

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年6月29日
【発行者名】	ちばぎんアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 吉野 裕
【本店の所在の場所】	東京都墨田区江東橋二丁目13番7号
【事務連絡者氏名】	伊勢谷 知也
【電話番号】	03-5638-1450
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	むさしのコア投資ファンド（安定型） むさしのコア投資ファンド（成長型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	当初申込額  むさしのコア投資ファンド（安定型） 上限300億円 むさしのコア投資ファンド（成長型） 上限300億円 継続申込額  むさしのコア投資ファンド（安定型） 上限10兆円 むさしのコア投資ファンド（成長型） 上限10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1. 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したこと等に伴い、平成28年8月30日に提出した有価証券届出書(平成29年4月12日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。以下「原届出書」といいます。)の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

## 2. 【訂正の内容】

### 第二部【ファンド情報】

#### 第1【ファンドの状況】

##### 1【ファンドの性格】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「1 ファンドの性格」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

(注)下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

##### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(前略)

委託会社の概況(平成29年3月31日現在)

(後略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況(平成29年4月28日現在)

(後略)

## 2【投資方針】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

## (2)【投資対象】

<訂正前>

（前略）

（参考）投資対象ファンドの概要

投資対象ファンドとして予定しているファンドの概要は以下のとおりです。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3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。

（中略）

## 4. 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）

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、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	主としてわが国の公社債に投資する国内債券インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。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、債券の実質組入総額と債券先物取引等の買建玉の実質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。資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>NOMURA-BPI 総合</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
<p>申込手数料</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>換金（解約）手数料</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）</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27年5月20日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として、平成27年5月20日から平成37年5月29日</p>
<p>関係法人</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

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

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

5. FOFs用日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてわが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年2月14日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>
------	---

## 6. FOFs用世界物価連動債ファンドS（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債 マザーファンド 為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を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・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）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ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>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>



主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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>
ベンチマーク	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）
決算日	年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年3月31日
信託期間	原則として、平成29年3月31日から平成39年1月18日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

「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。

#### 7. Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class

運用会社	Nuveen Asset Management ,LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米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>
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>
決算日	年1回：12月31日
収益の分配	毎月
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.44%（税抜 年0.44%）

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"><li>・ 投資顧問会社 Nuveen Asset Management ,LLC</li><li>・ 受託会社 G.A.S. (Cayman) Limited</li><li>・ 管理事務代行会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li><li>・ 名義書換事務受託会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li><li>・ 保管受託銀行 Sumitomo Mitsui Trust (UK) Limited</li></ul>

## 8. FOFs用外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	外国株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じてMSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年5月29日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

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

#### 9. FOFs用外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)

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、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)( )と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	外国債券インデックス マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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>実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行いません。</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、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>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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>
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年5月29日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

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



## 10. FOFs用新興国株式セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資する新興国株式セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、金融商品取引所等に上場されている新興国の株式に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、個別銘柄の収益性、収益の安定性、財務の健全性等を勘案し、各銘柄への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となる場合があります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）



収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年9月17日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>

## 11. FOFs用新興国債券セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として新興国の現地通貨建債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する新興国債券セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、新興国の現地通貨建債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、債券の時価総額や流動性等を勘案し、各国への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の現地通貨建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の現地通貨建債券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年9月17日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>
------	---

## 12. 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）

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

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年9月17日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

### 13. 大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	大和住銀投信投資顧問株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みます。）への実質的な投資を行います。
主要投資対象	マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。</p> <p>中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。</p> <p>世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.7452%以内（税抜：0.69%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月12日
信託期間	原則として無期限

関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・投資顧問会社 マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</li><li>・受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>
------	---



## 14. FOFs用J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、東証REIT 指数（配当込み）（ ）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	主としてわが国の取引所に上場している不動産投資信託証券（以下「上場不動産投資信託証券」といいます。）に投資するJ-REITインデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、東証REIT 指数（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>マザーファンド受益証券への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>東証REIT 指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の実質組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の実質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>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場不動産投資信託証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の上場不動産投資信託証券への実質投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT 指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT 指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>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>

ベンチマーク	東証REIT 指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年11月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

東証は、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

## 15. FOFs用グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	主として日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券（総称して以下「上場等不動産投資信託証券」といいます。）に投資するグローバルREIT インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。 マザーファンド受益証券への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。 実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券（上場等不動産投資信託証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の上場等不動産投資信託証券への実質投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 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。 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。
ベンチマーク	S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜 年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年11月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>

「S&P 先進国REIT 指数(除く日本、配当込み)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。

S&P 先進国REIT 指数(以下「当インデックス」)はS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に付与されています。

Standard & Poor's<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P 先進国REIT 指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P 先進国REIT 指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indices またはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P 先進国REIT 指数は三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 先進国REIT 指数の決定、構成または計算において三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P 先進国REIT 指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indices は、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indices は、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indices は、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indices は、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indices のライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

#### 16. FOFs用MLP インデックスファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、別に定めるMLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	インデックス マザーファンドMLP受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券
投資態度	<p>主として、インデックス マザーファンドMLP受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券に投資を行ない、別に定めるMLP市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。運用にあたって、対象指数に採用されていないMLP等についても、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は投資を行ないます。また、対象指数に採用されているMLP等の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合があります。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>&lt;別に定めるMLP市場の動きをとらえる指数&gt; S&amp;P MLP 指数（円換算ベース）</p>

主な投資制限	株式：制限なし 投資信託証券：（マザーファンドおよび上場投資信託証券を除いて）5%以下 外貨建資産：制限なし デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	S&P MLP 指数（円換算ベース）
決算日	年1回：11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定する。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともある。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行なう。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1512%（税抜 年0.14%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	平成26年10月8日から平成36年11月20日
関係法人	・受託会社 三井住友信託銀行株式会社

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

#### 17. HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス

運用会社	Credit Suisse Asset Management, LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米ドル建の貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）に投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。
投資態度	主として米ドル建のバンクローンに投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。 ポートフォリオの構築は、個別銘柄の信用力、割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。 米ドル建以外の資産に投資した場合、当該資産については原則として対米ドルでの為替予約取引等を行いません。 米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。

