

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年4月8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】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【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】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

債券コア戦略ファンド

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方からの取得申込み及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）からの取得申込み（以下「確定拠出年金によるお申込み」といいます。）については1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

平成28年 4月 9日から平成28年10月11日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

アイルランドの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり (フル ヘッジ) なし	日経225 T O P I X その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ ショ ー ト型/絶 対収益追求型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマ ー ジ ング				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(債 券一般、その 他資産(バンク ローン))資産 配分変更型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1) ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2) ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

1.

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。

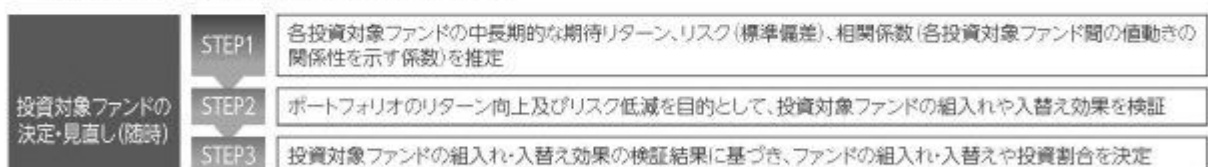
2.

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。



※市場環境の急激な変化に応じて、リスク低減等を目的として、投資対象ファンドの投資割合の見直しを行うことがあります。

定期的なリバランスの実施
(年4回)

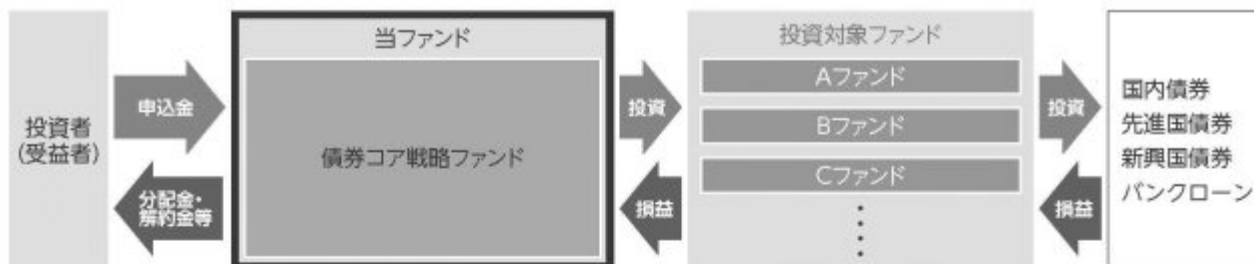
相対的に値上がりしたファンドの売却や値下がりしたファンドの購入を行うことなどにより、最適な投資割合からの乖離を修正

※市場環境等によっては、定期的なリバランスを行わない場合があります。また、臨時に行うこともあります。

※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。

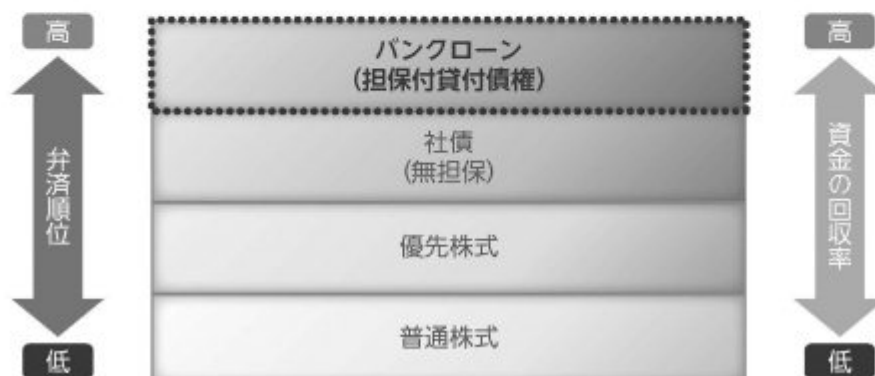
〈ご参考情報〉

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。

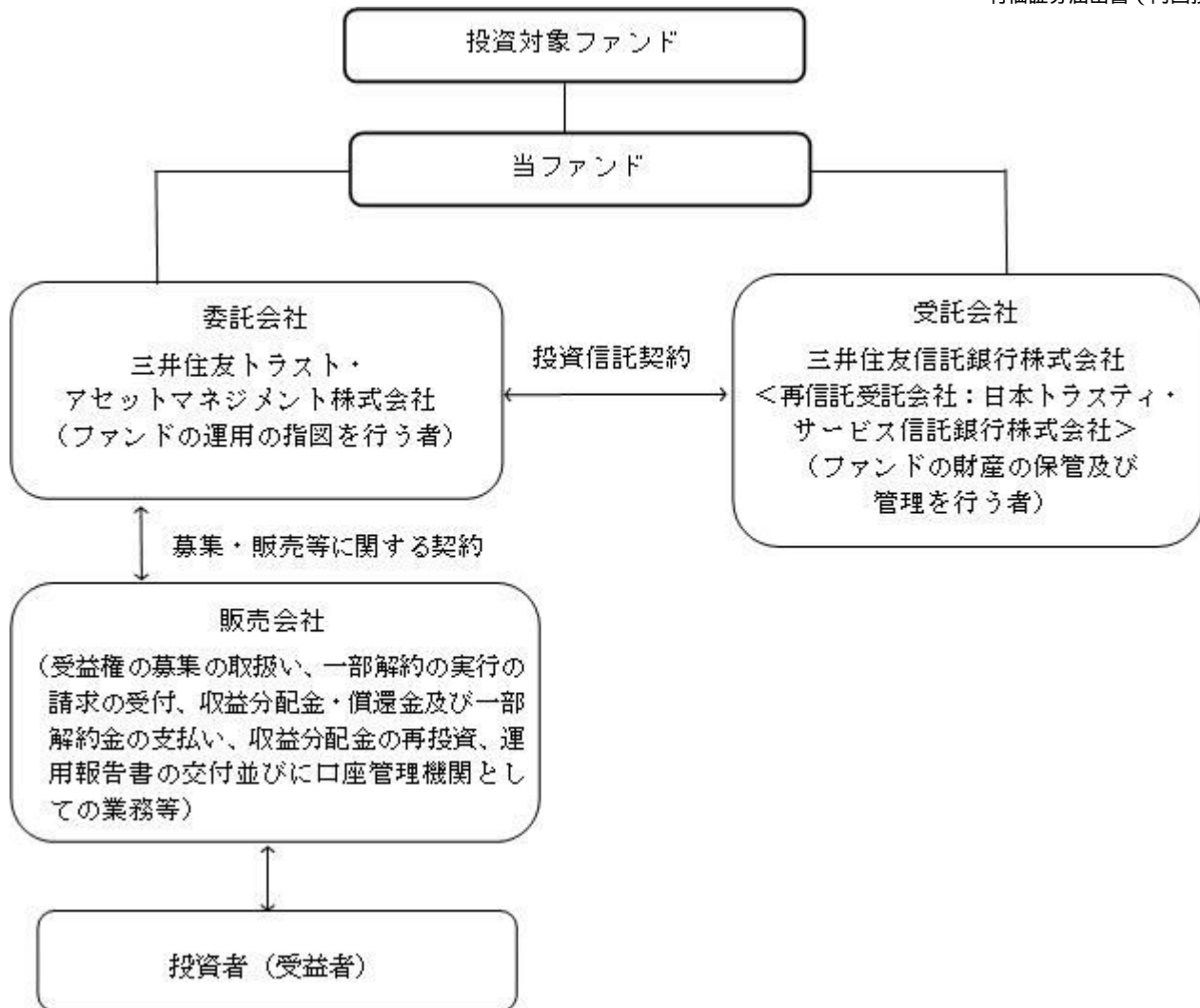
(2) 【ファンドの沿革】

平成27年 2月20日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成28年 1月29日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

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

投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、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。

