

【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29年4月11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 平木 秀樹
【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29年 4月12日から平成29年10月10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－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－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、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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。

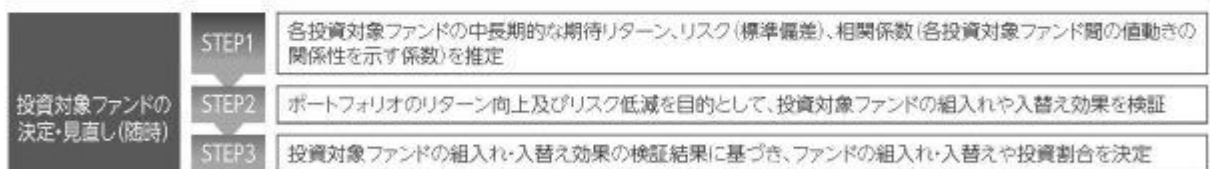
2.

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)

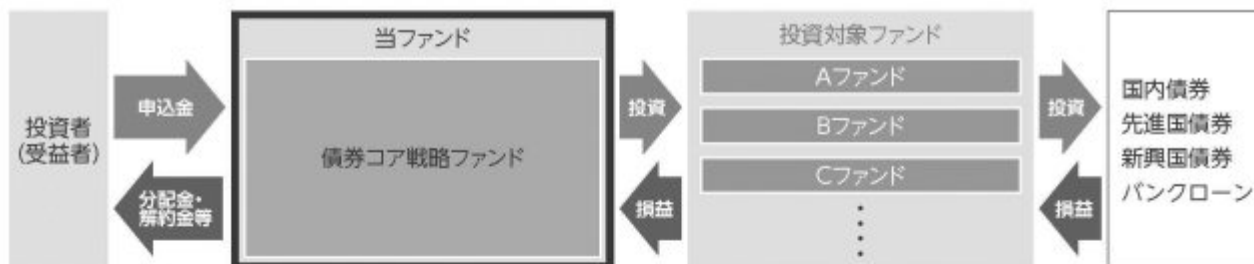
相対的に値上がりしたファンドの売却や値下がりしたファンドの購入を行うことなどにより、最適な投資割合からの乖離を修正

※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〉

米国地方債について

米国地方債は、地方公共団体等が発行する債券で、発行体自身の信用力によって元利金の支払いを保証する一般財源保証債と、インフラ施設やサービス事業の利用料等を返済原資とするレベニュー債が主に発行されています。



一般財源保証債は発行体の全信用力を担保として発行されますが、レベニュー債の場合、発行体の信用力には及ばず、裏付けとしてあらかじめ定められた特定事業から生じた資金が元利支払いに充当されることになります。

詳細については、後掲「3 投資リスク」をご参照ください。

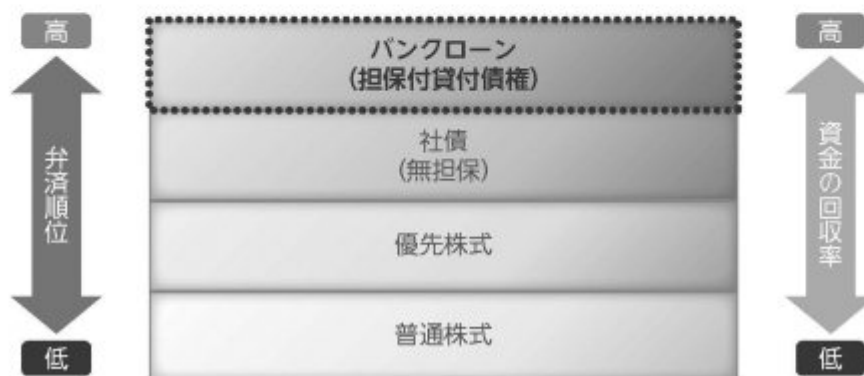
バンクローンについて

一般的なバンクローンの特徴は次の通りです。

- 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29年 1月31日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の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、前号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。

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29年 1月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、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しており、記載している定義は、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

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. 世界物価連動債マザーファンド 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	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ・パークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）に連動する投資成果を目指します。</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>インフレ連動国債（物価連動国債）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により為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<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（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、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>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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、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係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：1月17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>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>平成29年1月31日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>助言会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

「ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス」とは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスをあらわします。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標及びサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標及びサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

投資顧問会社	ヌビーン・アセット・マネジメント・エルエルシー
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	主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。
投資態度	<p>主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築は、米国の地方財政や米国地方債における各セクターの幅広いテクニカル要因及びファンダメンタルズ要因等の状況を精査した上で、個別銘柄に対する詳細な分析に基づいて行います。</p> <p>米国の投資適格地方債への投資割合は、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>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。</p> <p>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。</p> <p>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、いずれか一発行会社（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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	毎月
信託報酬	<p>年率0.44%（税抜0.44%）</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及びデリバティブ取引に要する費用等並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28年2月26日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 投資顧問会社 Nuveen 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 ・ 名義書換事務受託会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited ・ 保管受託銀行 Sumitomo Mitsui Trust (UK) Limited
------	---

6.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	<p>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。</p> <p>また、ハイイールド債券等にも投資します。</p>
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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%（税抜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

7. マネープールマザーファンド

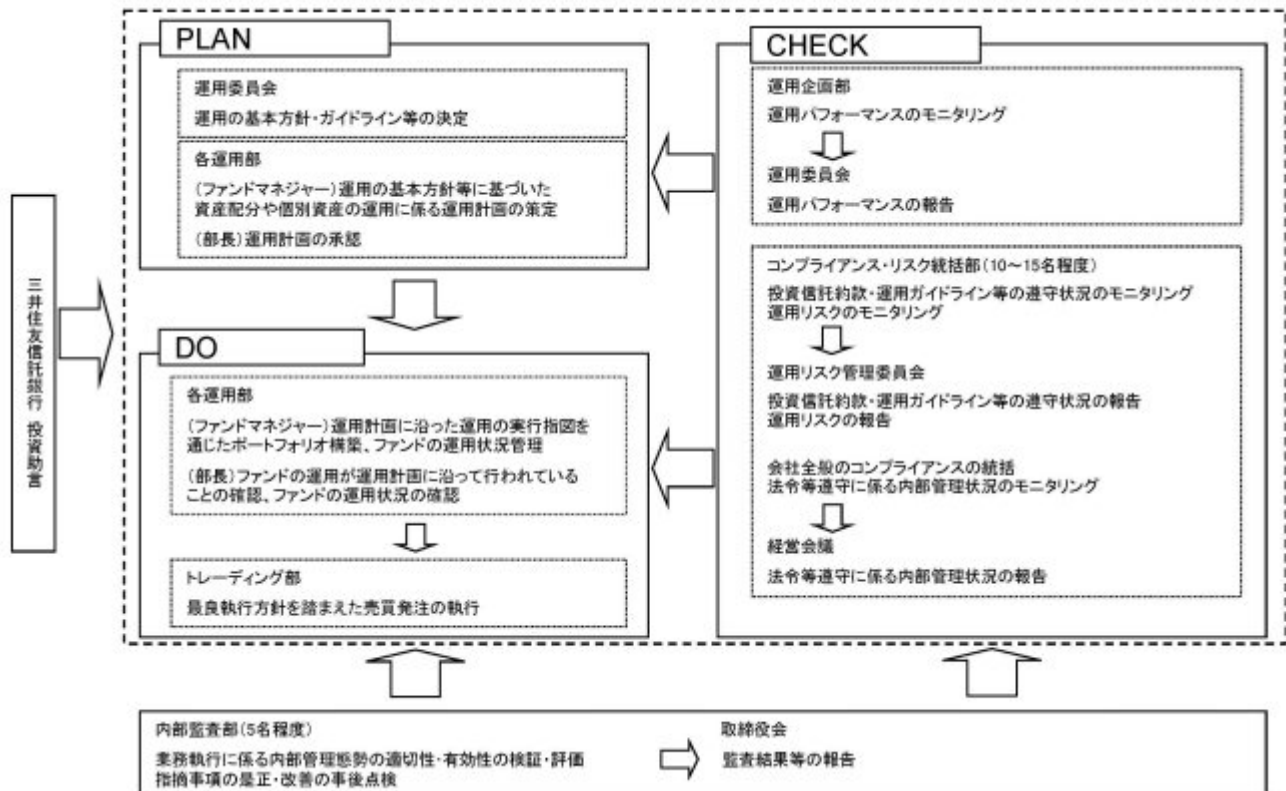
運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等にも投資します。

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>
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。）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>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11月20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。
設定日	平成22年2月26日

信託期間	原則として無期限
運用再委託会社 又は助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【配分方針】

年1回の毎決算時（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りますが、さらに需給要因によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があ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。

米国地方債に関する信用リスク

米国地方債は、元利償還財源の相違によって「レベニュー債」と「一般財源保証債」に大別されます。

<レベニュー債>

レベニュー債は、特定事業（例としては、空港、上下水道、公立病院、公立学校の整備・運営等）から生じる収入等を元利償還財源として発行されます。このため、発行体である地方公共団体や公的機関等が、レベニュー債の裏付けとしてあらかじめ定められた特定事業以外の事業等から生じた

資金を保有していたとしても、その資金がレベニュー債の元利償還に充当されることはありません。したがって、発行体である地方公共団体や公的機関等の財政状況にかかわらず、レベニュー債の裏付けとなる特定事業が不振となり、当該レベニュー債に係る元利払いができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、レベニュー債の価格が下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

< 一般財源保証債 >

一般財源保証債は、起債する地方公共団体の課税権を含む全信用力を担保として発行され、発行体が元利償還の全責任を負います。したがって、発行体である地方公共団体が財政難、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、一般財源保証債の価格が下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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 >

米国地方債は、米国居住者が所得税を課税される課税債と課税されない非課税債に分かれます（ただし当ファンドなど米国非居住者が投資する場合には、いずれも課税されません（税制については今後変更される可能性があります））。当ファンドの投資対象ファンドは、銘柄分散等の観点から非課税債に投資する可能性があります。将来、米国における税制度の変更により非課税の取り扱いが廃止され、投資対象ファンドが非課税債を保有していた場合には、当該非課税債の価格が下落する可能性があります。

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。

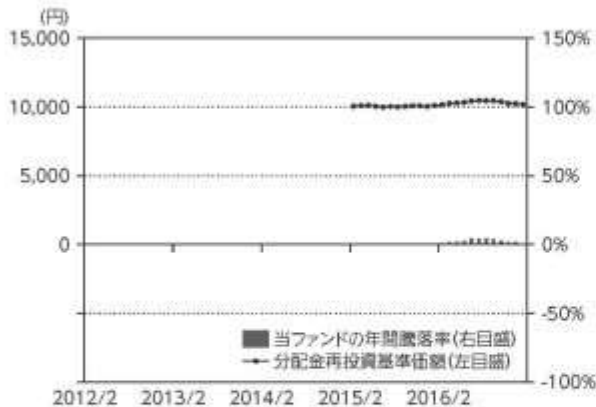
確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