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





## 18. FOFs用グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資するグローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券および米ドル建て債券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、もしくは米ドル建て債券へ直接投資することで、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、マザーファンド受益証券及び米ドル建て債券の双方に投資することがあります。 米ドル建て債券への実質投資割合は、原則として高位とすることを基本とします。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 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。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年5月26日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）および「ブルームバーグ（Bloomberg（R））」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）は、ブルームバーグとUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBS のいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

## 19. TCA ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

信託期間	原則として無期限
関係法人	・ 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

## 20. FOFs用 FRMシグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として積極的な運用を行います。
主要投資対象	FRM シグマ リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託証券「FRM Sigma MA Fund Limited」（以下「FRM シグマ ファンド」といいます）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM シグマ ファンドは、主としてシステム運用戦略に基づいて、株式、債券、金利、商品、為替等各種資産の取引（関連デリバティブ取引を含みます。）を行う複数のファンドに投資することで、テールリスク・ヘッジを行いつつ、中長期における絶対収益の獲得を目指します。なお、システム運用戦略以外のファンドに投資することもあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</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>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年11月25日
関係法人	・受託会社 三井住友信託銀行株式会社



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

運用会社	BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ファミリーファンド方式により、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として、ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 主として、海外の上場先物、為替取引等を投資対象とします。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。 当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、その主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI 総合指数（HFRI Weighted Composite Index）（ ）を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 マザーファンドの組入れ比率は高位に保つことを原則とします。 当ファンドは、原則として対円で為替ヘッジを行います。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 <マザーファンドの投資態度> 主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 当ファンドの運用に関しては三井住友信託銀行株式会社より投資助言を受けます。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時（原則として毎年8月15日）に分配対象収益の中から、収益分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。ただし、信託財産の状況によっては、分配を行わないことがあります。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月8日
信託期間	原則として平成24年8月8日から平成34年6月27日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>
------	--

「HFRI 総合指数<sup>(R)</sup> (HFRI Weighted Composite Index<sup>(R)</sup>)」(以下「HFR 指数」)は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク (HFR) の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)」に関する使用のみ、BNP パリバ インベストメント・パートナーズ株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR 及びHFR 指数 (当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている) は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFR は、当該投資信託を発起、支持、販売又は推奨していません。

HFR は、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR 指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日における当該投資信託の運用成績がHFR 指数の運用成績あるいはHFR 指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFR は当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR 指数の過誤について通知する義務を負いません。HFR は、HFR 指数の計算に使用される方法を含むHFR 指数をいつでも修正、変更し、HFR 指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR 指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。

HFRは、当該投資信託及び当該投資信託の投資家に対して、HFR 指数の過誤を含むいかなる種類、性質の損害も賠償する責任を負いません。

HFR 指数に関して、HFR は、全ての明示的あるいは暗示的な保証 (特定の目的に係る商品性又は適合性、権利及び非侵害性の保証を含むがこれに限らない) を明示的に否認します。

22. Global Absolute Return Strategies Fund- Class D<sup>A,H,JPY</sup>

運用会社	Standard Life Investments Limited
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等に投資します。
投資態度	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等の多様な資産に対して、様々な投資手法を活用した投資を行うことで、リスクの低減を図りつつ、日本円短期金利（円LIBOR6ヶ月物）を上回る投資成果を目指します。 組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	日本円短期金利（円LIBOR6ヶ月物）
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	年率0.85% この他、投資信託財産に関する租税や、投資信託の運営・運用等に要する諸費用が発生します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成23年6月14日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 管理会社 Standard Life Investments (Mutual Funds) Limited</li> <li>・ 副投資顧問会社 Standard Life Investments (USA) Limited</li> <li>・ 管理事務代行会社 / 保管受託銀行 The Bank of New York Mellon (Luxembourg) S.A.</li> </ul>

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

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	FRM ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託証券「FRM Diversified MA Fund Limited」（以下「FRM ダイバーシファイド ファンド」（ ）といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM ダイバーシファイド ファンドは、様々なヘッジファンドに分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</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>
ベンチマーク	該当事項はありません。

決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年10月10日
関係法人	・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

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

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

## 25. FOFs用 K I M マルチストラテジー リンクファンドS (適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	K I M マルチストラテジー リンク マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券(以下「円建債券」といいます)に投資し、Kairos Investment Management Ltd. が運用する外国投資信託証券「SuMi-KAIROS MULTI-STRATEGY FUND」(以下「スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンド」といいます。)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドは、様々なヘッジファンド等に分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません
決算日	<p>原則、毎年10月10日</p> <p>ただし、該当日が休業日の場合は翌営業日。</p>
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>





## 26. FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS (適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券(以下「円建債券」といいます。)に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet Total Return - Diversified Alpha」(以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替、等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません
決算日	毎年10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

## 27. FOFs用 MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHLファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	原則、毎年10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

## 28. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。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。実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引に係る実質投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません
決算日	原則、毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.8640%（税抜 年0.80%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年4月2日

信託期間	平成25年4月2日から平成38年3月26日
関係法人	・ 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



## 29. Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A

運用会社	Numeric Investors LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。
投資態度	主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。 企業の財務情報、市場価格、その他のデータを収集し、モニタリングするシステム運用手法を用いてロング・ショート（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築します。
主な投資制限	投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。 受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月の最終ファンド営業日
収益の分配	収益の分配は行いません。
運用報酬	年率1.5%（税抜1.5%） 上記の他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年3月10日
信託期間	当該ファンドでは信託期間は定められておりません。
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資顧問会社 Numeric Investors LLC</li> <li>・ 管理事務代行会社 State Street Cayman Trust Company, Ltd</li> <li>・ 保管受託銀行 STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY</li> </ul>

&lt;訂正後&gt;

(前略)

## (参考)投資対象ファンドの概要

投資対象ファンドとして予定しているファンドの概要は以下のとおりです。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6月29日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

(中略)

## 4. FOFs用日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてわが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年2月14日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>
------	---

## 5. FOFs用世界物価連動債ファンドS（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債 マザーファンド 為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を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・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）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ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>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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>
ベンチマーク	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）
決算日	年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年3月31日
信託期間	原則として、平成29年3月31日から平成39年1月18日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