投資態度

イ．主として国内債券及び国内債券代替資産 を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資します。

この投資信託において「国内債券代替資産」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。

ロ．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。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。

ハ．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。

ニ．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。

ホ．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。

ヘ．この投資信託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。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

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28年 1月29日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、各投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとに作成しており、各投資対象ファンド中に記載の定義は、当該ファンドに限定されます。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合 と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成12年5月30日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

2. 日本物価連動国債 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の物価連動国債
投資態度	<p>主としてわが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。</p> <p>運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。</p> <p>債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年4月3日

信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

3. 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

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、日本を含む世界各国の債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への投資割合を決定します。</p> <p>運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。</p> <p>債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	解約時：0.1%
設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

4.HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

投資顧問会社	Credit Suisse Asset Management, LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米ドル建の貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）に投資します。 また、ハイイールド債券等にも投資します。
投資態度	主として米ドル建のバンクローンに投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。 ポートフォリオの構築は、個別銘柄の信用力、割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。 米ドル建以外の資産に投資した場合、当該資産については原則として対米ドルでの為替予約取引等を行いません。 米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。
主な投資制限	第一順位担保権付のバンクローンへの投資割合は、投資信託財産の純資産総額の80%以上とします。 組入比率上位3業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の15%を上限とします。その他の業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の12%を上限とします。 組入比率上位10銘柄への投資割合の合計は、投資信託財産の純資産総額の20%を上限とします。 投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。 投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。 受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。
ベンチマーク	クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。

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

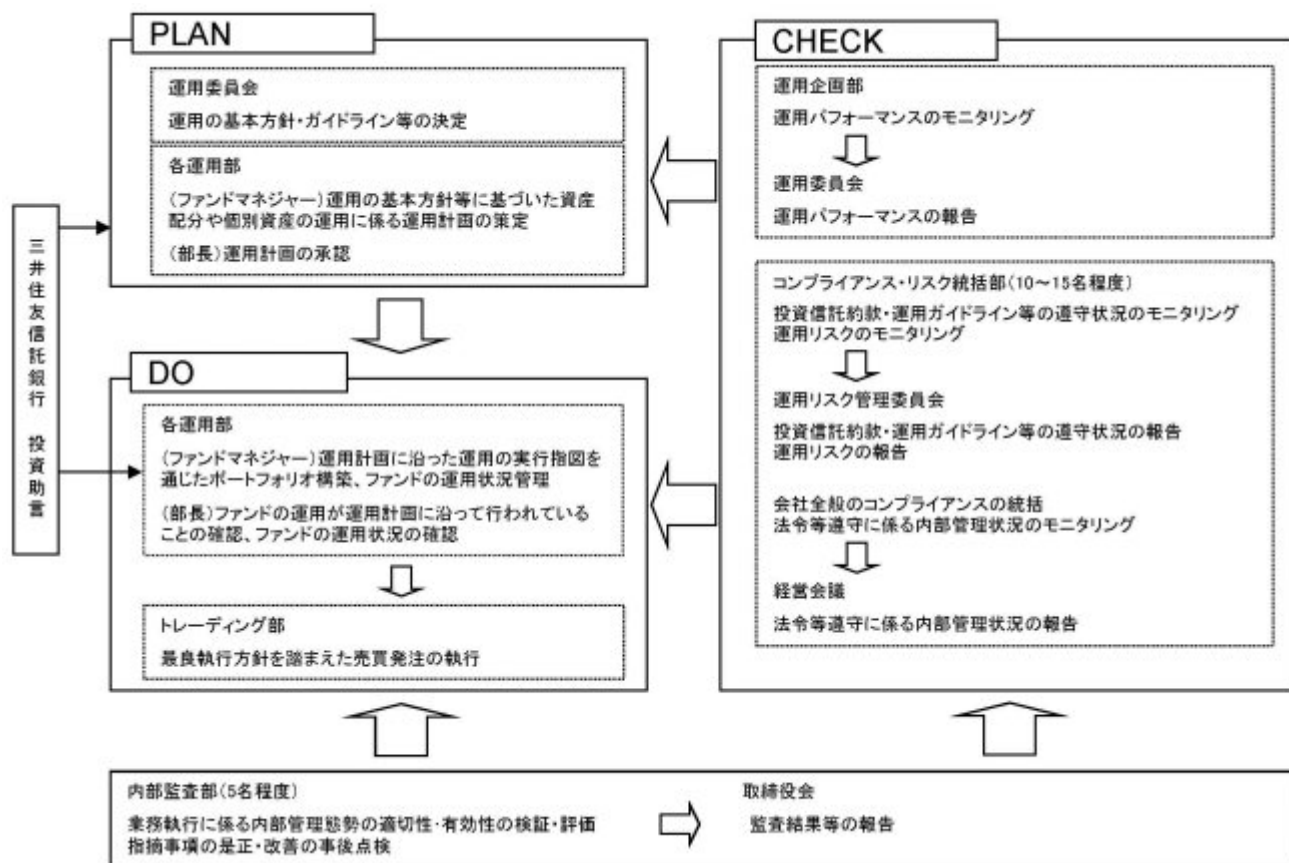
5. マネープールマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、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も投資します。
投資態度	<p>主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>決算日</p>	<p>毎年11月20日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>平成22年2月26日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>運用再委託会社 又は助言会社</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年7月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・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。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（金融商品取引法第2条第1項第10号に規定する投資信託又は外国投資信託の受益証券をいいます。）への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への直接投資は行いません。

ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ．資金の借入れ

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

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

（ハ）収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ト．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他の投資制限>

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

金利変動リスク

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

為替変動リスク

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為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかることにご留意ください。

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファ

ンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

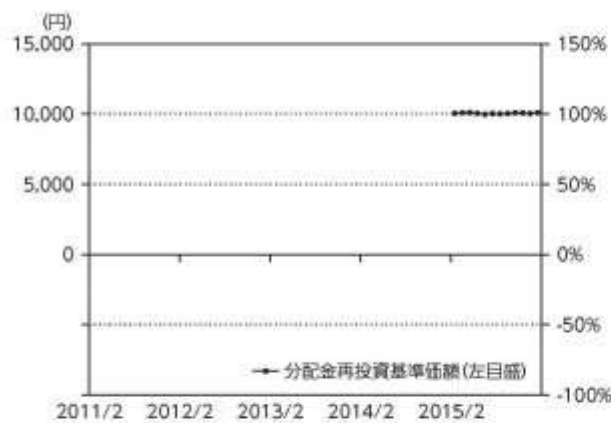
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

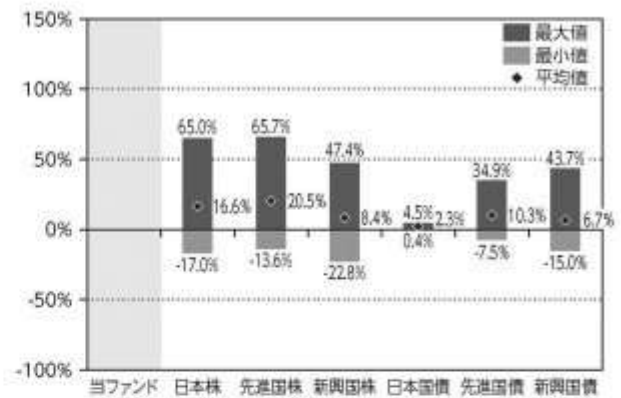
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【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

*2011年2月～2016年1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… JPMオルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)^{*6}

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

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

※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全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※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しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.54%（税抜 0.5%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1836% （税抜 0.17%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.324% （税抜 0.3%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.0324% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

税抜における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

(参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
日本物価連動国債 マザーファンド	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	ありません。
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 0.65%（税抜 0.65%）
マネープールマザーファンド	ありません。