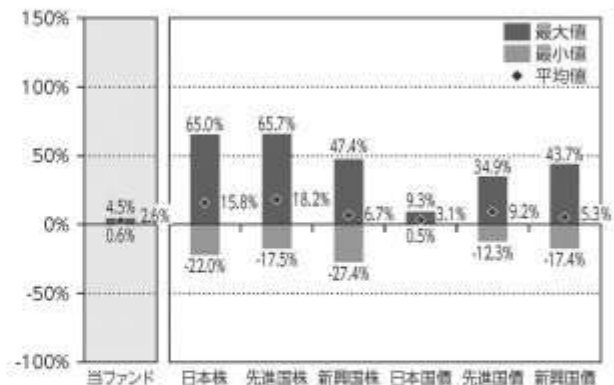
運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*当ファンドについては2016年2月～2017年1月の1年間、他の代表的な資産クラスについては2012年2月～2017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・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}

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

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバイド(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国内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、指数他の公表、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率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、指数の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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。
世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	ありません。
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	年率 0.44%（税抜 0.44%）
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の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。

実質的な信託報酬率：年率0.54%～1.19%（税抜 0.5%～1.15%）
（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.65%（税抜0.0%～0.65%））

（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ます。)及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．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29年 1月31日現在のもので、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29年 1月31日現在の状況について記載してあります。

【債券コア戦略ファンド】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	17,472,352	14.77
親投資信託受益証券	日本	99,370,551	84.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,438,942	1.22
合計（純資産総額）		118,281,845	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	67,282,612	1.0809	72,728,007	1.0490	70,579,459	59.67
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	15,789.968	1,086.91	17,162,407	1,106.54	17,472,352	14.77
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	12,669,439	1.4005	17,743,589	1.3764	17,438,215	14.74

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	11,451,672	0.9889	11,324,973	0.9905	11,342,881	9.59
日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	9,953	1.0049	10,001	1.0044	9,996	0.01

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	14.77
親投資信託受益証券	84.01
合計	98.78

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

【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
第2期計算期間末 (平成28年 7月11日)	15,903,634	15,903,634	10,479	10,479
平成28年 1月末日	1,534,244		10,102	
2月末日	1,759,318		10,159	
3月末日	2,257,938		10,256	
4月末日	2,752,155		10,287	
5月末日	4,367,518		10,318	
6月末日	8,516,383		10,432	
7月末日	18,544,937		10,454	
8月末日	68,353,740		10,447	
9月末日	72,886,079		10,447	
10月末日	75,918,304		10,371	
11月末日	79,744,789		10,255	
12月末日	106,085,028		10,236	

平成29年 1月末日	118,281,845		10,167
------------	-------------	--	--------

【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
第2期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11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期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	4.9
第3期中間計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 1月11日	2.5

(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期計算期間	平成27年 7月11日～平成28年 7月11日	14,787,075	109,899	15,177,176
第3期中間計算期間	平成28年 7月12日～平成29年 1月11日	103,627,815	11,205,640	107,599,351

(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	263,884,543,800	82.30
	ポーランド	200,504,000	0.06
	小計	264,085,047,800	82.37
地方債証券	日本	18,007,354,789	5.62
特殊債券	日本	23,876,692,371	7.45
社債券	日本	11,857,983,700	3.70

	フランス	497,945,000	0.16
	オーストラリア	401,442,000	0.13
	オランダ	200,002,000	0.06
	スウェーデン	199,564,000	0.06
	アメリカ	100,312,000	0.03
	イギリス	99,524,000	0.03
	小計	13,356,772,700	4.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,295,188,600	0.40
合計(純資産総額)		320,621,056,260	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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	149,880,000	0.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	101.12	4,439,343,600	100.76	4,423,671,300	0.300	2018/6/20	1.38
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	101.14	3,812,978,000	100.79	3,799,858,400	0.200	2018/12/20	1.19
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,700,000,000	101.06	3,739,333,600	100.95	3,735,261,000	0.100	2021/9/20	1.17
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	101.43	3,661,767,400	100.83	3,640,251,800	0.100	2020/9/20	1.14
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,560,000,000	101.20	3,602,720,000	100.73	3,586,237,200	0.100	2019/12/20	1.12
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,520,000,000	101.25	3,564,140,800	100.83	3,549,286,400	0.200	2019/3/20	1.11
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	101.35	3,557,455,200	100.89	3,541,414,500	0.200	2019/6/20	1.10
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	3,350,000,000	101.39	3,396,590,200	100.89	3,379,848,500	0.100	2021/3/20	1.05
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	3,150,000,000	101.31	3,191,356,400	100.81	3,175,641,000	0.100	2020/6/20	0.99
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,080,000,000	105.09	3,236,926,000	103.00	3,172,584,800	0.400	2025/6/20	0.99

日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	3,140,000,000	101.26	3,179,721,000	100.78	3,164,649,000	0.100	2020/3/20	0.99
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	3,030,000,000	100.31	3,039,685,100	100.19	3,035,938,800	0.100	2026/12/20	0.95
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	3,000,000,000	102.17	3,065,100,000	100.36	3,010,890,000	0.100	2026/3/20	0.94
日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	101.51	3,004,696,000	100.85	2,985,367,200	0.100	2020/12/20	0.93
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	2,920,000,000	101.09	2,951,944,300	100.28	2,928,351,200	0.100	2026/9/20	0.91
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	2,840,000,000	105.14	2,985,976,000	103.00	2,925,398,800	0.400	2025/9/20	0.91
日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	2,850,000,000	101.58	2,895,179,500	100.92	2,876,305,500	0.100	2021/6/20	0.90
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	2,810,000,000	102.46	2,879,366,600	100.32	2,819,160,600	0.100	2026/6/20	0.88
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	2,710,000,000	104.15	2,822,588,300	102.16	2,768,644,400	0.300	2025/12/20	0.86
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	2,560,000,000	101.45	2,597,278,000	100.96	2,584,678,400	0.200	2019/9/20	0.81
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,430,000,000	106.66	2,591,975,600	104.34	2,535,680,700	0.600	2024/6/20	0.79
日本	国債証券	第115回利付国債（5年）	2,450,000,000	101.03	2,475,259,500	100.69	2,467,027,500	0.200	2018/9/20	0.77
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	2,310,000,000	106.37	2,457,147,000	104.30	2,409,491,700	0.600	2023/12/20	0.75
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	106.65	2,442,422,400	104.88	2,401,912,300	0.800	2022/9/20	0.75
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,290,000,000	105.82	2,423,278,000	103.65	2,373,722,400	0.500	2024/9/20	0.74
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	2,200,000,000	104.99	2,309,921,000	102.95	2,265,054,000	0.400	2025/3/20	0.71
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	104.03	2,184,651,000	102.82	2,159,262,000	1.500	2018/9/20	0.67
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	2,060,000,000	106.42	2,192,313,800	104.27	2,148,065,000	0.600	2024/3/20	0.67
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,010,000,000	105.48	2,120,148,000	104.20	2,094,580,800	1.300	2019/12/20	0.65
日本	国債証券	第324回利付国債（10年）	1,810,000,000	106.38	1,925,586,600	104.72	1,895,504,400	0.800	2022/6/20	0.59

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	82.37
地方債証券	5.62
特殊債券	7.45
社債券	4.17
合計	99.60

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1円		149,910,324	149,880,000	0.05

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

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

日本物価連動国債 マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	22,561,460,360	97.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		538,831,024	2.33
合計(純資産総額)		23,100,291,384	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)	13,430,000,000	102.50	14,151,191,000	104.65	14,391,802,880	0.100	2024/3/10	62.30
日本	国債証券	第19回利付国債 (物価連動・10年)	4,140,000,000	102.70	4,251,780,000	105.35	4,344,044,040	0.100	2024/9/10	18.81
日本	国債証券	第20回利付国債 (物価連動・10年)	3,630,000,000	102.45	3,726,372,870	105.60	3,825,613,440	0.100	2025/3/10	16.56

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.67

合計	97.67
----	-------

(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	デンマーク	27,884,293,767	17.74
	スウェーデン	23,880,668,812	15.20
	日本	22,103,124,600	14.07
	フランス	14,199,083,401	9.04
	アイルランド	14,135,363,956	8.99
	ポーランド	12,079,531,922	7.69
	シンガポール	7,450,494,763	4.74
	スペイン	7,344,878,604	4.67
	リトアニア	7,195,521,277	4.58
	フィリピン	7,180,052,905	4.57
	ハンガリー	6,173,973,985	3.93
	小計	149,626,987,992	95.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,520,083,950	4.79
合計(純資産総額)		157,147,071,942	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		130,642,942,516	83.13

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	20,000,000,000	100.42	20,085,200,000	100.19	20,039,200,000	0.100	2026/12/20	12.75
デンマーク	国債証券	DGB 7% 11/10/24	400,000,000	2,539.95	10,159,811,320	2,498.75	9,995,030,900	7.000	2024/11/10	6.36
アイルランド	国債証券	IRISH 5.4% 03/13/25	60,600,000	16,934.09	10,262,061,565	16,374.09	9,922,702,555	5.400	2025/3/13	6.31
デンマーク	国債証券	DGB 3% 11/15/21	400,000,000	1,905.95	7,623,836,400	1,886.11	7,544,441,900	3.000	2021/11/15	4.80
デンマーク	国債証券	DGB 1.5% 11/15/23	400,000,000	1,810.01	7,240,058,120	1,790.37	7,161,482,120	1.500	2023/11/15	4.56
フランス	国債証券	FRTR 8.5% 04/25/23	35,000,000	18,766.17	6,568,162,912	18,333.05	6,416,568,944	8.500	2023/4/25	4.08
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	41,500,000	15,403.81	6,392,581,150	14,943.22	6,201,440,346	3.500	2026/4/25	3.95
スウェーデン	国債証券	SGB 5% 12/01/20	400,000,000	1,572.79	6,291,196,520	1,548.44	6,193,773,900	5.000	2020/12/1	3.94
スウェーデン	国債証券	SGB 3.5% 06/01/22	400,000,000	1,550.29	6,201,172,760	1,523.34	6,093,360,800	3.500	2022/6/1	3.88
リトアニア	国債証券	LITHUN 7.375% 02/11/20	46,900,000	13,390.81	6,280,293,010	12,973.08	6,084,378,314	7.375	2020/2/11	3.87
スウェーデン	国債証券	SGB 2.5% 05/12/25	400,000,000	1,528.30	6,113,211,400	1,494.45	5,977,814,840	2.500	2025/5/12	3.80
フィリピン	国債証券	PHILIP 4% 01/15/21	46,800,000	12,355.21	5,782,239,965	12,093.05	5,659,548,460	4.000	2021/1/15	3.60
スウェーデン	国債証券	SGB 1.5% 11/13/23	400,000,000	1,417.41	5,669,640,720	1,390.73	5,562,937,300	1.500	2023/11/13	3.54
スペイン	国債証券	SPGB 4.6% 07/30/19	35,000,000	13,607.87	4,762,756,512	13,580.05	4,753,019,556	4.600	2019/7/30	3.02
アイルランド	国債証券	IRISH 5% 10/18/20	29,000,000	14,693.76	4,261,191,560	14,526.41	4,212,661,401	5.000	2020/10/18	2.68
ポーランド	国債証券	POLAND 6.375% 07/15/19	32,700,000	12,818.42	4,191,623,438	12,602.92	4,121,155,188	6.375	2019/7/15	2.62
シンガポール	国債証券	SIGB 3% 09/01/24	48,000,000	8,749.46	4,199,745,119	8,427.97	4,045,426,823	3.000	2024/9/1	2.57
シンガポール	国債証券	SIGB 2.75% 07/01/23	41,000,000	8,586.19	3,520,339,020	8,305.04	3,405,067,940	2.750	2023/7/1	2.17
ポーランド	国債証券	POLAND 3% 03/17/23	29,400,000	11,782.74	3,464,128,295	11,206.64	3,294,753,066	3.000	2023/3/17	2.10
デンマーク	国債証券	DGB 1.75% 11/15/25	175,000,000	1,844.94	3,228,659,192	1,819.05	3,183,338,847	1.750	2025/11/15	2.03
ポーランド	国債証券	POLAND 5% 03/23/22	25,000,000	12,834.46	3,208,616,877	12,400.79	3,100,198,626	5.000	2022/3/23	1.97
ハンガリー	国債証券	REPHUN 6.25% 01/29/20	23,000,000	12,508.46	2,876,946,085	12,504.93	2,876,134,051	6.250	2020/1/29	1.83
ハンガリー	国債証券	REPHUN 4% 03/25/19	15,000,000	11,830.54	1,774,582,425	11,785.99	1,767,898,933	4.000	2019/3/25	1.12
フランス	国債証券	FRTR 6.0% 10/25/25	9,000,000	18,073.54	1,626,618,960	17,567.49	1,581,074,111	6.000	2025/10/25	1.01
ポーランド	国債証券	POLAND 5.125% 04/21/21	12,600,000	12,624.01	1,590,626,087	12,408.13	1,563,425,042	5.125	2021/4/21	0.99
ハンガリー	国債証券	REPHUN 6.375% 03/29/21	12,000,000	12,826.86	1,539,223,345	12,749.50	1,529,941,001	6.375	2021/3/29	0.97

