年11月28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。

（後略）

<訂正後>

（前略）

個人の受益者に対する課税

（中略）

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。

（中略）

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。

（後略）

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。

債券コア戦略ファンド

（ 1 ）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	122,079	24.34
親投資信託受益証券	日本	372,533	74.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,849	1.37
合計(純資産総額)		501,461	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（ 2 ）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	世界ハインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	189,662	1.0132	192,165	1.0197	193,398	38.57
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	115.1462	1,058.32	121,862	1,060.2	122,079	24.34
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	91,061	1.3214	120,328	1.3247	120,628	24.06
日本	親投資信託受益証券	日本物価連動国債 マザーファンド	48,082	1.0042	48,283	1.0088	48,505	9.67
日本	親投資信託受益証券	マネーパールマザーファンド	9,953	1.0049	10,001	1.0050	10,002	1.99

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	24.34
親投資信託受益証券	74.29
合計	98.63

(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27年 7月10日）	499,638	499,638	9,993	9,993
平成27年 2月末日	502,597		10,052	
3月末日	504,077		10,082	
4月末日	505,540		10,111	
5月末日	502,263		10,045	
6月末日	499,124		9,982	
7月末日	501,461		10,029	

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27年 2月20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27年 2月20日～平成27年 7月10日	0.1

(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27年 2月20日～平成27年 7月10日	500,000		500,000

(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。

日本物価連動国債 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	28,398,263,320	98.38
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		468,367,309	1.62
合計（純資産総額）		28,866,630,629	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 (%)
日本	国債証券	第18回利付国債 (物価連動・10年)	15,020,000,000	105.35	16,250,806,390	106.40	16,428,755,840	0.100	2024/3/10	56.91
日本	国債証券	第19回利付国債 (物価連動・10年)	7,730,000,000	106.73	8,234,086,115	106.90	8,263,370,000	0.100	2024/9/10	28.63
日本	国債証券	第20回利付国債 (物価連動・10年)	3,460,000,000	107.45	3,713,398,161	106.90	3,706,137,480	0.100	2025/3/10	12.84

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.38
合計	98.38

(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。

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

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	25,188,031,000	19.62
	シンガポール	13,892,784,360	10.82
	アメリカ	12,449,918,542	9.70
	ベルギー	11,278,477,611	8.79
	フランス	10,998,029,580	8.57
	ポーランド	10,166,959,377	7.92
	スペイン	6,079,489,087	4.74
	イタリア	6,041,015,705	4.71
	フィリピン	5,993,644,740	4.67
	リトアニア	5,853,774,322	4.56
	イギリス	5,851,068,662	4.56

	ルーマニア	5,754,550,011	4.48
	アイルランド	3,548,795,439	2.76
	ウルグアイ	837,918,109	0.65
	小計	123,934,456,545	96.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,414,204,853	3.44
合計(純資産総額)		128,348,661,398	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	売建		99,241,654,666	77.32

(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 (%)
日本	国債証券	第10回利付国債 (30年)	19,350,000,000	101.06	19,556,434,400	101.72	19,684,174,500	1.100	2033/3/20	15.34
シンガポール	国債証券	SIGB 2.25% 06/01/21	126,900,000	9,243.04	11,729,428,018	9,046.73	11,480,310,445	2.250	2021/6/1	8.94
ベルギー	国債証券	BGB 0.8% 06/22/25	84,300,000	13,094.98	11,039,070,539	13,378.97	11,278,477,611	0.800	2025/6/22	8.79
アメリカ	国債証券	T 1% 11/30/19	90,000,000	12,150.45	10,935,407,829	12,146.22	10,931,606,437	1.000	2019/11/30	8.52
フランス	国債証券	FRTR 0.5% 05/25/25	67,000,000	12,932.78	8,664,966,618	13,014.48	8,719,707,127	0.500	2025/5/25	6.79
スペイン	国債証券	SPGB 1.6% 04/30/25	46,000,000	13,093.49	6,023,007,585	13,216.28	6,079,489,087	1.600	2025/4/30	4.74
イギリス	国債証券	UKT 2% 09/07/25	30,500,000	19,230.28	5,865,237,755	19,183.83	5,851,068,662	2.000	2025/9/7	4.56
フィリピン	国債証券	PHILIP 4% 01/15/21	42,500,000	13,578.72	5,770,957,899	13,425.15	5,705,692,702	4.000	2021/1/15	4.45
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 09/01/24	35,300,000	15,577.55	5,498,876,021	15,800.28	5,577,499,502	3.750	2024/9/1	4.35
日本	国債証券	第9回利付国債 (30年)	5,150,000,000	107.77	5,550,304,900	106.87	5,503,856,500	1.400	2032/12/20	4.29
ポーランド	国債証券	POLAND 3% 03/17/23	41,300,000	12,413.73	5,126,870,896	12,322.69	5,089,271,706	3.000	2023/3/17	3.97
ポーランド	国債証券	POLAND 6.375% 07/15/19	34,700,000	14,645.55	5,082,008,729	14,392.36	4,994,149,336	6.375	2019/7/15	3.89
ルーマニア	国債証券	ROMANI 6.75% 02/07/22	26,600,000	15,168.99	4,034,952,978	14,618.23	3,888,451,318	6.750	2022/2/7	3.03