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

実質的な信託報酬率：年率0.54%～1.19%（税抜 0.5%～1.15%）

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び

譲渡所得等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です。

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。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、平成28年 1月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成28年 1月29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	257,617	16.79
親投資信託受益証券	日本	1,031,991	67.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		244,636	15.95
合計(純資産総額)		1,534,244	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	世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	581,712	1.0325	600,665	1.0489	610,157	39.77
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	192,248	1.3333	256,328	1.3604	261,534	17.05
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	248.1691	1,051.14	260,862	1,038.07	257,617	16.79
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	150,735	1.0003	150,783	0.9971	150,297	9.80
日本	親投資信託受益証券	マネーブルマザーファンド	9,953	1.0049	10,001	1.0051	10,003	0.65

(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	16.79
親投資信託受益証券	67.26

合計	84.05
----	-------

(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	
8月末日	500,453		10,009	
9月末日	501,931		10,039	
10月末日	504,134		10,083	
11月末日	588,688		10,074	
12月末日	595,416		10,039	
平成28年 1月末日	1,534,244		10,102	

【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
第2期中間計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 1月10日	0.7

(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
第2期中間計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 1月10日	546,715		1,046,715

(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	269,328,935,300	80.85
	ポーランド	201,350,000	0.06
	メキシコ	100,640,000	0.03
	小計	269,630,925,300	80.94
地方債証券	日本	19,476,187,184	5.85
特殊債券	日本	25,998,466,767	7.80
	アメリカ	208,610,000	0.06
	小計	26,207,076,767	7.87
社債券	日本	14,280,071,860	4.29
	オーストラリア	504,566,000	0.15
	オランダ	403,910,000	0.12
	スウェーデン	402,418,000	0.12
	フランス	201,080,000	0.06
	アメリカ	100,887,000	0.03
	小計	15,892,932,860	4.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,929,857,551	0.58
合計(純資産総額)		333,136,979,662	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	752,100,000	0.23

(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125回利付国債(5年)	5,130,000,000	100.27	5,144,188,300	100.78	5,170,475,700	0.100	2020/9/20	1.55
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	4,560,000,000	100.13	4,565,928,000	100.66	4,590,141,600	0.100	2019/12/20	1.38
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	100.89	4,429,202,700	0.300	2018/6/20	1.33
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	4,340,000,000	100.06	4,342,604,000	100.70	4,370,510,200	0.100	2020/3/20	1.31
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	4,250,000,000	100.62	4,276,350,000	100.91	4,288,845,000	0.200	2019/6/20	1.29
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	4,250,000,000	100.66	4,278,361,900	100.77	4,283,107,500	0.200	2018/12/20	1.29
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	4,220,000,000	100.64	4,247,008,000	100.86	4,256,334,200	0.200	2019/3/20	1.28
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	3,920,000,000	100.62	3,944,304,000	100.96	3,957,788,800	0.200	2019/9/20	1.19
日本	国債証券	第355回利付国債(2年)	3,940,000,000	100.18	3,947,238,500	100.26	3,950,559,200	0.100	2017/8/15	1.19
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,480,000,000	99.95	3,478,504,800	103.12	3,588,645,600	0.400	2025/6/20	1.08
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	3,513,265,000	0.200	2017/6/20	1.05
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,340,000,000	100.08	3,342,672,000	103.17	3,446,178,600	0.400	2025/3/20	1.03
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	3,210,000,000	104.39	3,351,071,400	105.72	3,393,740,400	0.800	2022/9/20	1.02
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	100.44	3,274,604,800	0.200	2017/9/20	0.98
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	3,210,000,000	100.08	3,212,846,500	100.74	3,233,946,600	0.100	2020/6/20	0.97
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	104.09	3,164,336,000	0.500	2024/9/20	0.95
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,040,000,000	100.83	3,065,494,700	103.05	3,132,963,200	0.400	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	2,850,000,000	100.64	2,868,408,300	100.72	2,870,634,000	0.200	2018/9/20	0.86
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,600,000,000	102.32	2,660,320,000	104.89	2,727,270,000	0.600	2024/6/20	0.82
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,600,000,000	102.50	2,665,000,000	104.85	2,726,126,000	0.600	2023/12/20	0.82
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,470,000,000	104.34	2,577,427,600	106.21	2,623,510,500	0.800	2023/6/20	0.79

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	102.95	2,563,554,600	1.500	2017/12/20	0.77
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	100.42	2,510,550,000	0.300	2017/3/20	0.75
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	105.30	2,274,652,800	1.300	2019/12/20	0.68
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	104.15	2,187,150,000	1.500	2018/9/20	0.66
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	2,060,000,000	102.39	2,109,234,000	104.87	2,160,425,000	0.600	2024/3/20	0.65
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	102.88	2,150,359,200	1.700	2017/9/20	0.65
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	105.54	2,131,908,000	0.800	2022/6/20	0.64
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	1,990,000,000	104.21	2,073,779,000	106.34	2,116,305,300	0.800	2023/9/20	0.64
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	2,020,000,000	102.75	2,075,550,000	104.64	2,113,889,600	0.600	2023/3/20	0.63

(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	80.94
地方債証券	5.85
特殊債券	7.87
社債券	4.77
合計	99.42

(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	5円		747,851,620	752,100,000	0.23

(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	28,345,892,600	97.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		736,265,335	2.53
合計(純資産総額)		29,082,157,935	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	105.25	16,251,189,400	0.100	2024/3/10	55.88
日本	国債証券	第19回利付国債(物価連動・10年)	7,070,000,000	106.69	7,527,897,034	105.50	7,458,850,000	0.100	2024/9/10	25.65
日本	国債証券	第20回利付国債(物価連動・10年)	4,400,000,000	107.30	4,716,877,113	105.15	4,635,853,200	0.100	2025/3/10	15.94

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.47
合計	97.47

(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	オーストリア	14,426,198,747	11.27
	ベルギー	12,970,254,471	10.13
	フランス	12,952,261,242	10.12
	アメリカ	12,850,026,067	10.04
	イギリス	12,432,305,645	9.71
	日本	12,273,436,600	9.59
	ポーランド	10,100,063,336	7.89
	フィンランド	8,718,655,377	6.81
	スペイン	6,239,622,913	4.87
	イタリア	6,190,601,656	4.84
	ルーマニア	6,097,188,701	4.76
	リトアニア	6,063,194,618	4.74
	フィリピン	6,062,390,893	4.74
	小計	127,376,200,266	99.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		655,835,728	0.51
合計(純資産総額)		128,032,035,994	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		115,149,317,235	89.94

(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(%)
オーストリア	国債証券	RAGB 1.2% 10/20/25	103,800,000	13,817.77	14,342,848,380	13,898.07	14,426,198,747	1.200	2025/10/20	11.27
ベルギー	国債証券	BGB 0.8% 06/22/25	97,200,000	13,170.40	12,801,636,611	13,343.88	12,970,254,471	0.800	2025/6/22	10.13
日本	国債証券	第10回利付国債(30年)	11,350,000,000	102.28	11,609,296,500	107.93	12,250,282,000	1.100	2033/3/20	9.57
イギリス	国債証券	UKT 1.5% 01/22/21	66,400,000	17,428.70	11,572,658,945	17,665.52	11,729,905,728	1.500	2021/1/22	9.16
アメリカ	国債証券	T 1% 11/30/19	93,000,000	11,850.76	11,021,209,712	11,978.16	11,139,697,858	1.000	2019/11/30	8.70