日本	国債証券	第9 4 回利付国債 (2 0 年)	1,200,000,000	120.64	1,447,692,000	120.10	1,441,308,000	2.100	2027/3/20	0.92
スペイン	国債証券	SPGB 5.9% 07/30/26	8,500,000	16,935.30	1,439,500,777	16,766.19	1,425,126,363	5.900	2026/7/30	0.91
フィリピン	国債証券	PHILIP 9.5% 02/02/30	7,500,000	18,010.43	1,350,782,437	17,953.18	1,346,488,955	9.500	2030/2/2	0.86
スペイン	国債証券	SPGB 4.1% 07/30/18	9,000,000	13,041.86	1,173,767,400	12,963.69	1,166,732,685	4.100	2018/7/30	0.74

(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	95.21
合計	95.21

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

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	294,347,000.00	34,089,503,458	33,490,801,660	21.31
	ユーロ	売建	305,059,400.00	37,435,974,389	37,140,981,950	23.63
	スウェーデンクローナ	売建	1,890,342,200.00	24,329,838,319	24,366,510,958	15.51
	デンマーククローネ	売建	1,724,167,000.00	28,454,272,834	28,224,613,790	17.96
	シンガポールドル	売建	92,646,200.00	7,496,004,042	7,420,034,158	4.72

(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 (%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		81,883,655	100.00
合計(純資産総額)		81,883,655	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

該当事項はありません。

ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

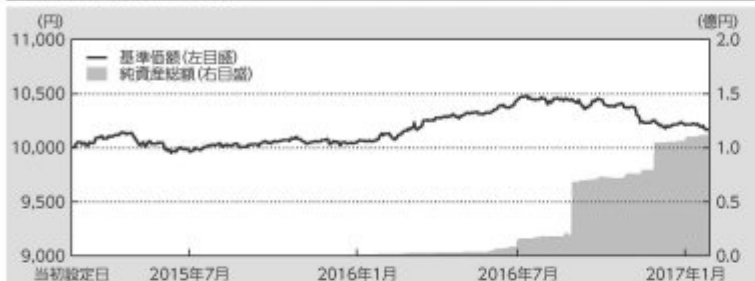
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2015年2月20日
作成基準日：2017年1月31日

基準価額・純資産の推移



基準価額	10,167円
純資産総額	1.18億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2015年7月	2016年7月	-	-	-
分配金	0円	0円	-	-	-

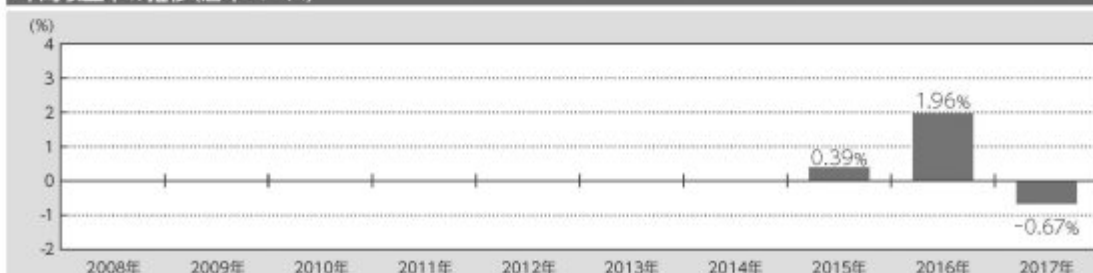
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
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	59.7%
HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス	14.8%
国内債券インデックス マザーファンド	14.7%
日本物価連動国債 マザーファンド	9.6%
マネープールマザーファンド	0.0%

※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、2017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号口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

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

< 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。

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（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、以下の手続きで行います。

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(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ものを除きます。）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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社が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2期計算期間(平成27年 7月11日から平成28年 7月11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)	第2期 (平成28年 7月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,000	220,785
投資信託受益証券	121,862	2,308,147
親投資信託受益証券	370,777	13,404,735
流動資産合計	500,639	15,933,667
資産合計	500,639	15,933,667
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	19,905
未払受託者報酬	23	610
未払委託者報酬	978	9,468
その他未払費用	-	50
流動負債合計	1,001	30,033
負債合計	1,001	30,033
純資産の部		
元本等		
元本	500,000	15,177,176
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	362	726,458
(分配準備積立金)	1,787	200,655
元本等合計	499,638	15,903,634
純資産合計	499,638	15,903,634
負債純資産合計	500,639	15,933,667

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成27年 2月20日 至 平成27年 7月10日	自	平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		639		214,243
営業収益合計		639		214,243
営業費用				
支払利息		-		24
受託者報酬		23		681
委託者報酬		978		10,809
その他費用		-		50
営業費用合計		1,001		11,564
営業利益又は営業損失（ ）		362		202,679
経常利益又は経常損失（ ）		362		202,679
当期純利益又は当期純損失（ ）		362		202,679
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		-		1,667
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		-		528,877
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		528,877
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,069
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,069
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		362		726,458

(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	(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。
2. その他	(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。 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、当計算期間末日が休業日のため、第2期計算期間は平成27年 7月11日から平成28年 7月11日までとなっております。

(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 (平成28年 7月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	500,000口	15,177,176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 1.0479円 (1万口当たり純資産額) (10,479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	第2期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日																								
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,787円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	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	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>30,600円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>168,291円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>525,803円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	30,600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	168,291円	収益調整金額	C	525,803円
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																							
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	30,600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	168,291円																							
収益調整金額	C	525,803円																							

第1期 自 平成27年 2月20日 至 平成27年 7月10日			第2期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日		
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	1,764円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,787円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	726,458円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口	当ファンドの期末残存口数	F	15,177,176口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	35円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	478円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第2期 (平成28年 7月11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

	第2期 (平成28年 7月11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>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第1期	第2期
	自 平成27年 2月20日 至 平成27年 7月10日	自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11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	14,787,075円
期中一部解約元本額	- 円	109,899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)	第2期 (平成28年 7月11日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	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	13,026
親投資信託受益証券	1,223	187,371

合計	639	200,397
----	-----	---------

（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	2,153,1947	2,308,147	
投資信託受益証券合計		2,153,1947	2,308,147	
親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	1,630,587	2,336,957	
	日本物価連動国債 マザーファンド	1,551,237	1,546,893	
	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	8,680,190	9,510,884	
	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		11,871,967	13,404,735	
合計			15,712,882	

(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）

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、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 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,386,471,297
国債証券	260,622,928,350
地方債証券	18,068,096,237
特殊債券	24,231,215,170
社債券	13,812,029,100
派生商品評価勘定	2,288,056
未収利息	661,386,288
前払費用	5,504,093
流動資産合計	318,789,918,591
資産合計	318,789,918,591
負債の部	
流動負債	
前受金	2,290,000
未払金	420,000
未払解約金	133,397,522
未払利息	2,964
その他未払費用	48,849
流動負債合計	136,159,335
負債合計	136,159,335
純資産の部	
元本等	
元本	222,332,473,989
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	96,321,285,267
元本等合計	318,653,759,256
純資産合計	318,653,759,256
負債純資産合計	318,789,918,591

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 7月11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>
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 7月11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 7月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	222,332,473,989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 107,012,000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 1.4332円 (1万口当たり純資産額) (14,332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28年 7月11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。
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28年 7月11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28年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	平成28年 7月11日現在
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	44,765,463,284円
期中一部解約元本額	68,437,886,834円
期末元本額	222,332,473,989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）	2,879,646,076円
S B I 資産設計オープン（分配型）	23,213,515円
S M T 国内債券インデックス・オープン	7,990,969,103円
世界経済インデックスファンド	608,240,631円
マイセクション25	69,320,897円
マイセクション50	65,773,737円
マイセクション75	18,080,496円
D Cマイセクション25	13,798,871,747円
D Cマイセクション50	15,374,661,808円
D Cマイセクション75	4,412,498,131円
D C日本債券インデックス・オープン	427,464,048円
D C日本債券インデックス・オープンS	64,820,544,948円
D C日本債券インデックス・オープンP	27,604,141,097円
D CマイセクションS25	5,568,320,656円
D CマイセクションS50	5,919,891,941円
D CマイセクションS75	1,164,316,651円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	1,253,416,860円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	735,835,637円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	194,926,409円
D C世界経済インデックスファンド	732,735,443円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,040,738,868円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	11,917,219円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	111,202,765円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	19,703,021円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	857,124円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	453,622,554円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	634,345,116円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	129,125,589円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	230,125,328円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	6,806,123,628円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,251,033,387円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,626,682,920円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,086,490,113円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,673,023,862円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,670,163,005円

区分	平成28年 7月11日現在
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,450,007,509円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,892,814,549円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,664,862,206円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	203,667,064円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,859,110,334円
日本債券ファンド・シリーズ1	8,549,373,194円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,480,011,481円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,235,236,037円
分散投資コア戦略ファンドA	1,072,784,332円
分散投資コア戦略ファンドS	478,636,295円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	19,880,520円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	271,834,949円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	16,331,459,862円
コア投資戦略ファンド（切替型）	793,538,118円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	57,403,113円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,784,782円
SMT インデックスバランス・オープン	77,756,455円
債券コア戦略ファンド	1,630,587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）	707,034,422円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	4,741,396,610円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,366,730,050
地方債証券	89,893,501
特殊債券	88,413,206
社債券	86,963,910
合計	4,632,000,667