「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。

#### 6. Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class

運用会社	Nuveen Asset Management ,LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米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>
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>
決算日	年1回：12月31日
収益の分配	毎月
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.44%（税抜 年0.44%）

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"><li>・ 投資顧問会社 Nuveen Asset Management ,LLC</li><li>・ 受託会社 G.A.S. (Cayman) Limited</li><li>・ 管理事務代行会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li><li>・ 名義書換事務受託会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li><li>・ 保管受託銀行 Sumitomo Mitsui Trust (UK) Limited</li></ul>



## 7. FOFs用外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	外国株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じてMSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 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。 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。
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年5月29日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

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

#### 8. FOFs用外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)

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、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)( )と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	外国債券インデックス マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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>実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行いません。</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、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>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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>
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年5月29日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

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



## 9. FOFs用新興国株式セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資する新興国株式セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、金融商品取引所等に上場されている新興国の株式に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、個別銘柄の収益性、収益の安定性、財務の健全性等を勘案し、各銘柄への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の株式、株価指数先物取引及び上場投資信託証券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年9月17日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>

## 10. FOFs用新興国債券セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として新興国の現地通貨建債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する新興国債券セレクトマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、新興国の現地通貨建債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国を除外した上で、債券の時価総額や流動性等を勘案し、各国への実質投資割合を決定します。</p> <p>新興国の現地通貨建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>ただし、政治・経済・財政等の問題が大きいと判断される国が多数となり、投資対象国が限定される場合には、新興国の現地通貨建債券への実質投資割合が高位とならず、この場合、わが国の円建短期公社債等に投資を行い、この実質投資割合が高位となることがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年9月17日



関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>
------	---

## 11. 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）

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

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年9月17日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

## 12. 大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	大和住銀投信投資顧問株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みます。）への実質的な投資を行います。
主要投資対象	マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。</p> <p>中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。</p> <p>世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.7452%以内（税抜：0.69%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月12日
信託期間	原則として無期限

関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・投資顧問会社 マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</li><li>・受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>
------	---

## 13. FOFs用J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、東証REIT 指数（配当込み）（ ）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	主としてわが国の取引所に上場している不動産投資信託証券（以下「上場不動産投資信託証券」といいます。）に投資するJ-REITインデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、東証REIT 指数（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>マザーファンド受益証券への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>東証REIT 指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の実質組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の実質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>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場不動産投資信託証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の上場不動産投資信託証券への実質投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT 指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT 指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>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>

ベンチマーク	東証REIT 指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年11月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

東証は、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

## 14. FOFs用グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	主として日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券（総称して以下「上場等不動産投資信託証券」といいます。）に投資するグローバルREIT インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。 マザーファンド受益証券への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。 実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券（上場等不動産投資信託証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の上場等不動産投資信託証券への実質投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 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。 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。
ベンチマーク	S&P 先進国REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）



収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年11月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li><li>・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li></ul>

「S&P 先進国REIT 指数(除く日本、配当込み)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。

S&P 先進国REIT 指数(以下「当インデックス」)はS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に付与されています。

Standard & Poor's<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P 先進国REIT 指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P 先進国REIT 指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indices またはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P 先進国REIT 指数は三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 先進国REIT 指数の決定、構成または計算において三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P 先進国REIT 指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indices は、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indices は、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indices は、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indices は、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indices のライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

#### 15. FOFs用MLP インデックスファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、別に定めるMLP（マスター・リミテッド・パートナーシップ）市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	インデックス マザーファンドMLP受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券
投資態度	<p>主として、インデックス マザーファンドMLP受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているMLPやMLPに関連する証券に投資を行ない、別に定めるMLP市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。運用にあたって、対象指数に採用されていないMLP等についても、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は投資を行ないます。また、対象指数に採用されているMLP等の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合があります。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>&lt;別に定めるMLP市場の動きをとらえる指数&gt; S&amp;P MLP 指数（円換算ベース）</p>

主な投資制限	株式：制限なし 投資信託証券：（マザーファンドおよび上場投資信託証券を除いて）5%以下 外貨建資産：制限なし デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	S&P MLP 指数（円換算ベース）
決算日	年1回：11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定する。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともある。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行なう。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1512%（税抜 年0.14%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成26年10月8日
信託期間	平成26年10月8日から平成36年11月20日
関係法人	・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

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

#### 16. HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス

運用会社	Credit Suisse Asset Management, LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米ドル建の貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）に投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。
投資態度	主として米ドル建のバンクローンに投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。 ポートフォリオの構築は、個別銘柄の信用力、割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。 米ドル建以外の資産に投資した場合、当該資産については原則として対米ドルでの為替予約取引等を行いません。 米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。

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



## 17. FOFs用グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資するグローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券および米ドル建て債券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、もしくは米ドル建て債券へ直接投資することで、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、マザーファンド受益証券及び米ドル建て債券の双方に投資することがあります。 米ドル建て債券への実質投資割合は、原則として高位とすることを基本とします。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 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。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年5月26日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）および「ブルームバーグ（Bloomberg（R））」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）は、ブルームバーグとUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBS のいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。



## 18. TCA ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

信託期間	原則として無期限
関係法人	・ 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

## 19. FOFs用 FRMシグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として積極的な運用を行います。
主要投資対象	FRM シグマ リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託証券「FRM Sigma MA Fund Limited」（以下「FRM シグマ ファンド」といいます）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM シグマ ファンドは、主としてシステム運用戦略に基づいて、株式、債券、金利、商品、為替等各種資産の取引（関連デリバティブ取引を含みます。）を行う複数のファンドに投資することで、テールリスク・ヘッジを行いつつ、中長期における絶対収益の獲得を目指します。なお、システム運用戦略以外のファンドに投資することもあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</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>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月25日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金(解約)手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%(税抜年0.18%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年11月25日
関係法人	・受託会社 三井住友信託銀行株式会社