フランス	国債証券	FRTR 0.5% 05/25/25	84,300,000	12,516.54	10,551,451,347	13,043.72	10,995,860,283	0.500	2025/5/25	8.59
フィンランド	国債証券	RFGB 1.5% 04/15/23	50,000,000	14,265.24	7,132,620,135	14,414.19	7,207,097,930	1.500	2023/4/15	5.63
スペイン	国債証券	SPGB 1.6% 04/30/25	46,900,000	12,731.74	5,971,190,334	13,304.10	6,239,622,913	1.600	2025/4/30	4.87
フィリピン	国債証券	PHILIP 4% 01/15/21	45,400,000	13,132.64	5,962,220,968	13,137.96	5,964,635,951	4.000	2021/1/15	4.66
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 09/01/24	34,400,000	15,254.36	5,247,502,554	15,817.04	5,441,064,594	3.750	2024/9/1	4.25
ポーランド	国債証券	POLAND 3% 03/17/23	42,300,000	12,012.65	5,081,351,835	11,919.17	5,041,809,758	3.000	2023/3/17	3.94
ポーランド	国債証券	POLAND 6.375% 07/15/19	36,400,000	13,974.22	5,086,619,229	13,675.47	4,977,872,369	6.375	2019/7/15	3.89
ルーマニア	国債証券	ROMANI 6.75% 02/07/22	29,900,000	14,287.24	4,271,885,143	14,294.93	4,274,184,755	6.750	2022/2/7	3.34
リトアニア	国債証券	LITHUN 7.375% 02/11/20	26,900,000	14,492.90	3,898,592,592	14,309.49	3,849,254,726	7.375	2020/2/11	3.01
リトアニア	国債証券	LITHUN 6.125% 03/09/21	15,800,000	14,070.47	2,223,135,319	14,012.27	2,213,939,892	6.125	2021/3/9	1.73
ルーマニア	国債証券	ROMANI 4.875% 01/22/24	13,300,000	13,073.33	1,738,753,145	13,132.58	1,746,633,929	4.875	2024/1/22	1.36
フィンランド	国債証券	RFGB 1.625% 09/15/22	10,400,000	14,433.49	1,501,083,239	14,534.20	1,511,557,447	1.625	2022/9/15	1.18
フランス	国債証券	FRTR 2.25% 05/25/24	8,200,000	14,719.10	1,206,966,527	15,144.56	1,241,854,517	2.250	2024/5/25	0.97
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/31/20	7,600,000	12,357.74	939,188,909	12,486.43	948,969,260	2.125	2020/8/31	0.74
フランス	国債証券	FRTR 1.75% 11/25/24	4,900,000	14,095.86	690,697,357	14,582.58	714,546,442	1.750	2024/11/25	0.56
イギリス	国債証券	UKT 2% 07/22/20	3,880,000	17,874.27	693,521,760	18,103.09	702,399,917	2.000	2020/7/22	0.55
イタリア	国債証券	BTPS 1.35% 04/15/22	5,000,000	13,218.38	660,919,390	13,624.21	681,210,789	1.350	2022/4/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	2,800,000	11,955.03	334,740,964	12,077.79	338,178,206	1.250	2020/1/31	0.26
アメリカ	国債証券	T 1.375% 03/31/20	2,500,000	11,995.40	299,885,081	12,126.42	303,160,610	1.375	2020/3/31	0.24
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/19	1,000,000	11,850.09	118,500,948	12,002.01	120,020,133	1.000	2019/9/30	0.09
フィリピン	国債証券	PHILIP 6.375% 10/23/34	600,000	16,170.35	97,022,107	16,292.49	97,754,942	6.375	2034/10/23	0.08
ポーランド	国債証券	POLAND 5.125% 04/21/21	600,000	13,573.82	81,442,931	13,396.86	80,381,209	5.125	2021/4/21	0.06
ルーマニア	国債証券	ROMANI 4.375% 08/22/23	600,000	12,706.45	76,238,752	12,728.33	76,370,017	4.375	2023/8/22	0.06
イタリア	国債証券	BTPS 1.45% 09/15/22	500,000	13,497.33	67,486,663	13,665.25	68,326,273	1.450	2022/9/15	0.05
日本	国債証券	第147回利付国債（20年）	20,000,000	109.67	21,935,400	115.77	23,154,600	1.600	2033/12/20	0.02

(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	99.49
合計	99.49

(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	344,681,500.00	40,884,740,804	41,651,312,460	32.53
	ユーロ	売建	462,532,600.00	59,106,347,155	61,132,933,742	47.75
	イギリスポンド	売建	71,256,100.00	12,400,378,430	12,365,071,033	9.66

(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	20,022,600	2.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		815,531,169	97.60
合計(純資産総額)		835,553,769	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97回利付国債 (5年)	10,000,000	100.24	10,024,200	100.17	10,017,900	0.400	2016/6/20	1.20
日本	国債証券	第340回利付国債 (2年)	10,000,000	100.05	10,005,800	100.04	10,004,700	0.100	2016/5/15	1.20

(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	2.40
合計	2.40

(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

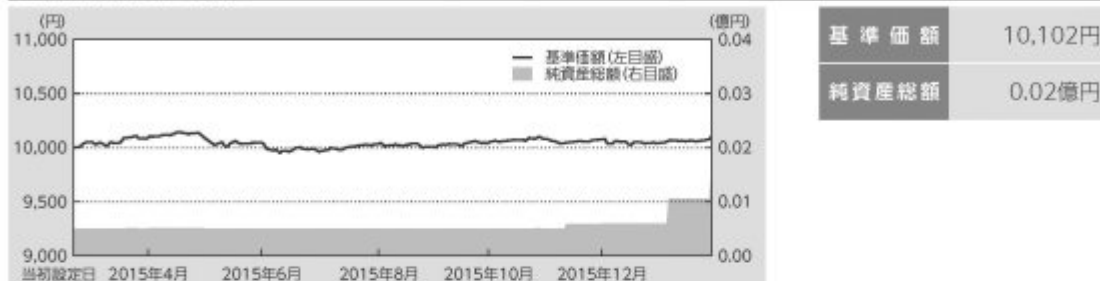
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2015年2月20日

作成基準日：2016年1月29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	39.8%
国内債券インデックス マザーファンド	17.0%
HYFI Loan Fund-JPY-USD グラス	16.8%
日本物価連動国債 マザーファンド	9.8%
マネープールマザーファンド	0.7%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2016年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

ただし、確定拠出年金によるお申込みは1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

アイルランドの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

< 解約価額 >

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

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。

< 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、振り込まれることとなります。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

アイルランドの銀行休業日

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投

資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

外国投資信託受益証券

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成27年 2月20日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は平成27年2月20日から平成27年7月10日までとします。

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

し、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

ます。

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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
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
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
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		
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

第1期 自 平成27年 2月20日 至 平成27年 7月10日		
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	35円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 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。
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

	第1期 (平成27年 7月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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> <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>

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

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第343回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,301,404,000	
	第344回利付国債(2年)	1,560,000,000	1,561,825,200	
	第345回利付国債(2年)	2,060,000,000	2,062,575,000	
	第346回利付国債(2年)	590,000,000	590,784,700	
	第349回利付国債(2年)	1,850,000,000	1,852,941,500	
	第350回利付国債(2年)	1,030,000,000	1,031,709,800	
	第351回利付国債(2年)	130,000,000	130,227,500	
	第353回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,603,072,000	
	第354回利付国債(2年)	200,000,000	200,378,000	
	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	2,612,324,000	
	第100回利付国債(5年)	490,000,000	491,739,500	
	第101回利付国債(5年)	950,000,000	955,453,000	
	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	2,289,804,000	
	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	2,512,600,000	
	第104回利付国債(5年)	810,000,000	812,721,600	
	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	3,513,510,000	
	第106回利付国債(5年)	3,260,000,000	3,273,529,000	