(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28年 7月11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	919,311,944	-	921,600,000	2,288,056
	合計	919,311,944	-	921,600,000	2,288,056

(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355回利付国債(2年)	1,070,000,000	1,075,382,100	
	第356回利付国債(2年)	1,090,000,000	1,095,907,800	
	第357回利付国債(2年)	740,000,000	744,299,400	
	第360回利付国債(2年)	600,000,000	604,188,000	
	第362回利付国債(2年)	1,390,000,000	1,400,744,700	
	第364回利付国債(2年)	2,160,000,000	2,178,165,600	
	第365回利付国債(2年)	300,000,000	302,643,000	
	第106回利付国債(5年)	3,260,000,000	3,281,581,200	
	第107回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,129,060,800	
	第108回利付国債(5年)	590,000,000	593,923,500	
	第109回利付国債(5年)	1,190,000,000	1,199,067,800	
	第110回利付国債(5年)	700,000,000	707,707,000	
	第111回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,215,252,000	
	第112回利付国債(5年)	900,000,000	913,068,000	
	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	4,445,182,300	
	第114回利付国債(5年)	810,000,000	821,607,300	
	第115回利付国債(5年)	2,450,000,000	2,479,718,500	
	第116回利付国債(5年)	3,830,000,000	3,882,279,500	
	第117回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,572,940,800	
	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,567,809,700	
	第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,013,500,000	
	第120回利付国債(5年)	3,080,000,000	3,135,132,000	
	第121回利付国債(5年)	630,000,000	639,242,100	
第122回利付国債(5年)	3,560,000,000	3,616,354,800		
第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,193,317,200		

第124回利付国債（5年）	2,810,000,000	2,861,619,700	
第125回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,680,611,600	
第126回利付国債（5年）	3,100,000,000	3,164,294,000	
第127回利付国債（5年）	2,500,000,000	2,554,800,000	
第128回利付国債（5年）	490,000,000	501,328,800	
第1回利付国債（40年）	150,000,000	256,743,000	
第2回利付国債（40年）	420,000,000	701,374,800	
第3回利付国債（40年）	420,000,000	710,892,000	
第4回利付国債（40年）	530,000,000	907,662,100	
第5回利付国債（40年）	490,000,000	813,581,300	
第6回利付国債（40年）	690,000,000	1,133,511,300	
第7回利付国債（40年）	730,000,000	1,156,268,900	
第8回利付国債（40年）	670,000,000	994,393,900	
第9回利付国債（40年）	190,000,000	210,550,400	
第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,141,267,700	
第289回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,556,956,100	
第290回利付国債（10年）	470,000,000	483,855,600	
第291回利付国債（10年）	840,000,000	863,343,600	
第292回利付国債（10年）	1,110,000,000	1,148,372,700	
第293回利付国債（10年）	370,000,000	385,436,400	
第294回利付国債（10年）	180,000,000	187,158,600	
第295回利付国債（10年）	100,000,000	103,587,000	
第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,185,218,000	
第297回利付国債（10年）	560,000,000	584,029,600	
第298回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,727,147,000	
第299回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,368,399,800	
第300回利付国債（10年）	830,000,000	871,500,000	
第301回利付国債（10年）	640,000,000	675,232,000	
第302回利付国債（10年）	200,000,000	210,416,000	
第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,468,437,700	
第304回利付国債（10年）	480,000,000	505,540,800	
第305回利付国債（10年）	2,160,000,000	2,283,616,800	
第306回利付国債（10年）	1,370,000,000	1,460,036,400	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	743,393,000	
第308回利付国債（10年）	990,000,000	1,055,201,400	
第309回利付国債（10年）	1,780,000,000	1,883,400,200	
第310回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,152,794,900	
第311回利付国債（10年）	610,000,000	639,957,100	
第312回利付国債（10年）	1,670,000,000	1,787,100,400	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,650,000,000	1,779,673,500	
第314回利付国債（10年）	910,000,000	972,844,600	
第315回利付国債（10年）	900,000,000	970,074,000	

第316回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,169,395,600	
第317回利付国債(10年)	620,000,000	667,864,000	
第318回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,082,629,100	
第319回利付国債(10年)	750,000,000	810,960,000	
第320回利付国債(10年)	1,220,000,000	1,312,390,600	
第321回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,770,462,000	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	805,305,000	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,044,777,300	
第324回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,938,546,200	
第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,460,467,600	
第326回利付国債(10年)	600,000,000	642,552,000	
第327回利付国債(10年)	740,000,000	797,364,800	
第328回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,834,982,000	
第329回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,896,440,000	
第330回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,782,368,400	
第331回利付国債(10年)	680,000,000	728,980,400	
第332回利付国債(10年)	2,360,000,000	2,535,088,400	
第333回利付国債(10年)	2,060,000,000	2,216,292,200	
第334回利付国債(10年)	2,400,000,000	2,587,176,000	
第335回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,561,267,400	
第336回利付国債(10年)	890,000,000	955,361,600	
第337回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,425,667,500	
第338回利付国債(10年)	2,210,000,000	2,355,285,400	
第339回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,285,528,400	
第340回利付国債(10年)	2,840,000,000	3,032,154,400	
第341回利付国債(10年)	2,810,000,000	2,973,766,800	
第342回利付国債(10年)	3,460,000,000	3,594,455,600	
第343回利付国債(10年)	1,030,000,000	1,070,005,200	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	56,027,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	217,129,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	161,817,600	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	158,875,200	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	67,541,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	264,284,300	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	249,181,200	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	65,529,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	298,668,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	191,280,000	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	116,902,800	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	260,374,100	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	393,199,400	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	428,847,000	

第15回利付国債(30年)	340,000,000	493,792,200
第16回利付国債(30年)	370,000,000	538,738,500
第17回利付国債(30年)	330,000,000	475,592,700
第18回利付国債(30年)	445,000,000	634,458,750
第19回利付国債(30年)	280,000,000	400,436,400
第20回利付国債(30年)	420,000,000	617,925,000
第21回利付国債(30年)	270,000,000	387,695,700
第22回利付国債(30年)	400,000,000	591,608,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	638,593,000
第24回利付国債(30年)	320,000,000	476,224,000
第25回利付国債(30年)	350,000,000	508,294,500
第26回利付国債(30年)	520,000,000	768,606,800
第27回利付国債(30年)	730,000,000	1,102,679,600
第28回利付国債(30年)	530,000,000	805,101,800
第29回利付国債(30年)	760,000,000	1,146,908,400
第30回利付国債(30年)	610,000,000	912,736,900
第31回利付国債(30年)	740,000,000	1,098,411,600
第32回利付国債(30年)	930,000,000	1,411,544,700
第33回利付国債(30年)	920,000,000	1,340,752,800
第34回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,651,360,900
第35回利付国債(30年)	1,180,000,000	1,741,550,200
第36回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,661,206,400
第37回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,701,546,000
第38回利付国債(30年)	590,000,000	855,134,200
第39回利付国債(30年)	850,000,000	1,257,923,500
第40回利付国債(30年)	630,000,000	918,344,700
第41回利付国債(30年)	580,000,000	832,271,000
第42回利付国債(30年)	670,000,000	963,975,900
第43回利付国債(30年)	800,000,000	1,154,144,000
第44回利付国債(30年)	720,000,000	1,041,544,800
第45回利付国債(30年)	580,000,000	809,007,200
第46回利付国債(30年)	750,000,000	1,048,635,000
第47回利付国債(30年)	820,000,000	1,170,853,400
第48回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,457,012,400
第49回利付国債(30年)	630,000,000	867,925,800
第50回利付国債(30年)	720,000,000	867,794,400
第51回利付国債(30年)	310,000,000	328,497,700
第36回利付国債(20年)	70,000,000	72,804,200
第37回利付国債(20年)	70,000,000	72,887,500
第38回利付国債(20年)	20,000,000	21,032,000
第39回利付国債(20年)	500,000,000	524,955,000
第40回利付国債(20年)	100,000,000	105,822,000
第41回利付国債(20年)	330,000,000	346,592,400

第42回利付国債（20年）	80,000,000	86,408,000	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	154,648,200	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	188,050,600	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	319,710,500	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	187,328,100	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	99,741,600	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	146,712,800	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	156,318,400	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	243,546,600	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	111,756,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	124,250,500	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	90,916,000	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	228,400,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	159,230,400	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	171,631,500	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	273,153,600	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	343,134,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	227,304,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	390,985,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	262,627,200	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	346,777,600	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	230,898,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	373,507,200	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	257,901,600	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	384,331,200	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	153,038,600	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	228,171,000	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	465,273,900	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	489,400,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	241,438,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	759,162,600	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	432,806,400	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	242,184,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	158,033,200	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	323,400,600	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	349,945,900	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	204,438,600	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	327,175,200	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	268,609,000	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	474,536,400	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	735,720,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	357,256,800	

第84回利付国債(20年)	670,000,000	818,887,400
第85回利付国債(20年)	290,000,000	358,529,900
第86回利付国債(20年)	210,000,000	263,804,100
第87回利付国債(20年)	550,000,000	685,443,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	529,674,600
第89回利付国債(20年)	350,000,000	437,825,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	790,965,000
第91回利付国債(20年)	450,000,000	569,677,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,100,466,400
第93回利付国債(20年)	410,000,000	510,429,500
第94回利付国債(20年)	610,000,000	766,105,100
第95回利付国債(20年)	610,000,000	783,142,400
第96回利付国債(20年)	320,000,000	403,648,000
第97回利付国債(20年)	490,000,000	626,386,600
第98回利付国債(20年)	440,000,000	557,418,400
第99回利付国債(20年)	940,000,000	1,195,181,800
第100回利付国債(20年)	600,000,000	773,214,000
第101回利付国債(20年)	285,000,000	374,102,400
第102回利付国債(20年)	380,000,000	500,821,000
第103回利付国債(20年)	360,000,000	470,059,200
第104回利付国債(20年)	320,000,000	410,252,800
第105回利付国債(20年)	670,000,000	861,981,800
第106回利付国債(20年)	330,000,000	428,679,900
第107回利付国債(20年)	150,000,000	193,759,500
第108回利付国債(20年)	380,000,000	481,175,000
第109回利付国債(20年)	340,000,000	432,082,200
第110回利付国債(20年)	790,000,000	1,024,479,900
第111回利付国債(20年)	330,000,000	434,029,200
第112回利付国債(20年)	750,000,000	976,492,500
第113回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,359,415,200
第114回利付国債(20年)	590,000,000	774,186,200
第115回利付国債(20年)	720,000,000	954,669,600
第116回利付国債(20年)	550,000,000	732,116,000
第117回利付国債(20年)	820,000,000	1,080,038,400
第118回利付国債(20年)	590,000,000	771,112,300
第119回利付国債(20年)	380,000,000	486,168,200
第120回利付国債(20年)	330,000,000	412,790,400
第121回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,413,948,000
第122回利付国債(20年)	280,000,000	359,156,000
第123回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,383,293,600
第124回利付国債(20年)	280,000,000	368,298,000
第125回利付国債(20年)	430,000,000	579,988,300
第126回利付国債(20年)	430,000,000	567,114,100