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

運用会社	BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ファミリーファンド方式により、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として、ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 主として、海外の上場先物、為替取引等を投資対象とします。
投資態度	マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。 当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、その主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI 総合指数（HFRI Weighted Composite Index）（ ）を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 マザーファンドの組入れ比率は高位に保つことを原則とします。 当ファンドは、原則として対円で為替ヘッジを行います。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 <マザーファンドの投資態度> 主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 当ファンドの運用に関しては三井住友信託銀行株式会社より投資助言を受けます。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時（原則として毎年8月15日）に分配対象収益の中から、収益分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。ただし、信託財産の状況によっては、分配を行わないことがあります。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成24年8月8日
信託期間	原則として平成24年8月8日から平成34年6月27日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・助言会社 マザーファンドに対して三井住友信託銀行株式会社が投資助言を行います。</li> <li>・受託会社 三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>
------	--

「HFRI 総合指数<sup>(R)</sup> (HFRI Weighted Composite Index<sup>(R)</sup>)」(以下「HFR 指数」)は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク(HFR)の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)」に関する使用のみ、BNP パリバ インベストメント・パートナーズ株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR 及びHFR 指数(当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている)は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFR は、当該投資信託を発起、支持、販売又は推奨していません。

HFR は、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR 指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日における当該投資信託の運用成績がHFR 指数の運用成績あるいはHFR 指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFR は当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR 指数の過誤について通知する義務を負いません。HFR は、HFR 指数の計算に使用される方法を含むHFR 指数をいつでも修正、変更し、HFR 指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR 指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。

HFRは、当該投資信託及び当該投資信託の投資家に対して、HFR 指数の過誤を含むいかなる種類、性質の損害も賠償する責任を負いません。

HFR 指数に関して、HFR は、全ての明示的あるいは暗示的な保証(特定の目的に係る商品性又は適合性、権利及び非侵害性の保証を含むがこれに限らない)を明示的に否認します。

21. Global Absolute Return Strategies Fund- Class D<sup>A,H,JPY</sup>

運用会社	Standard Life Investments Limited
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等に投資します。
投資態度	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等の多様な資産に対して、様々な投資手法を活用した投資を行うことで、リスクの低減を図りつつ、日本円短期金利（円LIBOR6ヶ月物）を上回る投資成果を目指します。 組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	日本円短期金利（円LIBOR6ヶ月物）
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	年率0.85% この他、投資信託財産に関する租税や、投資信託の運営・運用等に要する諸費用が発生します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成23年6月14日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 管理会社 Standard Life Investments (Mutual Funds) Limited</li> <li>・ 副投資顧問会社 Standard Life Investments (USA) Limited</li> <li>・ 管理事務代行会社 / 保管受託銀行 The Bank of New York Mellon (Luxembourg) S.A.</li> </ul>



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

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	FRM ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、FRM Investment Management Limitedが実質的に運用する外国投資信託証券「FRM Diversified MA Fund Limited」（以下「FRM ダイバーシファイド ファンド」（ ）といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>FRM ダイバーシファイド ファンドは、様々なヘッジファンドに分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</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>
ベンチマーク	該当事項はありません。

決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成27年5月20日
信託期間	原則として、平成27年5月20日から平成37年10月10日
関係法人	・ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

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

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

## 24. FOFs用 K I M マルチストラテジー リンクファンドS (適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	K I M マルチストラテジー リンク マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券(以下「円建債券」といいます)に投資し、Kairos Investment Management Ltd. が運用する外国投資信託証券「SuMi-KAIROS MULTI-STRATEGY FUND」(以下「スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンド」といいます。)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドは、様々なヘッジファンド等に分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません
決算日	<p>原則、毎年10月10日</p> <p>ただし、該当日が休業日の場合は翌営業日。</p>
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>



## 25. FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券(以下「円建債券」といいます。)に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet Total Return - Diversified Alpha」(以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替、等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません
決算日	毎年10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>



## 26. FOFs用 MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHLファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	原則、毎年10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.1944%（税抜 年0.18%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成28年1月20日
信託期間	原則として、平成28年1月20日から平成37年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受託会社</li> <li>三井住友信託銀行株式会社</li> </ul>

## 27. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。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。実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引に係る実質投資額は、原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません
決算日	原則、毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
申込手数料	該当事項はありません。
換金（解約）手数料	該当事項はありません。
信託報酬	純資産総額に対し、年0.8640%（税抜 年0.80%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年4月2日

信託期間	平成25年4月2日から平成38年3月26日
関係法人	・ 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

## 28. Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A

運用会社	Numeric Investors LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。
投資態度	主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。 企業の財務情報、市場価格、その他のデータを収集し、モニタリングするシステム運用手法を用いてロング・ショート（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築します。
主な投資制限	投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。 受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月の最終ファンド営業日
収益の分配	収益の分配は行いません。
運用報酬	年率1.5%（税抜1.5%） 上記の他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年3月10日
信託期間	当該ファンドでは信託期間は定められておりません。
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資顧問会社 Numeric Investors LLC</li> <li>・ 管理事務代行会社 State Street Cayman Trust Company, Ltd</li> <li>・ 保管受託銀行 STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY</li> </ul>

### 3【投資リスク】

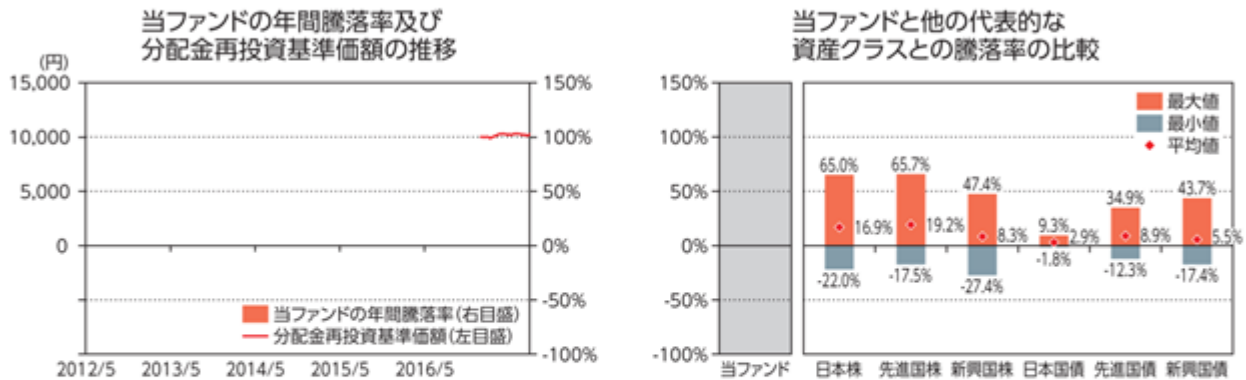
原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「3 投資リスク」「参考情報」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