第107回利付国債（5年）	1,120,000,000	1,125,040,000	
第108回利付国債（5年）	590,000,000	591,215,400	
第109回利付国債（5年）	1,190,000,000	1,192,546,600	
第110回利付国債（5年）	700,000,000	705,250,000	
第111回利付国債（5年）	1,590,000,000	1,606,186,200	
第112回利付国債（5年）	900,000,000	909,891,000	
第113回利付国債（5年）	4,390,000,000	4,425,383,400	
第114回利付国債（5年）	1,210,000,000	1,220,393,900	
第115回利付国債（5年）	2,660,000,000	2,674,390,600	
第116回利付国債（5年）	4,200,000,000	4,223,772,000	
第117回利付国債（5年）	4,520,000,000	4,545,718,800	
第118回利付国債（5年）	4,880,000,000	4,907,767,200	
第119回利付国債（5年）	700,000,000	701,232,000	
第120回利付国債（5年）	4,240,000,000	4,262,980,800	
第121回利付国債（5年）	530,000,000	530,662,500	
第122回利付国債（5年）	4,900,000,000	4,904,312,000	
第123回利付国債（5年）	4,640,000,000	4,642,134,400	
第124回利付国債（5年）	760,000,000	760,000,000	
第1回利付国債（40年）	150,000,000	185,086,500	
第2回利付国債（40年）	300,000,000	354,933,000	
第3回利付国債（40年）	420,000,000	497,280,000	
第4回利付国債（40年）	530,000,000	627,901,600	
第5回利付国債（40年）	490,000,000	553,205,100	
第6回利付国債（40年）	690,000,000	758,268,600	
第7回利付国債（40年）	1,090,000,000	1,132,270,200	
第8回利付国債（40年）	550,000,000	521,400,000	
第282回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,285,401,600	
第283回利付国債（10年）	280,000,000	285,978,000	
第284回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,239,524,000	
第285回利付国債（10年）	1,990,000,000	2,046,894,100	
第286回利付国債（10年）	870,000,000	900,284,700	
第287回利付国債（10年）	540,000,000	559,845,000	
第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,167,204,600	
第289回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,580,013,500	
第290回利付国債（10年）	470,000,000	487,385,300	
第291回利付国債（10年）	840,000,000	868,820,400	
第292回利付国債（10年）	1,110,000,000	1,159,983,300	
第293回利付国債（10年）	370,000,000	389,254,800	
第294回利付国債（10年）	180,000,000	188,839,800	
第295回利付国債（10年）	100,000,000	104,324,000	
第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,198,259,000	
第297回利付国債（10年）	560,000,000	586,224,800	

第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,732,044,000	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,370,430,300	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	874,388,400	
第301回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,310,332,800	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	210,560,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,467,158,900	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	504,643,200	
第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,276,467,200	
第306回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,453,665,900	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	739,487,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,048,073,400	
第309回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,866,935,200	
第310回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,663,394,400	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	631,862,400	
第312回利付国債(10年)	2,170,000,000	2,298,420,600	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,760,368,500	
第314回利付国債(10年)	760,000,000	802,256,000	
第315回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,180,441,500	
第316回利付国債(10年)	720,000,000	761,572,800	
第317回利付国債(10年)	620,000,000	656,902,400	
第318回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,906,635,900	
第319回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,220,414,500	
第320回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,215,185,000	
第321回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,459,384,900	
第322回利付国債(10年)	950,000,000	996,474,000	
第323回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,217,199,600	
第324回利付国債(10年)	2,020,000,000	2,105,769,200	
第325回利付国債(10年)	3,010,000,000	3,135,697,600	
第326回利付国債(10年)	530,000,000	548,009,400	
第327回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,874,304,000	
第328回利付国債(10年)	2,540,000,000	2,605,024,000	
第329回利付国債(10年)	2,300,000,000	2,392,828,000	
第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	2,329,488,000	
第331回利付国債(10年)	680,000,000	696,299,600	
第332回利付国債(10年)	2,900,000,000	2,966,671,000	
第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	2,811,462,500	
第334回利付国債(10年)	2,950,000,000	3,012,569,500	
第335回利付国債(10年)	3,040,000,000	3,073,744,000	
第336回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,323,113,100	
第337回利付国債(10年)	1,990,000,000	1,972,786,500	
第338回利付国債(10年)	3,680,000,000	3,676,540,800	
第339回利付国債(10年)	810,000,000	807,683,400	

第1回利付国債（30年）	40,000,000	51,004,400
第2回利付国債（30年）	160,000,000	195,523,200
第3回利付国債（30年）	120,000,000	145,045,200
第4回利付国債（30年）	110,000,000	142,561,100
第5回利付国債（30年）	50,000,000	59,720,000
第6回利付国債（30年）	190,000,000	232,449,800
第7回利付国債（30年）	180,000,000	217,344,600
第8回利付国債（30年）	50,000,000	56,333,000
第9回利付国債（30年）	240,000,000	255,009,600
第10回利付国債（30年）	160,000,000	161,675,200
第11回利付国債（30年）	90,000,000	99,504,000
第12回利付国債（30年）	190,000,000	222,330,400
第13回利付国債（30年）	290,000,000	334,100,300
第14回利付国債（30年）	300,000,000	364,962,000
第15回利付国債（30年）	340,000,000	419,519,200
第16回利付国債（30年）	370,000,000	456,036,100
第17回利付国債（30年）	330,000,000	400,616,700
第18回利付国債（30年）	445,000,000	531,823,950
第19回利付国債（30年）	280,000,000	334,112,800
第20回利付国債（30年）	420,000,000	515,848,200
第21回利付国債（30年）	370,000,000	441,136,200
第22回利付国債（30年）	400,000,000	491,456,000
第23回利付国債（30年）	420,000,000	516,100,200
第24回利付国債（30年）	330,000,000	405,546,900
第25回利付国債（30年）	350,000,000	417,063,500
第26回利付国債（30年）	730,000,000	883,759,900
第27回利付国債（30年）	730,000,000	898,637,300
第28回利付国債（30年）	530,000,000	653,421,100
第29回利付国債（30年）	940,000,000	1,141,498,400
第30回利付国債（30年）	660,000,000	788,792,400
第31回利付国債（30年）	770,000,000	905,004,100
第32回利付国債（30年）	1,060,000,000	1,268,735,200
第33回利付国債（30年）	1,290,000,000	1,462,718,100
第34回利付国債（30年）	1,180,000,000	1,388,482,400
第35回利付国債（30年）	1,200,000,000	1,360,104,000
第36回利付国債（30年）	1,240,000,000	1,404,994,400
第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33回利付国債（20年）	140,000,000	146,309,800	
第34回利付国債（20年）	50,000,000	52,939,000	
第35回利付国債（20年）	10,000,000	10,554,200	
第36回利付国債（20年）	70,000,000	74,558,400	
第37回利付国債（20年）	70,000,000	74,711,000	
第38回利付国債（20年）	20,000,000	21,434,000	
第39回利付国債（20年）	500,000,000	534,510,000	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	107,243,000	
第41回利付国債（20年）	330,000,000	347,648,400	
第42回利付国債（20年）	80,000,000	87,513,600	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	156,602,600	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	189,145,400	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	321,308,400	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	187,547,400	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	99,756,000	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	146,835,000	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	155,747,200	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	242,325,600	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	111,115,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	123,304,500	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	90,029,600	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	226,350,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	157,141,600	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	168,696,000	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	268,269,600	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	336,129,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	221,574,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	380,075,500	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	253,567,200	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	333,043,200	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	223,856,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	361,340,800	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	248,958,600	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	370,725,300	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	147,351,100	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	220,267,000	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	448,831,500	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	471,856,000	