第127回利付国債（20年）	460,000,000	599,794,000	
第128回利付国債（20年）	620,000,000	810,482,600	
第129回利付国債（20年）	420,000,000	542,648,400	
第130回利付国債（20年）	630,000,000	815,875,200	
第131回利付国債（20年）	380,000,000	486,244,200	
第132回利付国債（20年）	730,000,000	936,035,200	
第133回利付国債（20年）	680,000,000	882,585,600	
第134回利付国債（20年）	420,000,000	546,285,600	
第135回利付国債（20年）	380,000,000	488,216,400	
第136回利付国債（20年）	510,000,000	647,123,700	
第137回利付国債（20年）	290,000,000	373,630,200	
第138回利付国債（20年）	390,000,000	489,867,300	
第139回利付国債（20年）	410,000,000	521,610,200	
第140回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,369,456,400	
第141回利付国債（20年）	360,000,000	465,962,400	
第142回利付国債（20年）	820,000,000	1,074,995,400	
第143回利付国債（20年）	750,000,000	959,827,500	
第144回利付国債（20年）	590,000,000	745,116,900	
第145回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,792,509,600	
第146回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,769,564,000	
第147回利付国債（20年）	1,370,000,000	1,761,463,800	
第148回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,397,979,000	
第149回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,923,166,200	
第150回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,645,071,800	
第151回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,551,000,200	
第152回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,661,824,800	
第153回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,624,793,000	
第154回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,565,721,600	
第155回利付国債（20年）	1,460,000,000	1,732,012,600	
第156回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,165,493,400	
第157回利付国債（20年）	450,000,000	463,324,500	
第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	101,044,000	
第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,524,000	
国債証券合計	226,090,000,000	260,622,928,350	
地方債証券			
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,155,000	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,128,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	145,337,000	
第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	143,908,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	125,696,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	127,069,000	
第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	253,428,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	252,332,000	

第 6 9 5 回東京都公募公債	100,000,000	105,648,000	
第 6 9 6 回東京都公募公債	100,000,000	105,897,000	
第 7 0 0 回東京都公募公債	100,000,000	105,278,000	
第 7 0 2 回東京都公募公債	200,000,000	211,334,000	
第 7 1 6 回東京都公募公債	100,000,000	104,787,000	
第 7 1 7 回東京都公募公債	100,000,000	104,042,000	
第 7 2 0 回東京都公募公債	100,000,000	105,886,000	
第 7 2 8 回東京都公募公債	100,000,000	104,645,000	
平成 1 9 年度第 9 回北海道公募公債	110,000,000	112,603,700	
平成 2 0 年度第 1 4 回北海道公募公債	100,000,000	104,571,000	
平成 2 2 年度第 1 1 回北海道公募公債	100,000,000	106,051,000	
平成 2 3 年度第 6 回北海道公募公債	200,000,000	211,316,000	
平成 2 4 年度第 1 4 回北海道公募公債	100,000,000	105,064,000	
第 4 回神奈川県公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	148,769,000	
第 2 0 回神奈川県公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	125,086,000	
第 2 7 回神奈川県公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	122,633,000	
第 1 5 0 回神奈川県公募公債	100,000,000	102,424,000	
第 1 7 2 回神奈川県公募公債	200,000,000	209,924,000	
第 2 1 0 回神奈川県公募公債	200,000,000	207,076,000	
第 7 回大阪府公募公債（ 2 0 年 ）	200,000,000	250,636,000	
第 9 1 回大阪府公募公債（ 5 年 ）	100,000,000	100,271,000	
第 3 0 7 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	102,400,000	
第 3 1 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	102,743,000	
第 3 2 2 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	104,124,000	
第 3 4 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	105,595,000	
第 3 4 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	106,592,000	
第 3 6 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	105,426,000	
第 3 7 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	103,704,000	
第 3 7 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	105,702,000	
第 3 8 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	104,096,000	
平成 2 2 年度第 2 回京都府公募公債	100,000,000	104,900,000	
平成 2 3 年度第 5 回京都府公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	125,413,000	
平成 2 5 年度第 7 回京都府公募公債	100,000,000	105,527,000	
第 1 回兵庫県公募公債（ 1 2 年 ）	100,000,000	108,455,000	
第 3 回兵庫県公募公債（ 1 2 年 ）	100,000,000	104,586,000	
第 7 回兵庫県公募公債（ 1 5 年 ）	100,000,000	112,543,000	
平成 2 2 年度第 1 回兵庫県公募公債	100,000,000	105,457,000	
平成 2 5 年度第 4 回兵庫県公募公債	100,000,000	105,575,000	
第 9 回静岡県公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	133,872,000	
平成 2 0 年度第 4 回静岡県公募公債	100,000,000	103,526,000	
平成 2 3 年度第 3 回静岡県公募公債	103,290,000	109,316,971	
平成 2 3 年度第 8 回静岡県公募公債	100,000,000	105,453,000	

平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	104,332,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,087,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	128,012,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	210,622,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,643,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,935,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,419,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,083,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,945,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	127,147,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,330,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,966,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,546,000	
平成20年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,815,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,757,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	204,477,710	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	106,097,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	105,326,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	104,807,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	124,196,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	128,348,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	211,758,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	145,617,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	126,729,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	105,239,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,276,400	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	105,767,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	104,584,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	162,198,432	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,374,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,263,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,447,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,474,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,471,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,122,000	

第 8 9 回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,774,924	
第 9 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,878,000	
第 9 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,595,000	
第 9 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,656,000	
第 9 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,947,000	
第 9 7 回共同発行市場公募地方債	356,000,000	379,588,560	
第 9 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,771,000	
第 1 0 2 回共同発行市場公募地方債	150,000,000	158,008,500	
第 1 0 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,785,000	
第 1 0 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,094,000	
第 1 1 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,232,000	
第 1 1 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,883,000	
第 1 1 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,436,000	
第 1 1 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,180,000	
第 1 2 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,625,000	
第 1 2 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,730,000	
第 1 2 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,636,000	
第 1 3 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,495,000	
第 1 3 2 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,532,000	
第 1 3 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,660,000	
第 1 3 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,342,000	
第 1 4 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,963,000	
第 1 4 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,586,000	
第 1 4 6 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,240,000	
平成 2 4 年度第 2 回熊本県公募公債（ 1 0 年 ）	200,000,000	209,670,000	
平成 2 2 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	104,432,000	
第 1 3 回大阪市公募公債（ 2 0 年 ）	200,000,000	254,496,000	
平成 2 2 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	105,045,000	
第 5 回名古屋市公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	147,754,000	
第 9 回名古屋市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	124,749,000	
第 1 1 回名古屋市公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	138,820,000	
第 4 8 1 回名古屋市公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	104,586,000	
平成 2 2 年度第 2 回京都市公募公債	102,000,000	106,694,040	
平成 2 3 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	105,827,000	
平成 2 4 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	104,831,000	
平成 2 4 年度第 5 回京都市公募公債	100,000,000	105,392,000	
平成 2 4 年度第 6 回京都市公募公債	100,000,000	100,243,000	
第 5 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	119,083,000	
第 2 0 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	126,530,000	
平成 2 1 年度第 1 回横浜市公募公債	200,000,000	209,090,000	
平成 2 1 年度第 5 回横浜市公募公債	100,000,000	105,255,000	
平成 2 3 年度第 5 回横浜市公募公債	100,000,000	105,618,000	

	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,947,000	
	平成25年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	100,611,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,361,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	124,734,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	104,239,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	104,870,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,543,000	
	平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	102,419,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	208,422,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,937,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	157,302,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	211,396,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	126,351,000	
	地方債証券合計	16,492,990,000	18,068,096,237	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,044,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,565,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	115,422,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,691,000	
	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	108,974,000	
	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	218,246,000	
	第14回道路債券	100,000,000	111,943,000	
	第17回道路債券	100,000,000	109,566,000	
	第21回道路債券	100,000,000	141,444,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,717,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	168,226,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,632,000	
	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	307,293,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,467,000	
	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	102,268,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,002,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,574,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,358,000	
	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	30,736,800	

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	113,849,370	
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	103,632,000	
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	187,494,280	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,316,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	317,427,000	
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	164,816,000	
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	253,832,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,358,000	
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	314,376,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,435,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,590,000	
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	145,218,780	
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	145,596,000	
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	105,349,000	
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	104,290,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,783,000	
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	208,752,000	
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	208,220,000	
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	211,048,000	
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	129,253,000	
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	105,632,000	
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	106,421,000	
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	105,731,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,404,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,018,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	316,615,880	
	200,000,000	210,996,000	

第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,533,000	
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	105,016,000	
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	314,526,000	
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	125,977,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,571,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,539,000	
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	209,138,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,590,000	
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	312,894,000	
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	212,572,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	156,436,000	
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	104,889,000	
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	247,212,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	107,233,620	
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	105,038,000	
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	104,749,000	
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	104,380,000	
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	103,840,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,914,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	209,534,600	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,526,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,886,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,345,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,988,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	332,640,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	117,196,200	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	112,347,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	116,310,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	144,979,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,677,200	

第 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,102,000	
第 1 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,225,000	
第 1 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,503,000	
第 1 5 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,816,000	
第 1 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,116,760	
第 1 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,476,000	
第 2 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,305,430	
第 2 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,433,700	
第 2 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,674,000	
第 2 4 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	123,288,000	
第 3 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,171,000	
第 3 8 回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,665,000	
第 4 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,775,000	
第 4 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,486,000	
第 4 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,783,000	
第 4 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,267,000	
第 5 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,854,000	
第 5 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,862,000	
第 5 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,133,000	
第 6 5 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,326,000	
第 5 回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	81,974,400	
第 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	105,333,910	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	128,310,000	
第 4 3 回都市再生債券	100,000,000	105,294,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	117,931,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	111,105,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	21,590,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,101,000	26,931,866	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,134,000	23,913,352	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,614,000	24,645,415	
第 3 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	105,623,000	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,466,000	28,665,853	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	24,284,000	26,262,174	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	19,394,000	20,543,288	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	40,450,000	43,684,786	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	23,554,000	25,267,082	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	21,384,000	23,098,141	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	25,138,000	26,930,590	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	21,055,000	22,753,927	

第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,091,000	26,656,929	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,101,000	31,500,094	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,456,000	31,822,560	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,577,000	39,026,545	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,286,000	39,937,460	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,691,000	41,435,600	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,040,000	46,822,785	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,801,000	49,739,886	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,760,000	50,602,269	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,295,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,384,000	106,350,152	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,698,000	26,264,594	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,547,000	57,583,908	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,741,000	26,280,137	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,108,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,505,000	26,557,538	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,805,000	67,906,022	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,617,000	24,466,392	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,285,000	68,607,901	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,292,000	65,509,066	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,450,000	27,677,893	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,950,000	129,055,404	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,105,000	70,119,387	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,527,000	27,565,075	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,870,000	80,146,837	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,320,000	78,496,392	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,518,000	78,767,185	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,248,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,234,000	160,253,105	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,786,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,910,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,972,000	166,951,128	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,265,000	84,725,326	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,413,000	85,708,196	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,404,000	86,910,166	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,939,000	82,882,670	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,036,000	82,311,592	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,551,000	87,214,716	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	190,696,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,159,000	84,609,427	