（注）下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

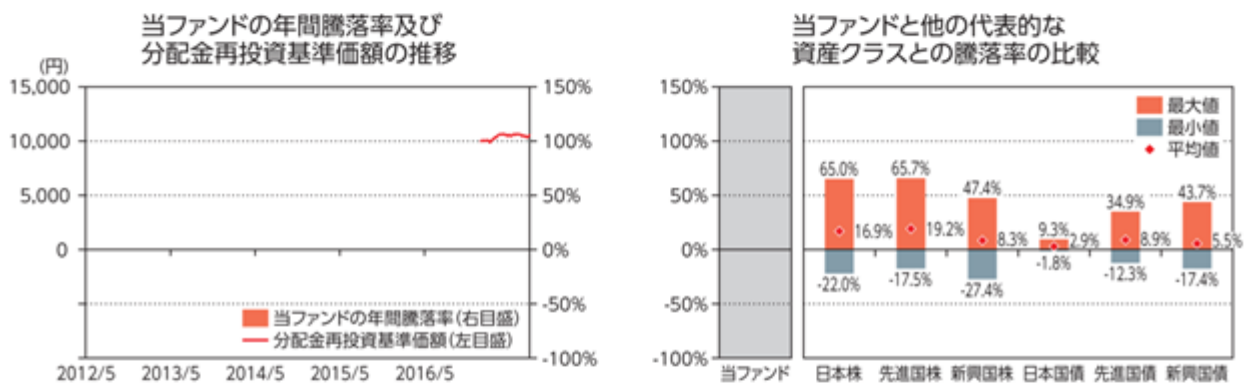
<更新・訂正後>

## 〔参考情報〕

## むさしのコア投資ファンド(安定型)



## むさしのコア投資ファンド(成長型)



\*当ファンドは2017年4月28日現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

\*2012年5月～2017年4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。

\*当ファンドは2017年4月28日現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

## 各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)  
 先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)  
 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)  
 日本国債・・・NOMURA-BPI国債  
 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)  
 新興国債・・・JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)  
 (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。

## 各資産クラスの騰落率について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPIに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。



## 4【手数料等及び税金】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「4 手数料等及び税金」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

## (3)【信託報酬等】

<訂正前>

（前略）

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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
F0Fs用JPX日経インデックス400ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用日本株配当ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.3672%（税抜 0.34%）
F0Fs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）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用世界物価連動債ファンドS（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	年率 0.44%
F0Fs用外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用新興国株式セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用新興国債券セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs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）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)	年率 0.7452%以内 (税抜：0.69%以内)

F0Fs用J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用MLP インデックスファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.1512%（税抜 0.14%）
HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	年率 0.65%
F0Fs用グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
TCA ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.864%（税抜 0.8%）
F0Fs用 FRMシグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.864%（税抜 0.8%）
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D <sup>A,H,JPY</sup>	年率 0.85%
F0Fs用 FRM ダイバーシファイド・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%
F0Fs用 K I M マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 年0.18%）
F0Fs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 年0.18%）
F0Fs用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 年0.18%）
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.864%（税抜 年0.8%）
Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A	年率 1.50%

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

実質的な信託報酬率：年率1.55333%～1.86727%程度（税抜年率1.43827%～1.74472%程度）

<訂正後>

（前略）

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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
F0Fs用JPX日経インデックス400ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用日本株配当ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.3672%（税抜 0.34%）
F0Fs用日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用世界物価連動債ファンドS（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	年率 0.44%
F0Fs用外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用新興国株式セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用新興国債券セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs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）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)	年率 0.7452%以内 （税抜：0.69%以内）
F0Fs用J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
F0Fs用MLP インデックスファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.1512%（税抜 0.14%）
HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	年率 0.65%
F0Fs用グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
TCA ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.864%（税抜 0.8%）
F0Fs用 FRMシグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.864%（税抜 0.8%）
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D <sup>A,H,JPY</sup>	年率 0.85%
F0Fs用 FRM ダイバーシファイド・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 0.18%）

BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%
F0Fs用 K I M マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 年0.18%）
F0Fs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 年0.18%）
F0Fs用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.1944%（税抜 年0.18%）
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.864%（税抜 年0.8%）
Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A	年率 1.50%

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

実質的な信託報酬率：年率1.55333%～1.86727%程度（税抜年率1.43827%～1.74472%程度）

## ( 5 ) 【課税上の取扱い】

## &lt; 訂正前 &gt;

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

( 中略 )

上記は、平成29年1月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

( 後略 )

## &lt; 訂正後 &gt;

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

( 中略 )

上記は、平成29年4月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

( 後略 )

## 5 【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

## &lt; 更新・訂正後 &gt;

以下の記載は平成29年4月28日現在の状況について記載してあります。

## 【むさしのコア投資ファンド（安定型）】

## ( 1 ) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	1,094,223,467	76.38
	ケイマン	143,861,380	10.04
	小計	1,238,084,847	86.42
投資証券	ルクセンブルク	144,353,902	10.07
	ケイマン	29,028,287	2.02
	小計	173,382,189	12.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,134,743	1.48
合計(純資産総額)		1,432,601,779	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、当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