リトニア	国債証券	LITHUN 7.375% 02/11/20	24,000,000	15,261.26	3,662,702,736	14,867.62	3,568,228,912	7.375	2020/2/11	2.78
アイルランド	国債証券	IRISH 3.4% 03/18/24	21,900,000	16,414.67	3,594,814,622	16,204.54	3,548,795,439	3.400	2024/3/18	2.76
シンガポール	国債証券	SIGB 3.125% 09/01/22	24,500,000	9,714.67	2,380,096,285	9,466.41	2,319,271,040	3.125	2022/9/1	1.81
リトニア	国債証券	LITHUN 6.125% 03/09/21	15,900,000	14,582.93	2,318,685,922	14,374.49	2,285,545,410	6.125	2021/3/9	1.78
ルーマニア	国債証券	ROMANI 4.875% 01/22/24	14,000,000	13,666.26	1,913,276,687	13,329.27	1,866,098,693	4.875	2024/1/22	1.45
フランス	国債証券	FRTR 2.25% 05/25/24	10,200,000	15,420.71	1,572,912,986	15,292.78	1,559,863,610	2.250	2024/5/25	1.22
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/31/20	8,100,000	12,849.65	1,040,821,872	12,680.90	1,027,153,678	2.125	2020/8/31	0.80
ウルグアイ	国債証券	URUGUA 7.875% 01/15/33	5,000,000	16,896.72	844,836,440	16,758.36	837,918,109	7.875	2033/1/15	0.65
フランス	国債証券	FRTR 1.75% 11/25/24	4,900,000	14,371.10	704,184,255	14,662.42	718,458,843	1.750	2024/11/25	0.56
イタリア	国債証券	BTPS 1.35% 04/15/22	3,400,000	13,420.24	456,288,330	13,632.82	463,516,203	1.350	2022/4/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.375% 03/31/20	2,500,000	12,366.41	309,160,397	12,296.67	307,416,909	1.375	2020/3/31	0.24
フィリピン	国債証券	PHILIP 9.875% 01/15/19	1,200,000	16,001.16	192,013,920	15,675.43	188,105,172	9.875	2019/1/15	0.15
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	1,500,000	12,249.44	183,741,693	12,249.43	183,741,518	1.250	2020/1/31	0.14
フィリピン	国債証券	PHILIP 6.375% 10/23/34	600,000	17,260.16	103,560,996	16,641.14	99,846,866	6.375	2034/10/23	0.08
シンガポール	国債証券	SIGB 2.5% 06/01/19	1,000,000	9,379.82	93,798,215	9,320.28	93,202,875	2.500	2019/6/1	0.07
ポーランド	国債証券	POLAND 5.125% 04/21/21	600,000	14,066.13	84,396,816	13,923.05	83,538,335	5.125	2021/4/21	0.07

(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	96.56
合計	96.56

(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	売建	334,476,510.00	40,967,751,428	41,481,776,769	32.31
	ユーロ	売建	279,729,300.00	37,955,851,290	37,973,252,475	29.58
	イギリスポンド	売建	30,159,810.00	5,795,834,729	5,832,907,254	4.54
	シンガポールドル	売建	154,543,340.00	14,042,822,512	13,953,718,168	10.87