第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7 6 回利付国債(20年)	270,000,000	308,180,700	
第7 7 回利付国債(20年)	290,000,000	333,714,600	
第7 8 回利付国債(20年)	170,000,000	194,270,900	
第7 9 回利付国債(20年)	270,000,000	311,274,900	
第8 0 回利付国債(20年)	220,000,000	255,732,400	
第8 1 回利付国債(20年)	390,000,000	449,970,300	
第8 2 回利付国債(20年)	600,000,000	698,124,000	
第8 3 回利付国債(20年)	290,000,000	337,861,600	
第8 4 回利付国債(20年)	670,000,000	773,896,900	
第8 5 回利付国債(20年)	290,000,000	338,595,300	
第8 6 回利付国債(20年)	210,000,000	249,469,500	
第8 7 回利付国債(20年)	550,000,000	647,768,000	
第8 8 回利付国債(20年)	550,000,000	654,670,500	
第8 9 回利付国債(20年)	450,000,000	530,959,500	
第9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	744,641,100	
第9 1 回利付国債(20年)	450,000,000	536,944,500	
第9 2 回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,266,224,400	
第9 3 回利付国債(20年)	410,000,000	476,563,500	
第9 4 回利付国債(20年)	680,000,000	798,320,000	
第9 5 回利付国債(20年)	660,000,000	790,673,400	
第9 6 回利付国債(20年)	420,000,000	493,458,000	
第9 7 回利付国債(20年)	640,000,000	760,166,400	
第9 8 回利付国債(20年)	450,000,000	529,357,500	
第9 9 回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,177,670,000	
第1 0 0 回利付国債(20年)	620,000,000	738,215,400	
第1 0 1 回利付国債(20年)	435,000,000	528,525,000	
第1 0 2 回利付国債(20年)	440,000,000	535,057,600	
第1 0 3 回利付国債(20年)	380,000,000	457,261,600	
第1 0 4 回利付国債(20年)	460,000,000	542,165,200	
第1 0 5 回利付国債(20年)	680,000,000	802,182,400	
第1 0 6 回利付国債(20年)	360,000,000	429,332,400	
第1 0 7 回利付国債(20年)	370,000,000	436,829,400	
第1 0 8 回利付国債(20年)	650,000,000	750,854,000	
第1 0 9 回利付国債(20年)	340,000,000	392,659,200	
第1 1 0 回利付国債(20年)	850,000,000	1,003,595,000	
第1 1 1 回利付国債(20年)	300,000,000	358,266,000	
第1 1 2 回利付国債(20年)	800,000,000	945,192,000	
第1 1 3 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	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,917,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	145,730,760	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,052,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,702,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,337,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,520,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,818,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,008,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,388,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,319,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,757,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,558,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,586,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,602,000	
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	
	100,000,000	104,024,000	

第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,649,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,528,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,759,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,579,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,654,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,236,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,856,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,153,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,738,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,042,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,329,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	212,077,780	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,499,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,260,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,186,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,059,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	335,547,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,475,800	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	104,576,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,787,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	122,671,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,535,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,101,600	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,725,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,738,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	212,028,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,864,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,013,740	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,653,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,502,380	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,580,150	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,800,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,193,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	104,071,000	

第30回公営企業債券	100,000,000	105,445,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,591,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,321,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,755,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,221,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,940,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,806,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,467,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,752,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,080,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,694,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,636,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,917,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	218,478,720	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	126,361,500	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	105,898,420	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	82,911,200	
第11回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	301,200,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,011,620	
第14回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,465,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,690,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,492,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,546,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,617,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,115,800	
第190回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,055,000	
第191回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,060,000	
第197回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,048,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,620,000	34,017,428	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,515,000	27,451,588	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,355,000	28,612,569	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	107,181,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,582,000	35,314,978	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,109,000	30,186,255	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	22,731,000	24,106,452	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,002,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,330,000	51,243,244	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,743,000	29,619,536	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,616,000	26,562,633	
	29,338,000	31,324,182	

第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券			
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,551,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,320,000	26,277,760	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,867,000	31,750,711	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	36,769,000	38,534,647	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,070,000	38,781,892	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,783,000	46,456,348	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,977,000	47,941,526	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,505,000	48,370,704	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,871,000	54,574,408	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,602,000	57,441,511	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,867,000	58,562,841	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,156,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,798,000	122,302,345	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,511,000	33,588,520	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,568,000	67,627,452	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,057,000	33,040,300	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,822,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,883,000	33,619,851	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,586,000	78,521,413	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,305,000	30,742,060	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,449,000	78,643,313	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,076,000	77,304,393	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,245,000	35,069,017	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,530,000	152,006,881	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,582,000	81,067,407	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,602,000	34,074,224	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,732,000	86,478,104	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,713,000	85,457,906	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,168,000	86,039,756	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,209,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,274,000	173,039,689	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,966,000	
第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回沖縄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 グ・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 グ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,149,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,135,000	
	第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	200,478,000	
	第9回JPモルガン・チェース・アンド・カン パニー円貨社債	100,000,000	101,801,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グルー プ・インク円貨社債	100,000,000	102,708,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,734,000	
	第6回ビー・エヌ・ビー・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回ウエストパック・バンキング・コーポ レーション円貨社債	100,000,000	101,737,000	
	第14回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	101,330,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	203,344,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	100,085,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,234,000	
	第5回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	100,455,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	104,091,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	105,932,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,021,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,191,000	
	第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	100,346,000	
	第3回株式会社セブン&アイ・ホールディ ングス無担保社債	100,000,000	105,273,000	
	第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	105,454,000	
	第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,873,000	
	第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,164,000	
	第8回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	100,000,000	102,822,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,289,000		
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディ ングス無担保社債	100,000,000	101,344,000		

第1回富士フィ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	
	200,000,000	200,390,000	

第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債			
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	
	100,000,000	101,237,000	

第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債			
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

項目	平成27年 7月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	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	1口当たり純資産額 1.0042円 (1万口当たり純資産額) (10,042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。
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
債券コア戦略ファンド	48,082円
FOFs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
FOFs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	

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	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。
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に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

	平成27年 7月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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> <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)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	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ではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	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	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	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	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	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

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 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

項目	平成27年 7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	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

	平成27年 7月10日現在
項目	金額（円）
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	<p>1口当たり純資産額 1.0049円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (10,049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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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>

	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)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	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
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

区分	平成27年 7月10日現在
M L P 関連証券ファンド（為替ヘッジあり）	49,791円
M L P 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L S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R E I T・リサーチ・オープン（毎月決算型）	9,953円
国内株式S M T B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S M T Bセレクション（SMA専用）	9,952円
S L I G A R S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L S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
私募マネープールファンドA L（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、「マネープールマザーファンド」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。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(平成27年 7月11日から平成28年 1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【債券コア戦略ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (平成27年 7月10日現在)	第2期中間計算期間 (平成28年 1月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,000	124,704
投資信託受益証券	121,862	258,862
親投資信託受益証券	370,777	785,517
流動資産合計	500,639	1,169,083
資産合計	500,639	1,169,083
負債の部		
流動負債		
未払金	-	114,000
未払受託者報酬	23	71
未払委託者報酬	978	1,341
流動負債合計	1,001	115,412
負債合計	1,001	115,412
純資産の部		
元本等		
元本	500,000	1,046,715
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	362	6,956
(分配準備積立金)	1,787	1,787
元本等合計	499,638	1,053,671
純資産合計	499,638	1,053,671
負債純資産合計	500,639	1,169,083

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

		第2期中間計算期間
		自 平成27年 7月11日
		至 平成28年 1月10日
営業収益		
有価証券売買等損益		5,740
営業収益合計		5,740
営業費用		
受託者報酬		71
委託者報酬		1,341
営業費用合計		1,412
営業利益又は営業損失 ()		4,328
経常利益又は経常損失 ()		4,328
中間純利益又は中間純損失 ()		4,328
期首剰余金又は期首欠損金 ()		362
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,990
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,990
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金 ()		6,956

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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>
-----------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成27年 7月10日現在)	第2期中間計算期間 (平成28年 1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	1,046,715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	元本の欠損 - 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9993円 (1万口当たり純資産額) (9,993円)	1口当たり純資産額 1.0066円 (1万口当たり純資産額) (10,066円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第2期中間計算期間 (平成28年 1月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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

	第2期中間計算期間 (平成28年 1月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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)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> <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>