第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,258,000	89,919,907
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,368,000	91,177,833
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,897,000	91,455,616
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	124,675,000
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,422,000	187,792,723
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,596,000	93,849,122
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,428,000	190,798,137
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,692,000	97,891,275
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,406,000	98,319,128
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,468,000	98,977,902
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,106,000	202,110,880
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,962,000	100,693,886
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,906,000	102,884,520
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,550,000
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	143,863,000
第 1 2 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	122,369,000
第 1 1 回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,807,000
い第 7 5 0 号商工債	100,000,000	100,400,000
い第 7 5 2 号商工債	200,000,000	200,890,000
い第 7 5 6 号商工債	100,000,000	100,533,000
い第 7 7 9 号商工債	100,000,000	100,739,000
い第 7 4 8 号農林債	100,000,000	100,411,000
い第 7 4 9 号農林債	300,000,000	301,125,000
い第 7 5 2 号農林債	200,000,000	200,890,000
い第 7 8 0 号農林債	100,000,000	100,987,000
第 2 7 4 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,350,000
第 2 9 0 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,724,000
第 2 9 9 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,574,000
第 3 0 0 回信金中金債（5年）	300,000,000	302,019,000
第 3 0 3 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,815,000
第 3 0 9 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,886,000
第 1 7 5 号商工債（3年）	100,000,000	100,156,000
第 1 7 8 号商工債（3年）	300,000,000	300,576,000
第 1 7 9 号商工債（3年）	200,000,000	200,378,000
第 1 9 回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,469,000
第 2 8 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,305,000
第 3 3 回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	210,700,000
第 5 9 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,400,000
第 5 3 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	209,624,000
第 6 0 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,403,000

特殊債券合計		22,458,473,000	24,231,215,170	
社債券	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	101,089,000	
	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	100,894,000	
	第6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	100,636,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,796,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	101,172,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	101,142,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円 貨社債	100,000,000	100,971,000	
	第11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	101,275,000	
	第9回オーストラリア・ニュージーランド銀 行円貨社債	100,000,000	101,326,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,186,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	101,070,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,901,000	
	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	100,625,000	
	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	102,942,000	
	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	105,492,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	102,122,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	106,378,000	
	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	104,767,000	
	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	103,922,000	
	第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	105,058,000	
	第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,306,000	
	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	103,607,000	
	第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,677,000	
	第1回富士フイルムホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,585,000	
	第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保 社債	100,000,000	104,406,000	
	第9回JXホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	104,480,000	
	第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,548,000	
	第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,541,000	
	第22回JFEホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	103,581,000	
	第28回住友金属鉱山株式会社無担保 社債	100,000,000	101,726,000	
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	101,992,000		

第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,553,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	204,768,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,823,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,403,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	205,322,000	
第24回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,913,000	
第29回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,332,000	
第37回川崎重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,188,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,546,000	
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	100,714,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,913,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,509,000	
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	101,324,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	106,206,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,873,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,769,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	126,371,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,816,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,260,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,282,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	104,222,000	
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,403,000	
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	133,554,000	
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	105,274,000	
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	107,454,000	
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	104,574,000	
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	107,047,000	
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	106,544,000	
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	105,236,000	
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	106,546,000	
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	105,598,000	
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	107,623,000	
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	205,990,000	

第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,183,000	
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	102,025,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,880,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	107,783,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,777,000	
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	101,361,000	
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	101,401,000	
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	104,472,000	
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	101,167,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	103,900,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,679,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	104,862,000	
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	105,879,000	
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	106,843,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,161,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,979,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	107,963,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,887,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,719,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,366,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,243,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	256,168,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,932,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,488,620	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	127,387,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,581,400	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,057,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	142,756,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	138,886,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,335,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	209,374,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,801,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	105,308,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	125,103,600	

第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,621,700	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,681,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,284,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,490,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,460,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,752,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	107,954,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,312,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,470,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,004,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,005,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,618,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,912,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	108,560,000	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,329,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	135,913,680	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	106,610,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,799,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,040,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,747,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,440,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,928,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,728,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	32,172,110	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	103,624,990	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,329,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,430,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,557,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	106,278,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	103,109,000	
社債券合計	13,127,000,000	13,812,029,100	
合計		316,734,268,857	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本物価連動国債 マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	367,253,522
国債証券	24,430,073,075
未収利息	7,777,905
流動資産合計	24,805,104,502
資産合計	24,805,104,502
負債の部	
流動負債	
未払解約金	561,278
未払利息	785
その他未払費用	10,031
流動負債合計	572,094
負債合計	572,094
純資産の部	
元本等	
元本	24,873,204,887
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,672,479
元本等合計	24,804,532,408
純資産合計	24,804,532,408
負債純資産合計	24,805,104,502

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 7月11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 7月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	24,873,204,887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 68,672,479円

		平成28年 7月11日現在
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)	0.9972円 (9,972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28年 7月11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28年 7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	

平成28年 7月11日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成28年 7月11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
期中追加設定元本額	5,058,866,132円
期中一部解約元本額	8,043,075,451円
期末元本額	24,873,204,887円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	15,209,494,918円
日本物価連動国債ファンド（SMA専用）	459,539,724円
債券コア戦略ファンド	1,551,237円
FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	8,526,325,878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）	676,293,130円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	640,174,205

合計	640,174,205
----	-------------

(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)	14,080,000,000	15,188,849,280	
	第19回利付国債(物価連動・10年)	5,090,000,000	5,388,681,200	
	第20回利付国債(物価連動・10年)	3,630,000,000	3,852,542,595	
合計		22,800,000,000	24,430,073,075	

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28年 7月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	33,586,595,207
コール・ローン	6,584,027,768
国債証券	163,564,057,013
派生商品評価勘定	399,213,661
未収利息	813,139,347

	平成28年 7月11日現在
項目	金額（円）
前払費用	220,826,375
流動資産合計	205,167,859,371
資産合計	205,167,859,371
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	96,826,686
未払金	35,518,236,920
未払解約金	356,140,436
未払利息	14,075
その他未払費用	76,570
流動負債合計	35,971,294,687
負債合計	35,971,294,687
純資産の部	
元本等	
元本	154,417,402,052
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,779,162,632
元本等合計	169,196,564,684
純資産合計	169,196,564,684
負債純資産合計	205,167,859,371

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 7月11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	為替予約取引による為替差損益

	平成28年 7月11日現在
	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 7月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	154,417,402,052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 1.0957円 (1万口当たり純資産額) (10,957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28年 7月11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28年 7月11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28年 7月11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	55,291,418,934円

区分	平成28年 7月11日現在
期中一部解約元本額	23,376,845,088円
期末元本額	154,417,402,052円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセクション(SMA専用)	86,896,444,742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)	1,011,777,105円
債券コア戦略ファンド	8,680,190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)	48,198,620,692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)	14,617,084,836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)	3,684,794,487円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,952,943,064
合計	3,952,943,064

(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28年 7月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,008,083,916	-	2,007,926,517	157,399
	アメリカドル	203,248,006	-	203,328,692	80,686
	カナダドル	569,813,661	-	569,444,563	369,098
	ユーロ	457,075,046	-	456,951,789	123,257
	イギリスポンド	459,962,569	-	460,174,339	211,770
	シンガポールドル	317,984,634	-	318,027,134	42,500
	売建	155,727,111,011	-	155,424,566,637	302,544,374
	アメリカドル	53,758,739,058	-	53,674,641,085	84,097,973
	カナダドル	30,661,995,815	-	30,483,676,839	178,318,976
	ユーロ	35,583,540,984	-	35,482,008,324	101,532,660
	イギリスポンド	14,467,754,159	-	14,433,145,753	34,608,406

	シンガポールドル	21,255,080,995	-	21,351,094,636	96,013,641
	合計	157,735,194,927	-	157,432,493,154	302,386,975

(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1 1 回利付国債（30年）	300,000,000	389,676,000	
		第1 4 4 回利付国債（20年）	2,300,000,000	2,904,693,000	
		第1 4 5 回利付国債（20年）	1,400,000,000	1,818,488,000	
		第1 4 6 回利付国債（20年）	1,400,000,000	1,821,610,000	
		第1 4 7 回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,825,750,800	
		円 小計	6,820,000,000	8,760,217,800	
	アメリカドル	LITHUN 6.125% 03/09/21	21,400,000.00	25,130,234.00	
		LITHUN 6.625% 02/01/22	4,000,000.00	4,879,160.00	
		LITHUN 7.375% 02/11/20	39,900,000.00	47,269,530.00	
		PHILIP 10.625% 03/16/25	1,000,000.00	1,655,570.00	
		PHILIP 4% 01/15/21	64,400,000.00	71,301,426.00	
		PHILIP 6.375% 10/23/34	3,600,000.00	5,362,938.00	
		POLAND 3.25% 04/06/26	1,500,000.00	1,564,147.50	
		POLAND 3% 03/17/23	54,400,000.00	56,212,064.00	
		POLAND 5.125% 04/21/21	600,000.00	683,073.00	
		POLAND 5% 03/23/22	20,000,000.00	22,842,800.00	
		POLAND 6.375% 07/15/19	42,400,000.00	48,321,160.00	
		ROMANI 4.375% 08/22/23	600,000.00	652,338.00	
		ROMANI 4.875% 01/22/24	17,500,000.00	19,660,987.50	
		ROMANI 6.75% 02/07/22	47,900,000.00	57,364,321.50	
		T 1.25% 01/31/20	4,800,000.00	4,875,375.02	
T 1.375% 02/29/20	4,800,000.00	4,896,000.00			

	T 1.375% 03/31/20	3,500,000.00	3,570,478.52	
	T 1.625% 06/30/20	100,000.00	102,974.60	
	T 1.875% 05/31/22	33,400,000.00	34,894,519.40	
	T 1% 11/30/19	114,400,000.00	115,242,359.23	
	T 2.125% 08/31/20	200,000.00	210,101.56	
アメリカドル 小計		480,400,000.00	526,691,557.83 (53,095,775,944)	
カナダドル	CAN 1.5% 06/01/26	377,000,000.00	396,110,130.00	
カナダドル 小計		377,000,000.00	396,110,130.00 (30,559,896,529)	
ユーロ	FRTR 0.5% 05/25/25	107,900,000.00	113,187,639.50	
	FRTR 1.75% 11/25/24	6,900,000.00	7,981,161.00	
	FRTR 2.25% 05/25/24	11,600,000.00	13,851,038.00	
	IRISH 1% 05/15/26	22,400,000.00	23,633,456.00	
	RFGB 0.5% 04/15/26	13,000,000.00	13,576,225.00	
	RFGB 1.5% 04/15/23	66,800,000.00	75,114,930.00	
	SPGB 1.6% 04/30/25	68,400,000.00	71,941,410.00	
ユーロ 小計		297,000,000.00	319,285,859.50 (35,510,973,293)	
イギリスポンド	UKT 1.5% 01/22/21	400,000.00	421,204.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	94,000,000.00	109,796,230.00	
イギリスポンド 小計		94,400,000.00	110,217,434.00 (14,371,251,219)	
シンガポールドル	SIGB 2.25% 06/01/21	72,000,000.00	75,049,200.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	43,000,000.00	46,388,830.00	
	SIGB 2% 07/01/20	42,500,000.00	43,819,837.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	24,700,000.00	27,118,130.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	42,000,000.00	45,417,540.00	
	SIGB 3% 09/01/24	42,000,000.00	46,358,550.00	
シンガポールドル 小計		266,200,000.00	284,152,087.50 (21,265,942,228)	
合計			163,564,057,013 (154,803,839,213)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 21銘柄	100.0%	34.3%