(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。

マネープールマザーファンド

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	60,047,300	75.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,633,448	24.64
合計(純資産総額)		79,680,748	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(%)
日本	国債証券	第332回利付国債(2年)	40,000,000	100.08	40,032,000	100.01	40,004,400	0.100	2015/9/15	50.21
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	10,000,000	100.39	10,039,500	100.35	10,035,100	0.400	2016/6/20	12.59
日本	国債証券	第340回利付国債(2年)	10,000,000	100.08	10,008,800	100.07	10,007,800	0.100	2016/5/15	12.56

(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	75.36
合計	75.36

(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：2015年2月20日
作成基準日：2015年7月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

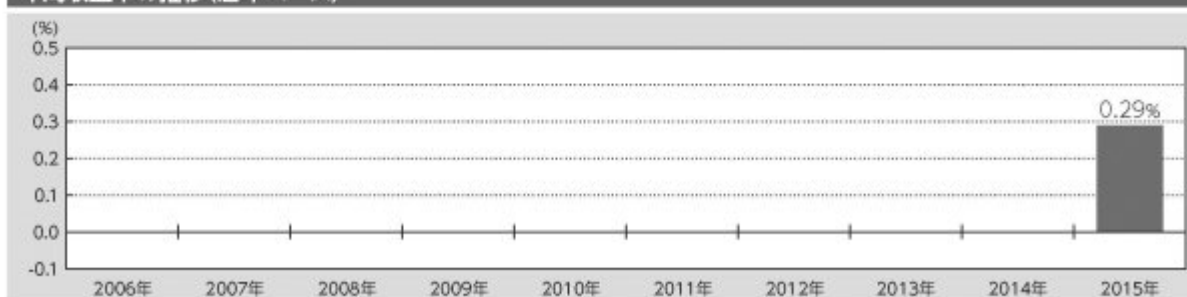
設定来分配金合計額:0円

決算期	2015年7月	-	-	-	-
分配金	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
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	38.6%
HYFI Loan Fund-JPY-USD クラス	24.3%
国内債券インデックス マザーファンド	24.1%
日本物価連動国債 マザーファンド	9.7%
マネープールマザーファンド	2.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2015年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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1期計算期間(平成27年 2月20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

債券コア戦略ファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

		第1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		8,000
投資信託受益証券		121,862
親投資信託受益証券		370,777
流動資産合計		500,639
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		23
未払委託者報酬		978
流動負債合計		1,001
純資産の部		
元本等		
元本		500,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		362
(分配準備積立金)		1,787
元本等合計		499,638
純資産合計		499,638
負債純資産合計		500,639

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

		第1期 自 平成27年 2月20日 至 平成27年 7月10日
営業収益		
有価証券売買等損益		639
営業収益合計		639
営業費用		
受託者報酬		23
委託者報酬		978
営業費用合計		1,001

第1期
自 平成27年 2月20日
至 平成27年 7月10日

営業利益又は営業損失（ ）	362
経常利益又は経常損失（ ）	362
当期純利益又は当期純損失（ ）	362
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	362

(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)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. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、平成27年 2月20日から平成27年 7月10日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第1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	500,000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 362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 (1万口当たり純資産額) 0.9993円 (9,993円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成27年 2月20日 至 平成27年 7月10日		
分配金の計算過程		
項目		

第1期 自 平成27年 2月20日 至 平成27年 7月10日		
費用控除後の配当等収益額	A	1,787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	- 円
収益調整金額	C	- 円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,787円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	35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

(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1期 自 平成27年 2月20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1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1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 自 平成27年 2月20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	500,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 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	1,862
親投資信託受益証券	1,223
合計	639

（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	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	115,1462	121,862	
投資信託受益証券合計		115,1462	121,862	
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	91,061	120,328	
	日本物価連動国債 マザーファンド	48,082	48,283	
	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	189,662	192,165	
	マネープールマザーファンド	9,953	10,001	
親投資信託受益証券合計		338,758	370,777	
合計			492,639	

(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）

「債券コア戦略ファンド」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「日本物価連動国債 マザーファンド」、「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」、「マネープールマザーファンド」

の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <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	債券先物取引 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。 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。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 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	246,004,897,539口
2. 担保資産	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。 有価証券 105,918,000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 1.3214円 (1万口当たり純資産額) (13,214円)

(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	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。