(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	第2期中間計算期間 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 1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	500,000円
期中追加設定元本額	- 円	546,715円
期中一部解約元本額	- 円	- 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間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28年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	997,939,455
国債証券	272,528,780,600
地方債証券	19,866,522,331
特殊債証券	26,740,114,720
社債証券	16,342,611,370
派生商品評価勘定	729,028
未収利息	724,096,031
前払費用	17,047,550
差入委託証拠金	300,000
流動資産合計	337,218,141,085
資産合計	337,218,141,085
負債の部	
流動負債	
前受金	730,000
未払解約金	226,544,516
流動負債合計	227,274,516
負債合計	227,274,516
純資産の部	
元本等	
元本	249,911,102,194
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,079,764,375
元本等合計	336,990,866,569
純資産合計	336,990,866,569
負債純資産合計	337,218,141,085

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 1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、特殊債証券、社債証券</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>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

	平成28年 1月10日現在
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28年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	249,911,102,194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 105,842,000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 1.3484円 (1万口当たり純資産額) (13,484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)

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。 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。

	平成28年 1月10日現在

（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28年 1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 7月11日
期首元本額	246,004,897,539円
期中追加設定元本額	23,997,105,529円
期中一部解約元本額	20,090,900,874円
期末元本額	249,911,102,194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）	2,647,503,592円
S B I 資産設計オープン（分配型）	26,427,264円
S M T 国内債券インデックス・オープン	7,723,567,257円
世界経済インデックスファンド	530,642,742円
マイセレクション25	74,825,967円
マイセレクション50	80,235,485円
マイセレクション75	24,413,841円
D C マイセレクション25	14,252,480,737円
D C マイセレクション50	17,104,979,344円
D C マイセレクション75	4,930,683,864円
D C 日本債券インデックス・オープン	410,986,601円
D C 日本債券インデックス・オープンS	59,846,386,074円
D C 日本債券インデックス・オープンP	24,938,120,209円
D C マイセレクションS25	5,834,072,412円
D C マイセレクションS50	6,551,078,320円
D C マイセレクションS75	1,283,107,720円
D C ターゲット・イヤール ファンド2025	1,299,096,967円
D C ターゲット・イヤール ファンド2035	723,167,398円
D C ターゲット・イヤール ファンド2045	191,444,965円
D C 世界経済インデックスファンド	525,109,308円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,325,649,667円

区分	平成28年 1月10日現在
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	21,048,817円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	161,958,481円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	26,602,142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）	625,913,582円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	890,527,921円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	372,678,104円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	298,514,598円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	8,610,153,088円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,557,328,373円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,719,493,342円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,296,201,537円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,060,114,320円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,118,336,275円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,812,658,356円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,187,539,182円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,103,671,678円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	224,898,458円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,573,833,346円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,263,479,163円
コア投資戦略ファンド（安定型）	8,005,713,276円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,977,753,451円
分散投資コア戦略ファンドA	1,332,740,617円
分散投資コア戦略ファンドS	867,838,011円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	15,807,058円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	228,301,981円
国内債券SMTBセクション（SMA専用）	33,458,331,391円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,472,607,312円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	48,690,808円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,030,593円
SMT インデックスバランス・オープン	62,415,542円
債券コア戦略ファンド	192,248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）	1,157,546,429円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成28年 1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	447,260,972	-	447,990,000	729,028
	合計	447,260,972	-	447,990,000	729,028

(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。

日本物価連動国債 マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	770,819,581
国債証券	28,361,412,285
未収利息	8,857,584
流動資産合計	29,141,089,450
資産合計	29,141,089,450
負債の部	
流動負債	
未払解約金	53,258
流動負債合計	53,258
負債合計	53,258
純資産の部	
元本等	
元本	29,213,813,234
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	72,777,042
元本等合計	29,141,036,192
純資産合計	29,141,036,192
負債純資産合計	29,141,089,450

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 1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28年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		29,213,813,234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	72,777,042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)	0.9975円 (9,975円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1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。	

(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28年 1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 7月11日
期首元本額	27,857,414,206円

区分	平成28年 1月10日現在
期中追加設定元本額	3,483,949,125円
期中一部解約元本額	2,127,550,097円
期末元本額	29,213,813,234円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	17,594,889,197円
日本物価連動国債ファンド（SMA専用）	528,283,352円
債券コア戦略ファンド	100,589円
FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	10,475,886,059円
FOFs用 日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）	614,654,037円

（デリバティブ取引に関する注記）

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28年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	14,177,781,821
コール・ローン	1,630,421,773
国債証券	123,487,177,356
派生商品評価勘定	414,072,368
未収入金	4,341,844,332
未収利息	812,082,767
前払費用	185,291,218
流動資産合計	145,048,671,635
資産合計	145,048,671,635
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	393,846,509
未払金	15,360,808,721
未払解約金	338,653
流動負債合計	15,754,993,883
負債合計	15,754,993,883
純資産の部	
元本等	
元本	124,506,979,463
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,786,698,289
元本等合計	129,293,677,752
純資産合計	129,293,677,752
負債純資産合計	145,048,671,635

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 1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>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	124,506,979,463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 1.0384円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (10,384円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 1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>

(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28年 1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 7月11日
期首元本額	122,502,828,206円
期中追加設定元本額	13,060,017,436円
期中一部解約元本額	11,055,866,179円
期末元本額	124,506,979,463円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	70,070,641,697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)	953,638,942円

区分	平成28年 1月10日現在
債券コア戦略ファンド	400,569円
F O F s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）	39,130,897,626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）	11,961,761,521円
F O F s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）	2,389,639,108円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成28年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	112,391,466,389	-	112,371,240,530	20,225,859
	アメリカドル	40,884,740,804	-	40,600,033,885	284,706,919
	ユーロ	59,106,347,155	-	59,500,193,664	393,846,509
	イギリスポンド	12,400,378,430	-	12,271,012,981	129,365,449
合計		112,391,466,389	-	112,371,240,530	20,225,859

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	平成28年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	489,945,839
国債証券	20,023,800
未収利息	4,307
流動資産合計	509,973,946
資産合計	509,973,946
負債の部	
流動負債	
未払解約金	248
流動負債合計	248
負債合計	248

	平成28年 1月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	507,396,676
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,577,022
元本等合計	509,973,698
純資産合計	509,973,698
負債純資産合計	509,973,946

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 1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 移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)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28年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	507,396,676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 1.0051円 (1万口当たり純資産額) (10,051円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1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

	平成28年 1月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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> <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>

（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28年 1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 7月11日
期首元本額	88,384,819円
期中追加設定元本額	543,546,468円
期中一部解約元本額	124,534,611円
期末元本額	507,396,676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
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

区分	平成28年 1月10日現在
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
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
GIVI世界株式ファンド(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
米ドル・ロング/ユーロ・ショートファンド(適格機関投資家専用)	398,400,043円
ユーロ・ロング/米ドル・ショートファンド(適格機関投資家専用)	398,010円
私募マネーブルファンドAL(適格機関投資家専用)	66,460,230円

(デリバティブ取引に関する注記)

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28年 1月29日現在）

資産総額	1,534,532円
負債総額	288円
純資産総額（ - ）	1,534,244円
発行済口数	1,518,713口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0102円
（1万口当たり純資産額）	（10,102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28年 1月29日現在）

資産総額	336,038,366,142円
負債総額	2,901,386,480円
純資産総額（ - ）	333,136,979,662円
発行済口数	244,889,365,482口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3604円
（1万口当たり純資産額）	（13,604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28年 1月29日現在）

資産総額	29,092,917,764円
負債総額	10,759,829円
純資産総額（ - ）	29,082,157,935円
発行済口数	29,168,136,325口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9971円
（1万口当たり純資産額）	（9,971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28年 1月29日現在)

資産総額	130,868,669,436円
負債総額	2,836,633,442円
純資産総額（ - ）	128,032,035,994円
発行済口数	122,063,320,842口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0489円
（1万口当たり純資産額）	（10,489円）