カナダドル	国債証券	1銘柄	100.0%	19.7%
ユーロ	国債証券	7銘柄	100.0%	22.9%
イギリスポンド	国債証券	2銘柄	100.0%	9.3%
シンガポールドル	国債証券	6銘柄	100.0%	13.7%

(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28年 7月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,504,422,632
流動資産合計	1,504,422,632
資産合計	1,504,422,632
負債の部	
流動負債	
未払解約金	149
未払利息	3,216
その他未払費用	47,718
流動負債合計	51,083
負債合計	51,083
純資産の部	
元本等	
元本	1,497,014,003
剰余金	
剰余金又は欠損金()	7,357,546
元本等合計	1,504,371,549
純資産合計	1,504,371,549
負債純資産合計	1,504,422,632

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 7月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		1,497,014,003口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0049円 (10,049円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成28年 7月11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28年 7月11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	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28年 7月11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	3,239,057,090円
期中一部解約元本額	1,830,427,906円
期末元本額	1,497,014,003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

区分	平成28年 7月11日現在
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
SuMi TRUST マルチストラテジー / SMARS（SMA専用）	1,004,876円
欧州REIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,990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）	1,373,328,409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
私募マネープールファンドAL（適格機関投資家専用）	80,116,455円

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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

該当事項はありません。

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3期中間計算期間(平成28年 7月12日から平成29年 1月11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2期 (平成28年 7月11日現在)	第3期中間計算期間 (平成29年 1月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	220,785	1,463,623
投資信託受益証券	2,308,147	16,228,423
親投資信託受益証券	13,404,735	92,398,472
流動資産合計	15,933,667	110,090,518
資産合計	15,933,667	110,090,518
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,905	6,250
未払受託者報酬	610	10,628
未払委託者報酬	9,468	166,430
未払利息	-	1
その他未払費用	50	1,720
流動負債合計	30,033	185,029
負債合計	30,033	185,029
純資産の部		
元本等		
元本	15,177,176	107,599,351
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	726,458	2,306,138
(分配準備積立金)	200,655	149,575
元本等合計	15,903,634	109,905,489
純資産合計	15,903,634	109,905,489
負債純資産合計	15,933,667	110,090,518

（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	第3期中間計算期間 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	5,740	1,665,987
営業収益合計	5,740	1,665,987
営業費用		
支払利息	-	413
受託者報酬	71	10,628
委託者報酬	1,341	166,430
その他費用	-	1,720
営業費用合計	1,412	179,191
営業利益又は営業損失（ ）	4,328	1,845,178
経常利益又は経常損失（ ）	4,328	1,845,178
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,328	1,845,178
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-	107,946
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	362	726,458
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,990	3,819,147
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	3,819,147
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	502,235
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	502,235
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,956	2,306,138

(3) 【中間注記表】

(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	(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。
	(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。
2. その他	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、前計算期間末日が休業日のため、第3期中間計算期間は平成28年 7月12日から平成29年 1月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第2期 (平成28年 7月11日現在)	第3期中間計算期間 (平成29年 1月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,177,176口	107,599,351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 1.0479円 (1万口当たり純資産額) (10,479円)	1口当たり純資産額 1.0214円 (1万口当たり純資産額) (10,214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3期中間計算期間 (平成29年 1月11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3期中間計算期間 (平成29年 1月11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2期 自 平成27年 7月11日 至 平成28年 7月11日	第3期中間計算期間 自 平成28年 7月12日 至 平成29年 1月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	15,177,176円
期中追加設定元本額	14,787,075円	103,627,815円
期中一部解約元本額	109,899円	11,205,640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29年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,008,728,455
国債証券	262,909,394,100
地方債証券	18,163,530,336
特殊債証券	23,832,972,171
社債証券	13,587,110,260
未収利息	644,480,676
前払費用	16,464,349
流動資産合計	320,162,680,347
資産合計	320,162,680,347
負債の部	
流動負債	
未払金	382,093,648
未払解約金	190,855,650
未払利息	1,191
その他未払費用	1,758
流動負債合計	572,952,247
負債合計	572,952,247
純資産の部	
元本等	
元本	231,402,324,776
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	88,187,403,324
元本等合計	319,589,728,100
純資産合計	319,589,728,100
負債純資産合計	320,162,680,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 1月11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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	平成29年 1月11日現在

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	231,402,324,776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 105,363,000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 1.3811円 (1万口当たり純資産額) (13,811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29年 1月11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29年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	222,332,473,989円
期中追加設定元本額	20,694,320,776円
期中一部解約元本額	11,624,469,989円
期末元本額	231,402,324,776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）	2,948,204,209円
S B I 資産設計オープン（分配型）	20,832,560円
S M T 国内債券インデックス・オープン	8,422,792,374円
世界経済インデックスファンド	651,208,883円
マイセレクション25	68,713,794円
マイセレクション50	69,647,109円
マイセレクション75	19,505,764円
D Cマイセレクション25	15,294,093,498円
D Cマイセレクション50	17,823,167,777円
D Cマイセレクション75	4,700,259,771円
D C日本債券インデックス・オープン	440,613,303円
D C日本債券インデックス・オープンS	67,551,959,034円
D C日本債券インデックス・オープンP	29,398,419,853円
D CマイセレクションS25	6,204,713,002円
D CマイセレクションS50	7,006,845,147円
D CマイセレクションS75	1,325,823,279円
D Cターゲット・イヤール ファンド2025	1,226,299,556円
D Cターゲット・イヤール ファンド2035	854,509,905円
D Cターゲット・イヤール ファンド2045	211,951,324円
D C世界経済インデックスファンド	809,115,560円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	460,664,880円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	11,954,387円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	121,961,112円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,285,874円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	871,490円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	444,044,124円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	632,691,245円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	127,952,176円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	254,288,112円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	6,618,357,492円

区分	平成29年 1月11日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,316,248,724円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,888,474,538円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,122,811,394円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	910,357,932円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,744,609,975円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,557,378,639円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,850,062,517円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,668,345,805円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	201,007,238円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,544,818,536円
日本債券ファンド・シリーズ1	8,405,298,388円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,218,118,216円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,897,888,346円
分散投資コア戦略ファンドA	1,129,323,344円
分散投資コア戦略ファンドS	511,683,885円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	23,817,728円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	320,915,348円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	15,039,912,077円
コア投資戦略ファンド（切替型）	356,637,347円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	58,301,493円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,867,920円
SMT インデックスバランス・オープン	83,687,479円
債券コア戦略ファンド	11,790,821円
債券コア・セレクション	91,360,549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）	799,507,757円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	4,870,124,946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。

日本物価連動国債 マザーファンド

貸借対照表

	平成29年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	310,473,014
国債証券	22,637,575,130
未収利息	7,242,609

	平成29年 1月11日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	22,955,290,753
資産合計	22,955,290,753
負債の部	
流動負債	
未払解約金	79,240
未払利息	366
その他未払費用	1,020
流動負債合計	80,626
負債合計	80,626
純資産の部	
元本等	
元本	23,098,963,995
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	143,753,868
元本等合計	22,955,210,127
純資産合計	22,955,210,127
負債純資産合計	22,955,290,753

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 1月11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29年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,098,963,995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 143,753,868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 0.9938円 (1万口当たり純資産額) (9,938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29年 1月11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29年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	24,873,204,887円
期中追加設定元本額	514,700,890円
期中一部解約元本額	2,288,941,782円
期末元本額	23,098,963,995円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	14,053,320,479円
日本物価連動国債ファンド(SMA専用)	339,750,856円
債券コア戦略ファンド	10,623,643円
債券コア・セレクション	84,610,112円
FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用)	7,863,133,434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)	747,525,471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29年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,024,576,695
コール・ローン	7,004,665,212
国債証券	151,703,384,438
派生商品評価勘定	358,779,620
未収入金	33,819,313
未収利息	739,731,604
前払費用	1,225,744,657
流動資産合計	163,090,701,539
資産合計	163,090,701,539
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,653,022
未払金	5,244,522,072
未払解約金	51,768,602
未払利息	8,271
その他未払費用	22,314
流動負債合計	5,303,974,281
負債合計	5,303,974,281
純資産の部	
元本等	
元本	149,444,878,451
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,341,848,807
元本等合計	157,786,727,258
純資産合計	157,786,727,258
負債純資産合計	163,090,701,539

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 1月11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>

平成29年 1月11日現在	
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29年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	149,444,878,451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 1.0558円 (1万口当たり純資産額) (10,558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29年 1月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <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)デリバティブ取引</p> <p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p>

	平成29年 1月11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>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <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>

（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29年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	154,417,402,052円
期中追加設定元本額	7,171,847,683円
期中一部解約元本額	12,144,371,284円
期末元本額	149,444,878,451円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	80,998,931,791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）	943,316,916円
債券コア戦略ファンド	62,082,210円
債券コア・セレクション	478,695,405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）	43,159,248,668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）	19,532,962,151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）	4,269,641,310円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成29年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	131,805,593,042	-	131,454,466,444	351,126,598
	アメリカドル	34,089,503,458	-	34,097,156,480	7,653,022
	ユーロ	37,435,974,389	-	37,351,472,936	84,501,453
	スウェーデンク ローナ	24,329,838,319	-	24,139,669,894	190,168,425
	デンマーククロー ネ	28,454,272,834	-	28,397,030,490	57,242,344
	シンガポールドル	7,496,004,042	-	7,469,136,644	26,867,398
	合計	131,805,593,042	-	131,454,466,444	351,126,598

(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

項目	平成29年 1月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	94,439,816
流動資産合計	94,439,816
資産合計	94,439,816
負債の部	
流動負債	
未払解約金	489
未払利息	111
その他未払費用	283
流動負債合計	883
負債合計	883
純資産の部	
元本等	
元本	94,017,063
剰余金	
剰余金又は欠損金()	421,870
元本等合計	94,438,933

	平成29年 1月11日現在
項目	金額（円）
純資産合計	94,438,933
負債純資産合計	94,439,816

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,017,063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 1.0045円 (1万口当たり純資産額) (10,045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29年 1月11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	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29年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 7月12日
期首元本額	1,497,014,003円
期中追加設定元本額	2,797,384,644円
期中一部解約元本額	4,200,381,584円
期末元本額	94,017,063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

区分	平成29年 1月11日現在
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
SLIGARS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
Sumi TRUST マルチストラテジー/SMARS（SMA専用）	1,004,876円
欧州REIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり（毎月決算型）	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし（毎月決算型）	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
私募マネーボールファンドAL（適格機関投資家専用）	50,828,014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29年 1月31日現在)