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資信託 受益証券	FOFs用世界ハイインカム入替戦略 ファンドS(為替ヘッジあり)(適格 機関投資家専用)	145,141,455	1.0621	154,154,944	1.0311	149,655,354	10.45
2	日本	投資信託 受益証券	FOFs用外国株式インデックス・ ファンドS(適格機関投資家専用)	123,515,680	0.8688	107,310,692	1.0061	124,269,125	8.67
3	日本	投資信託 受益証券	ヘッジファンド・リターン・ター ゲットファンド・為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	80,621,674	1.0419	83,999,890	1.0777	86,885,978	6.06
4	ルクセン ブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund - Class D <sup>A, H, JPY</sup>	46,599.552	1,823.16	84,958,527	1,862	86,768,365	6.06
5	日本	投資信託 受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイド・リン ク・ファンドS(適格機関投資 家専用)	91,388,541	0.9413	86,024,565	0.942	86,088,005	6.01
6	日本	投資信託 受益証券	FOFs用外国債券インデックス・ ファンドS(適格機関投資家専用)	81,494,255	0.9021	73,523,334	0.9233	75,243,645	5.25
7	ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	67,312.3554	1,094.99	73,706,505	1,113.08	74,924,063	5.23
8	ケイマン	投資信託 受益証券	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	7,142.7526	9,709.14	69,350,000	9,651.36	68,937,317	4.81
9	日本	投資信託 受益証券	FOFs用JPIX日経インデックス400フ ァンドS(適格機関投資家専用)	68,622,542	0.8541	58,614,837	0.96	65,877,640	4.60
10	日本	投資信託 受益証券	FOFs用ビクテ マルチストラテジー リンクファンドS(適格機関投資家 専用)	57,073,243	1.0063	57,438,080	1.0118	57,746,707	4.03
11	日本	投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専 用)	62,390,198	0.9466	59,058,985	0.9248	57,698,455	4.03
12	ルクセン ブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - ク ラスS-JPY	5,875.218	9,597.9	56,389,755	9,801.43	57,585,537	4.02
13	日本	投資信託 受益証券	FOFs用J-REITインデックス・フ ァンドS(適格機関投資家専用)	41,808,860	1.0203	42,660,689	1.0018	41,884,115	2.92
14	日本	投資信託 受益証券	FOFs用日本物価連動国債ファンドS (適格機関投資家専用)	38,851,316	0.9712	37,735,631	0.9698	37,678,006	2.63
15	日本	投資信託 受益証券	FOFs用世界物価連動債ファンドS (為替ヘッジあり)(適格機関投資家 専用)	36,809,851	1.016	37,400,000	1.0056	37,015,986	2.58
16	日本	投資信託 受益証券	大和住銀/ウエリントン・ワール ド・ボンド(適格機関投資家専 用)	36,540,968	0.8932	32,640,991	0.9358	34,195,037	2.39
17	日本	投資信託 受益証券	FOFs用国内株式エンハンスト運用戦 略ファンド(適格機関投資家専用)	28,521,724	1.0116	28,854,317	1.1539	32,911,217	2.30
18	ケイマン	投資証券	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A	2,944	9,779.21	28,790,000	9,860.15	29,028,287	2.03
19	日本	投資信託 受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド (適格機関投資家専用)	29,929,666	0.9608	28,757,336	0.966	28,912,057	2.02
20	日本	投資信託 受益証券	FOFs用KIM マルチストラテジー リンクファンドS(適格機関投資家専 用)	27,381,952	0.9915	27,151,095	1.0494	28,734,620	2.01
21	日本	投資信託 受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンドS(適格機関投資家 専用)	34,400,690	0.8639	29,721,376	0.835	28,724,576	2.01

22	日本	投資信託 受益証券	FOFs用FRM シグマ・リンク・ファン ドS（適格機関投資家専用）	34,207,375	0.8875	30,362,261	0.8348	28,556,316	1.99
23	日本	投資信託 受益証券	FOFs用グローバルREITインデックス ・ファンドS（適格機関投資家専 用）	28,470,723	0.915	26,053,226	0.9957	28,348,298	1.98
24	日本	投資信託 受益証券	FOFs用新興国株式セレクト・ファン ドS（適格機関投資家専用）	15,572,218	0.7782	12,119,835	0.8884	13,834,358	0.97
25	日本	投資信託 受益証券	FOFs用MLPインデックスファンド （適格機関投資家専用）	19,736,325	0.6138	12,114,626	0.7005	13,825,295	0.97
26	日本	投資信託 受益証券	FOFs用グローバル・コモディティ （米ドル建て）・ファンドS（適格 機関投資家専用）	18,640,218	0.7053	13,147,177	0.7371	13,739,704	0.96
27	日本	投資信託 受益証券	FOFs用日本株配当ファンドS（適格 機関投資家専用）	11,146,489	0.8599	9,585,253	0.9827	10,953,654	0.76
28	日本	投資信託 受益証券	FOFs用新興国債券セレクト・ファン ドS（適格機関投資家専用）	6,690,286	0.7917	5,297,311	0.8577	5,738,258	0.40
29	日本	投資信託 受益証券	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）	5,462,871	1.0567	5,772,894	1.0447	5,707,061	0.40

(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、当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。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	86.42
投資証券	12.10
合計	98.52

(注)投資比率は、当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】

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2016年 9月末日	999,975,434		1.0000	
10月末日	1,175,963,906		1.0012	
11月末日	1,318,028,589		1.0092	
12月末日	1,450,621,408		1.0283	
2017年 1月末日	1,442,556,158		1.0274	
2月末日	1,453,584,303		1.0278	
3月末日	1,386,615,698		1.0223	
4月末日	1,432,601,779		1.0249	

## 【分配の推移】

該当事項はありません。

## 【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（％）
第1中間計算期間末	2016年 9月30日～2017年 3月29日	2.0

(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	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1中間計算期間末	2016年 9月30日～2017年 3月29日	1,577,655,514	222,997,586	1,354,657,928

(注1)第1中間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ございません。



## 【むさしのコア投資ファンド（成長型）】

## （１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	637,736,457	83.76
	ケイマン	34,905,287	4.58
	小計	672,641,744	88.35
投資証券	ルクセンブルク	57,227,810	7.51
	ケイマン	11,516,657	1.51
	小計	68,744,467	9.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,923,472	2.62
合計(純資産総額)		761,309,683	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、当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