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(平成28年 1月29日現在)

資産総額	835,554,023円
負債総額	254円
純資産総額（ - ）	835,553,769円
発行済口数	831,302,082口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0051円
（1万口当たり純資産額）	（10,051円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成28年 1月29日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成28年 4月 8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年1月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	437	7,868,790
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	29	116,307
単位型公社債投資信託	0	0
合計	466	7,985,097

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57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、財務諸表及び中間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。

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、第29期事業年度（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 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第30期事業年度の中間会計期間（自平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間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

	前事業年度 （平成26年3月31日現在）	当事業年度 （平成27年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	13,353	13,868
未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
固定負債		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	62,500	65,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

前事業年度

当事業年度

(自 平成25年4月 1日
至 平成26年3月31日)(自 平成26年4月 1日
至 平成27年3月31日)

営業収益		
委託者報酬	22,773,831	28,159,652
運用受託報酬	55,511	8,732
営業収益合計	22,829,342	28,168,384
営業費用		
支払手数料	10,451,296	12,922,655
広告宣伝費	76,961	130,384
公告費	-	880
調査費	5,091,105	5,994,577
調査費	259,236	279,702
委託調査費	4,830,390	5,712,946
図書費	1,479	1,928
営業雑経費	1,264,334	1,299,065
通信費	17,246	17,456
印刷費	327,214	330,921
協会費	22,524	23,182
諸会費	773	105
情報機器関連費	837,859	857,009
その他営業雑経費	58,716	70,390
営業費用合計	16,883,698	20,347,563
一般管理費		
給料	2,201,964	2,185,555
役員報酬	102,330	89,055
給料・手当	1,846,450	1,839,000
賞与	253,183	257,499
退職給付費用	72,029	71,270
役員退職慰労金	1,070	-
福利費	207,122	212,286
交際費	2,758	4,491
旅費交通費	45,973	55,788
租税公課	42,862	42,868
不動産賃借料	130,938	130,938
寄付金	3,385	-
減価償却費	119,445	129,285
諸経費	1 219,615	1 212,345
一般管理費合計	3,047,165	3,044,830
営業利益	2,898,479	4,775,990

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802

収益分配金		3,234		4,617
投資有価証券売却益		553		1,846
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,775		1,936
営業外収益合計		16,027		18,203
営業外費用				
長期前払費用償却	1	23,222	1	27,866
支払補償費		14,648		7,656
投資有価証券売却損		284		117
その他		2,112		3,283
営業外費用合計		40,268		38,924
経常利益		2,874,238		4,755,269
特別損失				
外国税関連費用		-	2	56,222
特別損失合計		-		56,222
税引前当期純利益		2,874,238		4,699,047
法人税、住民税及び事業税		1,623,332		1,667,610
法人税等調整額		502,474		30,739
法人税等合計		1,120,857		1,698,349
当期純利益		1,753,381		3,000,697

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381
当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793

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

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				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	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	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
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		当事業年度	
	（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
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. その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成27年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
34,635	1,846	117

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が20,769千円減少し、当事業年度に

計上された法人税等調整額の金額が20,769千円増加しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

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・リアルコース）	3,178,319千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
経営指導料
取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
投資助言費用
各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内 容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上 の 取引 役員 の 兼任	投信販売 代行手数料 等の支払	8,852,826	未払 手数料	1,374,578
							投資助言費用 の支払	3,428,200	その他 未払金	381,755

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：千円)

第30期中間会計期間末

(平成27年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金

14,016,702

未収委託者報酬

5,141,677

繰延税金資産

106,209

その他流動資産

141,365

流動資産合計

19,405,955

固定資産

有形固定資産		
建物	1	59,944
器具備品	1	102,740
その他有形固定資産	1	4,207
有形固定資産合計		166,892
無形固定資産		195,428
投資その他の資産		
投資有価証券		58,796
長期貸付金		24,338
会員権		25,000
その他の投資		1,137
繰延税金資産		124,183
貸倒引当金		24,338
投資その他の資産合計		209,117
固定資産合計		571,438
資産合計		19,977,393
負債の部		
流動負債		
未払金		2,781,753
未払費用		77,994
未払法人税等		1,090,560
賞与引当金		100,008
その他流動負債	2	189,082
流動負債合計		4,239,399
固定負債		
退職給付引当金		368,901
資産除去債務		12,816
その他固定負債		3,552
固定負債合計		385,270
負債合計		4,624,670

(単位：千円)

第30期中間会計期間末
(平成27年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		68,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		12,536,088
利益剰余金合計		14,704,588
株主資本合計		15,354,588

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,864
評価・換算差額等合計	1,864
純資産合計	15,352,723
負債・純資産合計	19,977,393

中間損益計算書

(単位：千円)

		第30期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			16,237,885
営業収益合計			16,237,885
営業費用			11,383,551
一般管理費	1		1,638,696
営業利益			3,215,638
営業外収益	2		12,278
営業外費用			14,137
経常利益			3,213,780
税引前中間純利益			3,213,780
法人税、住民税及び事業税			1,061,497
法人税等調整額			3,185
法人税等合計			1,064,682
中間純利益			2,149,097

中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本			
	利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
		別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491

当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			2,149,097	2,149,097	2,149,097
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)					
当中間期変動額合計	3,000	-	2,116,097	2,119,097	2,119,097
当中間期末残高	68,500	2,100,000	12,536,088	14,704,588	15,354,588

	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	3,235	3,235	13,238,726
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			2,149,097
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	5,100	5,100	5,100
当中間期変動額合計	5,100	5,100	2,113,997
当中間期末残高	1,864	1,864	15,352,723

重要な会計方針

第30期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> その他有価証券</p> <p> 時価のあるもの</p> <p> 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。</p> <p> (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。)</p> <p> 時価のないもの</p> <p> 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産</p> <p> 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p> 定額法によっております。</p> <p> ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金</p> <p> 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。</p>

(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中間会計期間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、当中間会計期間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. その他中間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。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

第30期中間会計期間

(自 平成27年4月1日

至 平成27年9月30日)

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。)及び「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。)等を当中間会計期間から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当中間会計期間の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する中間会計期間の中間財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項(4)及び事業分離等会計基準第57 - 4項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間末

(平成27年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額

建 物	49,628千円
器具備品	239,367千円
その他有形固定資産	382千円
計	289,378千円

2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第30期中間会計期間

(自 平成27年4月1日

至 平成27年9月30日)

1	減価償却実施額		
	有形固定資産	26,652千円	
	無形固定資産	34,155千円	
2	営業外収益の主要項目		
	受取利息	3,919千円	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成27年9月30日）

平成27年9月30日における貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	14,016,702	14,016,702	-
(2)未収委託者報酬	5,141,677	5,141,677	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,793	58,793	-
(4)未払金	(2,781,753)	(2,781,753)	-
(5)未払法人税等	(1,090,560)	(1,090,560)	-

(*)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及び有価証券に関する事項

(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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 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ため、「（3）投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第30期中間会計期間末（平成27年9月30日）

其他有価証券

（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	7,156	6,560	596
小計	7,156	6,560	596
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	51,636	54,986	3,349
小計	51,636	54,986	3,349
合計	58,793	61,546	2,753

(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「其他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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)

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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中間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中間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中間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

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,010,428千円

（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）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
1株当たり純資産額	5,117,574円52銭
1株当たり中間純利益	716,365円75銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
中間純利益	2,149,097千円
普通株式に係る中間純利益	2,149,097千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社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28年 4月 8日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成27年9月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成27年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。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成27年9月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (7)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (9)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月4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 公認会計士 白川 芳樹
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
業務執行社員

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27年4月1日から平成28年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年3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7月11日から平成28年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、債券コア戦略ファンドの平成28年1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中間計算期間（平成27年7月11日から平成28年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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、中間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データは中間監査の対象には含まれておりません。