	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27年 2月20日
期首元本額	229,368,377,569円
期中追加設定元本額	26,079,624,214円
期中一部解約元本額	9,443,104,244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25	79,995,825円
マイセレクション50	87,954,578円
マイセレクション75	26,371,191円
D Cマイセレクション25	13,964,068,254円
D Cマイセレクション50	17,348,004,741円
D Cマイセレクション75	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S25	5,624,723,964円
D CマイセレクションS50	6,463,518,036円
D CマイセレクションS75	1,263,603,664円
D Cターゲット・イヤーフアンド2015	11,207,686円
D Cターゲット・イヤーフアンド2025	1,224,121,061円
D Cターゲット・イヤーフアンド2035	676,399,360円
D Cターゲット・イヤーフアンド2045	175,103,711円
D C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
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	203,385,953円
マイセレクション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

区分	平成27年 7月10日現在
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)		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	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37回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,232,632,800	
第38回利付国債(30年)	950,000,000	1,033,020,500	
第39回利付国債(30年)	740,000,000	820,060,600	
第40回利付国債(30年)	720,000,000	780,573,600	
第41回利付国債(30年)	580,000,000	615,385,800	
第42回利付国債(30年)	710,000,000	752,813,000	
第43回利付国債(30年)	940,000,000	997,039,200	
第44回利付国債(30年)	680,000,000	720,024,800	
第45回利付国債(30年)	680,000,000	687,010,800	
第46回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,070,992,200	
第47回利付国債(30年)	100,000,000	103,346,000	

第 3 3 回利付国債（20年）	140,000,000	146,309,800	
第 3 4 回利付国債（20年）	50,000,000	52,939,000	
第 3 5 回利付国債（20年）	10,000,000	10,554,200	
第 3 6 回利付国債（20年）	70,000,000	74,558,400	
第 3 7 回利付国債（20年）	70,000,000	74,711,000	
第 3 8 回利付国債（20年）	20,000,000	21,434,000	
第 3 9 回利付国債（20年）	500,000,000	534,510,000	
第 4 0 回利付国債（20年）	100,000,000	107,243,000	
第 4 1 回利付国債（20年）	330,000,000	347,648,400	
第 4 2 回利付国債（20年）	80,000,000	87,513,600	
第 4 3 回利付国債（20年）	140,000,000	156,602,600	
第 4 4 回利付国債（20年）	170,000,000	189,145,400	
第 4 5 回利付国債（20年）	290,000,000	321,308,400	
第 4 6 回利付国債（20年）	170,000,000	187,547,400	
第 4 7 回利付国債（20年）	90,000,000	99,756,000	
第 4 8 回利付国債（20年）	130,000,000	146,835,000	
第 4 9 回利付国債（20年）	140,000,000	155,747,200	
第 5 0 回利付国債（20年）	220,000,000	242,325,600	
第 5 1 回利付国債（20年）	100,000,000	111,115,000	
第 5 2 回利付国債（20年）	110,000,000	123,304,500	
第 5 3 回利付国債（20年）	80,000,000	90,029,600	
第 5 4 回利付国債（20年）	200,000,000	226,350,000	
第 5 5 回利付国債（20年）	140,000,000	157,141,600	
第 5 6 回利付国債（20年）	150,000,000	168,696,000	
第 5 7 回利付国債（20年）	240,000,000	268,269,600	
第 5 8 回利付国債（20年）	300,000,000	336,129,000	
第 5 9 回利付国債（20年）	200,000,000	221,574,000	
第 6 0 回利付国債（20年）	350,000,000	380,075,500	
第 6 1 回利付国債（20年）	240,000,000	253,567,200	
第 6 2 回利付国債（20年）	320,000,000	333,043,200	
第 6 3 回利付国債（20年）	200,000,000	223,856,000	
第 6 4 回利付国債（20年）	320,000,000	361,340,800	
第 6 5 回利付国債（20年）	220,000,000	248,958,600	
第 6 6 回利付国債（20年）	330,000,000	370,725,300	
第 6 7 回利付国債（20年）	130,000,000	147,351,100	
第 6 8 回利付国債（20年）	190,000,000	220,267,000	
第 6 9 回利付国債（20年）	390,000,000	448,831,500	
第 7 0 回利付国債（20年）	400,000,000	471,856,000	
第 7 1 回利付国債（20年）	200,000,000	232,456,000	
第 7 2 回利付国債（20年）	630,000,000	728,122,500	
第 7 3 回利付国債（20年）	360,000,000	413,686,800	
第 7 4 回利付国債（20年）	200,000,000	231,650,000	
第 7 5 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回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	232,586,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	103,759,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	105,108,000	
平成26年度第1回大阪市公募公債（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	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	102,367,000	
	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	
	100,000,000	104,917,000	