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資信託 受益証券	FOFs用外国株式インデックス・ ファンドS（適格機関投資家専 用）	102,005,692	0.8764	89,406,876	1.0061	102,627,926	13.48
2	日本	投資信託 受益証券	FOFs用外国債券インデックス・ ファンドS（適格機関投資家専 用）	80,630,960	0.9048	72,958,198	0.9233	74,446,565	9.78
3	日本	投資信託 受益証券	FOFs用JPX日経インデックス400 ファンドS（適格機関投資家専 用）	66,732,043	0.8623	57,547,312	0.96	64,062,761	8.41
4	日本	投資信託 受益証券	FOFs用J-REITインデックス・ ファンドS（適格機関投資家専 用）	36,409,729	1.0225	37,232,209	1.0018	36,475,266	4.79
5	日本	投資信託 受益証券	FOFs用世界ハイインカム入替戦略 ファンドS(為替ヘッジあり)(適 格機関投資家専用)	35,180,065	1.0573	37,199,162	1.0311	36,274,165	4.76
6	ルクセン ブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund - Class D <sup>A, H,</sup> JPY	18,502.487	1,828.42	33,830,424	1,862	34,451,630	4.53
7	日本	投資信託 受益証券	ヘッジファンド・リターン・ター ゲットファンド・為替ヘッジあ り（適格機関投資家専用）	31,882,106	1.0457	33,341,932	1.0777	34,359,345	4.51
8	日本	投資信託 受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイド・ リンク・ファンドS（適格機関 投資家専用）	36,295,759	0.9412	34,164,362	0.942	34,190,604	4.49
9	日本	投資信託 受益証券	大和住銀/ウエリントン・ワール ド・ボンド（適格機関投資家 専用）	36,170,845	0.9009	32,588,165	0.9358	33,848,676	4.45
10	日本	投資信託 受益証券	FOFs用国内株式エンハンス運用 戦略ファンド（適格機関投資家専 用）	27,743,658	1.0203	28,309,033	1.1539	32,013,406	4.21
11	日本	投資信託 受益証券	FOFs用グローバルREITインデック ス・ファンドS（適格機関投資 家専用）	24,811,332	0.925	22,951,865	0.9957	24,704,643	3.25

12	日本	投資信託 受益証券	TCAファンド（適格機関投資家専用）	24,666,283	0.9419	23,234,765	0.9248	22,811,378	3.00
13	ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	2,323.761	9,630.28	22,378,483	9,801.43	22,776,180	2.99
14	日本	投資信託 受益証券	FOFs用ビクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	22,411,002	1.0068	22,564,290	1.0118	22,675,451	2.98
15	ケイマン	投資信託 受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	16,156.7187	1,097.78	17,736,582	1,113.08	17,983,726	2.36
16	ケイマン	投資信託 受益証券	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	1,753.2816	9,707.51	17,020,000	9,651.36	16,921,561	2.22
17	日本	投資信託 受益証券	FOFs用グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	19,512,761	0.7151	13,954,493	0.7371	14,382,856	1.89
18	日本	投資信託 受益証券	FOFs用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）	17,229,972	0.6288	10,835,108	0.7005	12,069,595	1.59
19	ケイマン	投資証券	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A	1,168	9,781.19	11,424,435	9,860.15	11,516,657	1.51
20	日本	投資信託 受益証券	FOFs用新興国株式セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）	12,859,630	0.7896	10,154,688	0.8884	11,424,495	1.50
21	日本	投資信託 受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	11,823,910	0.961	11,363,295	0.966	11,421,897	1.50
22	日本	投資信託 受益証券	FOFs用KIM マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	10,817,782	0.9994	10,811,978	1.0494	11,352,180	1.49
23	日本	投資信託 受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンドS（適格機関投資家専用）	13,591,139	0.8596	11,683,357	0.835	11,348,601	1.49
24	日本	投資信託 受益証券	FOFs用FRM シグマ・リンク・ファンドS（適格機関投資家専用）	13,526,992	0.8797	11,900,428	0.8348	11,292,332	1.48
25	日本	投資信託 受益証券	FOFs用日本株配当ファンドS（適格機関投資家専用）	10,852,427	0.8651	9,389,265	0.9827	10,664,680	1.40
26	日本	投資信託 受益証券	FOFs用日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）	9,342,940	0.9713	9,074,996	0.9698	9,060,783	1.19
27	日本	投資信託 受益証券	FOFs用世界物価連動債ファンドS（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	8,986,106	1.016	9,130,000	1.0056	9,036,428	1.19
28	日本	投資信託 受益証券	FOFs用新興国債券セレクト・ファンドS（適格機関投資家専用）	6,645,826	0.7998	5,315,443	0.8577	5,700,124	0.75
29	日本	投資信託 受益証券	FOFs用国内債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,428,449	1.0546	1,506,452	1.0447	1,492,300	0.20

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	88.35
投資証券	9.03
合計	97.38

(注)投資比率は、当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】

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2016年 9月末日	478,435,764		1.0000	
10月末日	629,681,367		1.0069	
11月末日	690,488,633		1.0278	
12月末日	656,800,144		1.0591	
2017年 1月末日	707,729,555		1.0598	
2月末日	740,922,188		1.0563	
3月末日	704,411,415		1.0507	
4月末日	761,309,683		1.0549	

## 【分配の推移】

該当事項はありません。

## 【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（％）
第1中間計算期間末	2016年 9月30日～2017年 3月29日	4.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1中間計算期間末	2016年 9月30日～2017年 3月29日	941,535,974	272,015,031	669,520,943