資産総額	119,294,996円
負債総額	1,013,151円
純資産総額(-)	118,281,845円
発行済口数	116,336,444口
1口当たり純資産額(/)	1.0167円
(1万口当たり純資産額)	(10,167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29年 1月31日現在)

資産総額	322,470,402,789円
負債総額	1,849,346,529円
純資産総額(-)	320,621,056,260円
発行済口数	232,942,754,392口
1口当たり純資産額(/)	1.3764円
(1万口当たり純資産額)	(13,764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29年 1月31日現在)

資産総額	23,100,368,306円
負債総額	76,922円
純資産総額(-)	23,100,291,384円
発行済口数	23,321,053,802口
1口当たり純資産額(/)	0.9905円
(1万口当たり純資産額)	(9,905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29年 1月31日現在)

資産総額	157,334,914,257円
負債総額	187,842,315円
純資産総額（ - ）	157,147,071,942円
発行済口数	149,811,989,765口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0490円
（1万口当たり純資産額）	（10,490円）

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(平成29年 1月31日現在)

資産総額	84,884,166円
負債総額	3,000,511円
純資産総額（ - ）	81,883,655円
発行済口数	81,521,612口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0044円
（1万口当たり純資産額）	（10,044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29年 1月31日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成29年 4月11日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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29年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	474	8,984,299
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	44	189,687
単位型公社債投資信託	0	0
合計	518	9,173,986

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30期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28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31期事業年度の間接会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）の間接財務諸表について、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27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	12,314,170	16,534,066
前払費用	125,306	102,445
未収委託者報酬	4,518,944	5,528,610
繰延税金資産	116,728	121,367
その他	8,789	5,566
流動資産合計	17,083,939	22,292,056
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 57,461	1 55,487
器具備品	1 116,879	1 90,924
その他	-	1 3,748
有形固定資産合計	174,341	150,160
無形固定資産		
ソフトウェア	197,641	215,175
その他	7,648	5,886
無形固定資産合計	205,290	221,062
投資その他の資産		
投資有価証券	60,277	63,797
長期前払費用	5,425	8,021
長期貸付金	25,838	22,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	114,415	123,235
その他	463	235
貸倒引当金	25,838	22,838
投資その他の資産合計	205,581	220,289
固定資産合計	585,213	591,512
資産合計	17,669,152	22,883,569

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,868	14,543
未払金	2,578,595	3,057,975
未払手数料	1,896,826	2,223,498
その他未払金	681,769	834,477
未払費用	52,291	64,411
未払法人税等	924,882	1,445,329
未払消費税等	354,256	246,748
賞与引当金	94,769	98,630
その他	56,222	3,100
流動負債合計	4,074,887	4,930,740
固定負債		
資産除去債務	12,707	12,926
退職給付引当金	342,831	389,941
その他	-	3,056
固定負債合計	355,538	405,924
負債合計	4,430,425	5,336,665
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	65,500	68,500
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	10,419,991	14,729,555
利益剰余金合計	12,585,491	16,898,055
株主資本合計	13,235,491	17,548,055
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,235	1,151
評価・換算差額等合計	3,235	1,151
純資産合計	13,238,726	17,546,904
負債・純資産合計	17,669,152	22,883,569

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	28,159,652	32,163,066
運用受託報酬	8,732	-
営業収益合計	28,168,384	32,163,066
営業費用		
支払手数料	12,922,655	14,102,687
広告宣伝費	130,384	126,914
公告費	880	2,765
調査費	5,994,577	6,758,898
調査費	279,702	331,886
委託調査費	5,712,946	6,425,175
図書費	1,928	1,836
営業雑経費	1,299,065	1,399,773
通信費	17,456	17,552
印刷費	330,921	349,902
協会費	23,182	26,659
諸会費	105	105
情報機器関連費	857,009	927,524
その他営業雑経費	70,390	78,029
営業費用合計	20,347,563	22,391,039
一般管理費		
給料	2,185,555	2,123,392
役員報酬	89,055	89,280
給料・手当	1,839,000	1,759,320
賞与	257,499	274,792
退職給付費用	71,270	73,742
福利費	212,286	222,276
交際費	4,491	6,004
旅費交通費	55,788	67,392
租税公課	42,868	73,989
不動産賃借料	130,938	125,339
減価償却費	129,285	126,985
業務委託費	1 45,054	1 209,510
諸経費	167,290	217,580
一般管理費合計	3,044,830	3,246,214
営業利益	4,775,990	6,525,812

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業外収益		
受取利息	6,802	8,092

収益分配金		4,617		2,026
投資有価証券売却益		1,846		350
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,936		5,272
営業外収益合計		18,203		18,742
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	27,866
支払補償費		7,656		1,893
投資有価証券売却損		117		365
その他		3,283		14
営業外費用合計		38,924		30,139
経常利益		4,755,269		6,514,415
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		4,699,047		6,514,415
法人税、住民税及び事業税		1,667,610		2,183,255
法人税等調整額		30,739		11,403
法人税等合計		1,698,349		2,171,851
当期純利益		3,000,697		4,342,563

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563
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	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	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

当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

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。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

「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。）等を当事業年度から適用し、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、当事業年度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事業年度の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、当事業年度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。

未適用の会計基準等

- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1) 概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

(分類2)に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

(分類3)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

(分類4)に係る分類の要件を満たす企業が(分類2)又は(分類3)に該当する場合の取扱い

(2)適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

表示方法の変更

(損益計算書関係)

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「業務委託費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた212,345千円は、「業務委託費」45,054千円、「諸経費」167,290千円として組み替えております。

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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
建 物	45,415	千円	54,302	千円
器具備品	218,270	"	263,257	"
そ の 他	-	"	841	"
計	263,685	"	318,401	"

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)		当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	
業務委託費	37,614	千円	39,733	千円
長期前払費用償却	27,866	"	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28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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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

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28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28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28年3月31日	平成28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）

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 その他有価証券	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。

当事業年度（平成28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	16,534,066	16,534,066	-
（2）未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	63,794	63,794	-
（4）未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
（5）未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

（*）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27年3月31日	平成28年3月31日
非上場株式	3	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) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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	-

当事業年度(平成28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	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(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

当事業年度（平成28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	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

（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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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
20,015	350	365

（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27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
（1）退職給付債務	342,831	389,941
（2）退職給付引当金	342,831	389,941

（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27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
（1）退職給付費用	71,270	73,742

（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14,089千円、当事業年度で14,434千円であります。

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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	64,846	千円	86,931	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	8,356	"	6,993	"
賞与引当金損金算入限度超過額	31,368	"	30,437	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	110,871	"	119,400	"
外国税関連費用損金不算入額	18,609	"	-	"
その他	5,855	"	7,674	"
繰延税金資産 合計	239,908	"	251,436	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	1,546	"	-	"
投資有価証券売却益益金不算入額	7,217	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	8,763	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	231,144	"	244,602	"

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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33.06%から、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30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については30.62%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15,263千円、その他有価証券評価差額金が27千円、それぞれ減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が15,236千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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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）	3,979,867千円

（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

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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

(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）

当事業年度（平成28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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	4,412,908円85銭	5,848,968円06銭
1株当たり当期純利益金額	1,000,232円56銭	1,447,521円33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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
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31期中間会計期間末

(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	18,232,975
未収委託者報酬	5,229,663
繰延税金資産	79,566

その他流動資産		121,642
流動資産合計		23,663,848
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	51,958
器具備品	1	91,200
その他有形固定資産	1	3,289
有形固定資産合計		146,448
無形固定資産		213,226
投資その他の資産		
投資有価証券		64,884
長期貸付金		21,338
会員権		25,000
その他の投資		7,090
繰延税金資産		130,488
貸倒引当金		21,338
投資その他の資産合計		227,463
固定資産合計		587,137
資産合計		24,250,986
負債の部		
流動負債		
未払金		2,832,550
未払費用		127,589
未払法人税等		973,190
賞与引当金		98,952
その他流動負債	2	123,541
流動負債合計		4,155,824
固定負債		
退職給付引当金		412,240
資産除去債務		13,036
その他固定負債		2,561
固定負債合計		427,838
負債合計		4,583,662

(単位：千円)

第31期中間会計期間末
(平成28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		71,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000

繰越利益剰余金	16,849,604
利益剰余金合計	19,021,104
株主資本合計	19,671,104
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3,780
評価・換算差額等合計	3,780
純資産合計	19,667,324
負債・純資産合計	24,250,986

中間損益計算書

(単位：千円)

		第31期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		15,203,419
営業収益合計		15,203,419
営業費用		10,414,275
一般管理費	1	1,675,104
営業利益		3,114,038
営業外収益	2	6,265
営業外費用		4,736
経常利益		3,115,567
税引前中間純利益		3,115,567
法人税、住民税及び事業税		926,810
法人税等調整額		35,707
法人税等合計		962,518
中間純利益		2,153,049

中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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	
	利益剰余金	
	その他利益剰余金	

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
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			2,153,049	2,153,049	2,153,049
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	-	2,120,049	2,123,049	2,123,049
当中間期末残高	71,500	2,100,000	16,849,604	19,021,104	19,671,104

	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	1,151	1,151	17,546,904
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			2,153,049
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	2,629	2,629	2,629
当中間期変動額合計	2,629	2,629	2,120,419
当中間期末残高	3,780	3,780	19,667,324

重要な会計方針

第31期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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。 (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。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法によっております。 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>

(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

第31期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30日)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ14千円増加しております。

追加情報

第31期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30日)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第31期中間会計期間末
(平成28年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額

建 物	58,267千円
器具備品	281,219千円
その他有形固定資産	1,300千円
計	340,787千円

- 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31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	22,496千円
無形固定資産	41,925千円
2 営業外収益の主要項目	
受取利息	3,038千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28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31期中間会計期間末（平成28年9月30日）

平成28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	18,232,975	18,232,975	-
(2)未収委託者報酬	5,229,663	5,229,663	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	64,881	64,881	-
(4)未払金	(2,832,550)	(2,832,550)	-
(5)未払法人税等	(973,190)	(973,190)	-

(*)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 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第31期中間会計期間末（平成28年9月30日）

その他有価証券

（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	7,754	7,496	258
小計	7,754	7,496	258
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	57,127	62,834	5,707
小計	57,127	62,834	5,707
合計	64,881	70,330	5,449

(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。

(デリバティブ取引関係)

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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）	1,855,519千円

（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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）	
1株当たり純資産額	6,555,774円71銭
1株当たり中間純利益	717,683円22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31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
中間純利益	2,153,049千円
普通株式に係る中間純利益	2,153,049千円
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

委託会社は、平成28年6月30日に社外取締役との責任限定契約に係る規定を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成29年 4月11日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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28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28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28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ロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
- ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
- 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
- ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
- ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。
- また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成28年 6 月 3 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 芳樹指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

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28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28年9月9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7月11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28年7月11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28年12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 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28年4月1日から平成29年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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. XBR 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29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28年7月12日から平成29年1月11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な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29年1月11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28年7月12日から平成29年1月11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. 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。