第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,312,000	
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 8 7 6 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 1 1 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 1 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,465,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,690,000	
第 4 3 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 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	109,617,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	21,115,800	
第 1 9 0 回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,055,000	
第 1 9 1 回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,060,000	
第 1 9 7 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 1 0 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 1 4 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 1 5 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 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,783,000	46,456,348	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,977,000	47,941,526	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,505,000	48,370,704	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,871,000	54,574,408	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,602,000	57,441,511	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,867,000	58,562,841	
第 3 3 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63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,117,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,142,000	177,569,240
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,959,000	89,982,057
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,387,000	91,457,564
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,761,000	91,971,485
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,303,000	90,321,064
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,427,000	89,429,078
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,547,000	93,002,618
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,798,500
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,588,000	92,539,265
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,974,000	95,568,738
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,215,000	96,858,410
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,022,000	97,193,468
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,897,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,020,000	196,167,801
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,954,000	97,499,851
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,738,000	194,589,017
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,639,000	98,566,007
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,259,000	98,586,023
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,666,000	99,673,973
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,626,000
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,063,000
第146回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,662,000
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,498,000

	第11回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,445,000	
	い第736号商工債	100,000,000	100,358,000	
	い第738号商工債	100,000,000	100,398,000	
	い第741号商工債	100,000,000	100,481,000	
	い第750号商工債	100,000,000	100,356,000	
	い第752号商工債	200,000,000	200,734,000	
	い第756号商工債	100,000,000	100,371,000	
	い第740号農林債	100,000,000	100,487,000	
	い第743号農林債	100,000,000	100,474,000	
	い第746号農林債	100,000,000	100,334,000	
	い第748号農林債	100,000,000	100,375,000	
	い第749号農林債	300,000,000	300,822,000	
	い第752号農林債	200,000,000	200,582,000	
	第265回信金中金債(5年)	300,000,000	301,557,000	
	第267回信金中金債(5年)	200,000,000	200,994,000	
	第274回信金中金債(5年)	100,000,000	100,353,000	
	第290回信金中金債(5年)	100,000,000	100,458,000	
	第299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JPMorgan・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・パリバ円貨社債	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回ウエストバック・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。

日本物価連動国債 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	698,688,388
国債証券	27,268,225,260
未収利息	7,750,657
前払費用	825,106
流動資産合計	27,975,489,411
資産合計	27,975,489,411
負債の部	
流動負債	
未払解約金	33,315
流動負債合計	33,315
負債合計	33,315
純資産の部	
元本等	
元本	27,857,414,206
剰余金	
剰余金又は欠損金()	118,041,890
元本等合計	27,975,456,096
純資産合計	27,975,456,096
負債純資産合計	27,975,489,411

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	<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>

（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	27,857,414,206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 1.0042円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (10,042円)</p>

（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、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>
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	(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27年 2月20日
期首元本額	21,579,173,721円
期中追加設定元本額	6,297,029,610円
期中一部解約元本額	18,789,125円
期末元本額	27,857,414,206円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	17,252,514,204円
日本物価連動国債ファンド(SMA専用)	513,647,919円

区分	平成27年 7月10日現在
債券コア戦略ファンド	48,082円
F O F s 用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	9,682,298,389円
F O F s 用 日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）	408,905,612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	72,631,419
合計	72,631,419

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本物価連動国債 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
国債証券	第18回利付国債（物価連動・10年）	15,020,000,000	16,358,785,170	
	第19回利付国債（物価連動・10年）	7,730,000,000	8,224,217,550	
	第20回利付国債（物価連動・10年）	2,520,000,000	2,685,222,540	
合計		25,270,000,000	27,268,225,260	

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。

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

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	96,082
コール・ローン	4,401,218,207
国債証券	117,701,204,713
派生商品評価勘定	1,192,584,328
未収利息	599,834,104
前払費用	230,666,297
流動資産合計	124,125,603,731
資産合計	124,125,603,731
負債の部	
流動負債	
未払解約金	401,947
流動負債合計	401,947
負債合計	401,947
純資産の部	
元本等	
元本	122,502,828,206
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,622,373,578
元本等合計	124,125,201,784
純資産合計	124,125,201,784
負債純資産合計	124,125,603,731

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>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	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	122,502,828,206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 1.0132円 (1万口当たり純資産額) (10,132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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い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27年 2月20日
期首元本額	91,972,919,158円
期中追加設定元本額	33,592,401,930円
期中一部解約元本額	3,062,492,882円
期末元本額	122,502,828,206円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	69,679,452,208円
世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（SMA専用）	921,899,477円
債券コア戦略ファンド	189,662円
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）	38,277,741,528円
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）	11,994,068,550円
FOFs用 世界ハイインカム入替戦略ファンドS（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,629,476,781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	1,087,648,466
合計	1,087,648,466

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「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」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)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	売建	94,870,489,079	-	93,677,904,751	1,192,584,328
	アメリカドル	38,835,871,155	-	38,568,785,724	267,085,431
	カナダドル	9,204,511,887	-	8,981,615,286	222,896,601
	ユーロ	15,687,424,981	-	15,482,509,416	204,915,565
	イギリスポンド	11,938,947,076	-	11,610,270,105	328,676,971
	シンガポールドル	19,203,733,980	-	19,034,724,220	169,009,760
合計		94,870,489,079	-	93,677,904,751	1,192,584,328

(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	円	第9回利付国債(30年)	5,050,000,000	5,365,827,000	
		第10回利付国債(30年)	18,630,000,000	18,825,056,100	
		第139回利付国債(20年)	110,000,000	120,782,200	
円 小計			23,790,000,000	24,311,665,300	
	アメリカドル	LITHUN 6.125% 03/09/21	15,900,000.00	18,493,528.50	
		LITHUN 7.375% 02/11/20	23,000,000.00	27,640,480.00	
		PHILIP 4% 01/15/21	41,000,000.00	44,535,430.00	
		PHILIP 6.375% 10/23/34	600,000.00	804,747.00	
		PHILIP 9.875% 01/15/19	1,200,000.00	1,520,742.00	
		POLAND 3% 03/17/23	39,300,000.00	38,998,765.50	
		POLAND 5.125% 04/21/21	600,000.00	672,231.00	
		POLAND 6.375% 07/15/19	32,700,000.00	37,966,989.00	
		ROMANI 4.875% 01/22/24	14,000,000.00	14,937,090.00	
		ROMANI 6.75% 02/07/22	26,600,000.00	31,306,471.00	
		T 1.25% 01/31/20	1,500,000.00	1,483,505.86	
		T 1.375% 03/31/20	2,500,000.00	2,482,128.90	
		T 1% 11/30/19	86,800,000.00	85,130,117.29	
T 2.125% 08/31/20	8,100,000.00	8,293,957.00			

アメリカドル 小計		293,800,000.00	314,266,183.05 (38,230,481,168)
カナダドル	CAN 1.5% 06/01/23	93,600,000.00	94,488,732.00
カナダドル 小計		93,600,000.00	94,488,732.00 (9,043,516,539)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	14,300,000.00	13,726,069.50
	FRTR 0.5% 05/25/25	65,000,000.00	60,846,175.00
	FRTR 1.75% 11/25/24	4,400,000.00	4,652,780.00
	FRTR 2.25% 05/25/24	9,700,000.00	10,717,336.00
	IRISH 3.4% 03/18/24	21,400,000.00	24,858,561.00
ユーロ 小計		114,800,000.00	114,800,921.50 (15,455,648,061)
イギリスポ ンド	UKT 2% 07/22/20	31,800,000.00	32,618,214.00
	UKT 2% 09/07/25	29,500,000.00	29,258,100.00
イギリスポンド 小計		61,300,000.00	61,876,314.00 (11,568,395,665)
シンガポ ールドル	SIGB 2.25% 06/01/21	120,900,000.00	122,156,755.50
	SIGB 2.5% 06/01/19	62,100,000.00	64,691,433.00
	SIGB 3.125% 09/01/22	23,500,000.00	24,832,685.00
シンガポールドル 小計		206,500,000.00	211,680,873.50 (19,091,497,980)
合計			117,701,204,713 (93,389,539,413)

有価証券明細表注記

- 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。
- 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。
- 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。
- 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 14銘柄	100.0%	40.9%
カナダドル	国債証券 1銘柄	100.0%	9.7%
ユーロ	国債証券 5銘柄	100.0%	16.5%
イギリスポンド	国債証券 2銘柄	100.0%	12.4%
シンガポールドル	国債証券 3銘柄	100.0%	20.4%

(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。

マネープールマザーファンド

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	28,752,799
国債証券	60,052,500
未収利息	15,027
前払費用	1,479
流動資産合計	88,821,805
資産合計	88,821,805
負債の部	
流動負債	
未払解約金	176
流動負債合計	176
負債合計	176
純資産の部	
元本等	
元本	88,384,819
剰余金	
剰余金又は欠損金()	436,810
元本等合計	88,821,629
純資産合計	88,821,629
負債純資産合計	88,821,805

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	<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>

(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		88,384,819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 (1万口当たり純資産額)	1.0049円 (10,049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、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。	

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	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27年 2月20日
期首元本額	127,589,562円
期中追加設定元本額	10,484,461円
期中一部解約元本額	49,689,204円
期末元本額	88,384,819円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348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・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	1,005,802円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	6,379,762円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	12,459,876円

区分	平成27年 7月10日現在
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン(円コース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(豪ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(ユーロコース)(SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
欧州REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,953円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
SLI GARSファンド(米ドルコース)(SMA専用)	4,976円
ブルーベイ クレジットLSファンド(米ドルコース)(SMA専用)	9,952円
マルチ・ストラテジー・ファンド50(適格機関投資家専用)	149,402円
私募マネーブルファンドAL(適格機関投資家専用)	46,126,877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	27,800
合計	27,800

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「マネーパブルマザーファンド」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
国債証券	第332回利付国債(2年)	40,000,000	40,006,800	
	第340回利付国債(2年)	10,000,000	10,008,300	
	第97回利付国債(5年)	10,000,000	10,037,400	
合計		60,000,000	60,052,500	

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

債券コア戦略ファンド

純資産額計算書

(平成27年 7月31日現在)

資産総額	501,611円
負債総額	150円
純資産総額(-)	501,461円
発行済口数	500,000口

1口当たり純資産額（ / ）	1.0029円
（1万口当たり純資産額）	（10,029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）

日本物価連動国債 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	28,866,656,620円
負債総額	25,991円
純資産総額（ - ）	28,866,630,629円
発行済口数	28,614,062,978口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0088円
（1万口当たり純資産額）	（10,088円）

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

純資産額計算書

（平成27年 7月31日現在）

資産総額	129,057,292,282円
負債総額	708,630,884円
純資産総額（ - ）	128,348,661,398円
発行済口数	125,864,502,699口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0197円
（1万口当たり純資産額）	（10,197円）

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 7月31日現在)

資産総額	81,230,893円
負債総額	1,550,145円
純資産総額(-)	79,680,748円
発行済口数	79,287,856口
1口当たり純資産額(/)	1.0050円
(1万口当たり純資産額)	(10,050円)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 訂正前 >

(1) 資本金の額（平成26年11月28日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

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、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。

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

[CHECK（検証・評価）]

（中略）

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

（中略）

委託会社の機構は平成27年2月3日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

(1) 資本金の額（平成27年 7月31日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

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。

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

[CHECK（検証・評価）]

（中略）

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。

（中略）

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

<訂正前>

（前略）

平成26年11月28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	393	5,857,717
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	6	38,402
単位型公社債投資信託	0	0
合計	399	5,896,118

<訂正後>

（前略）

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

<更新・訂正後>

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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 ずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				
預り金		13,353		13,868
未払金		1,723,999		2,578,595

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

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成25年4月 1日		(自 平成26年4月 1日	
	至 平成26年3月31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
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
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381
当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998	4,998	8,546,410

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

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 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

5 その他

<訂正前>

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成27年2月3日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

<訂正後>

(1) 定款の変更

委託会社は、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

< 訂正前 >

(1) 受託会社

(中略)

資本金の額：342,037百万円（平成26年9月末日現在）

(中略)

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年9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。

< 訂正後 >

(1) 受託会社

(中略)

資本金の額：342,037百万円（平成27年3月末日現在）

(中略)

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成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。

3 資本関係

< 訂正前 >

(前略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成26年9月末日現在）

(後略)

<訂正後>

（前略）

(参考)再信託受託会社

（中略）

資本金の額　：51,000百万円（平成27年3月末日現在）

（後略）

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

中島紀子

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」に掲げられている債券コア戦略ファンドの平成27年2月20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、債券コア戦略ファンドの平成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。

[次へ](#)

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。