(注1)第1中間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ございません。

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

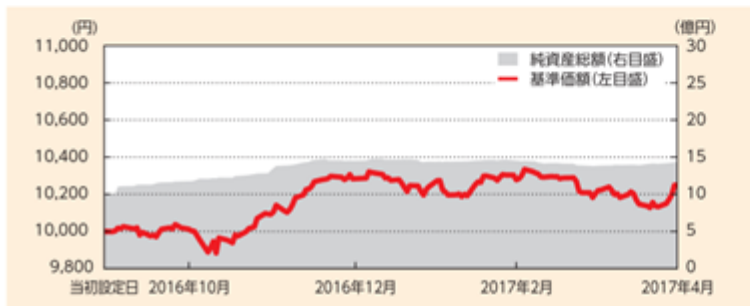
## 運用実績

設定日：2016年9月30日

作成基準日：2017年4月28日

### ■ むさしのコア投資ファンド(安定型)

#### ■ 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,249円
純資産総額	14.33億円

※上記グラフは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

初回決算が2017年7月10日のため、基準日現在分配実績はありません。

#### ■ 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
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)	10.4%
FOFs用外国株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	8.7%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	6.1%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D <sup>A</sup> H <sup>JPY</sup>	6.1%
FOFs用FRM ダイバーシファイド・リンク・ファンドS (適格機関投資家専用)	6.0%
FOFs用外国債券インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	5.3%
HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス	5.2%
Global Multi Strategy-U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	4.8%
FOFs用JPX日経インデックス400ファンドS (適格機関投資家専用)	4.6%
FOFs用ビクテ マルチストラテジー リンクファンドS (適格機関投資家専用)	4.0%

#### ■ 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2016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。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

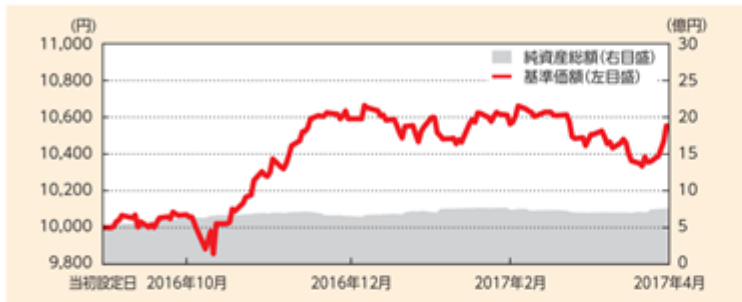
## 運用実績

設 定 日：2016年9月30日

作成基準日：2017年4月28日

### ■ むさしのコア投資ファンド(成長型)

#### ■ 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,549円
純資産総額	7.61億円

※上記グラフは設定日から作成基準日までを表示しております。

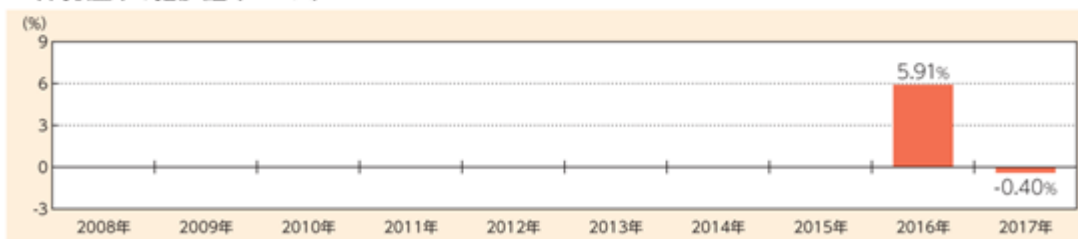
#### ■ 分配の推移

初回決算が2017年7月10日のため、基準日現在分配実績はありません。

#### ■ 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
FOFs用外国株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	13.5%
FOFs用外国債券インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	9.8%
FOFs用JPX日経インデックス400ファンドS (適格機関投資家専用)	8.4%
FOFs用J-REITインデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	4.8%
FOFs用世界ハ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)	4.8%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D <sup>A,H</sup> , JPY	4.5%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	4.5%
FOFs用FRM ダイバーシファイド・リンク・ファンドS (適格機関投資家専用)	4.5%
大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド (適格機関投資家専用)	4.4%
FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	4.2%

#### ■ 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2016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。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

むさしのコア投資ファンド（安定型）

むさしのコア投資ファンド（成長型）

(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1期中間計算期間（平成28年9月30日から平成29年3月29日）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。

## 1【財務諸表】

## 【中間財務諸表】

## 【むさしのコア投資ファンド（安定型）】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		第1期中間計算期間末 平成29年 3月29日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		28,814,646
投資信託受益証券		1,196,467,275
投資証券		168,122,768
未収入金		3,810,000
流動資産合計		1,397,214,689
資産合計		1,397,214,689
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		5,995,889
未払受託者報酬		359,247
未払委託者報酬		8,693,700
未払利息		77
その他未払費用		35,868
流動負債合計		15,084,781
負債合計		15,084,781
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1,354,657,928
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		27,471,980
元本等合計		1,382,129,908
純資産合計		1,382,129,908
負債純資産合計		1,397,214,689

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 平成28年 9月30日 至 平成29年 3月29日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	36,650,043
<b>営業収益合計</b>	<b>36,650,043</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	27,542
受託者報酬	359,247
委託者報酬	8,693,700
その他費用	35,868
<b>営業費用合計</b>	<b>9,116,357</b>
営業利益又は営業損失（ ）	27,533,686
経常利益又は経常損失（ ）	27,533,686
中間純利益又は中間純損失（ ）	27,533,686
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（ ）	5,470,467
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>6,049,646</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,049,646
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>640,885</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	640,885
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	27,471,980



## ( 3 ) 【中間注記表】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. 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	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は設定日(平成28年9月30日)から平成29年7月10日までとなっております。第1期中間計算期間は設定日(平成28年9月30日)から平成29年3月29日までとなっております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第1期中間計算期間末 平成29年 3月29日現在
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,354,657,928口
2. 中間計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	1.0203円 (10,203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

項目	第1期中間計算期間末 平成29年 3月29日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

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期中間計算期間
	自 平成28年 9月30日 至 平成29年 3月29日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	999,978,118円
期中追加設定元本額	577,677,396円
期中一部解約元本額	222,997,586円

## 【むさしのコア投資ファンド（成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第1期中間計算期間末 平成29年 3月29日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		22,152,727
投資信託受益証券		620,029,738
投資証券		64,111,475
未収入金		3,350,000
流動資産合計		709,643,940
資産合計		709,643,940
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		3,591,746
未払受託者報酬		181,372
未払委託者報酬		4,389,098
未払利息		59
その他未払費用		18,077
流動負債合計		8,180,352
負債合計		8,180,352
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		669,520,943
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		31,942,645
元本等合計		701,463,588
純資産合計		701,463,588
負債純資産合計		709,643,940

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 平成28年 9月30日 至 平成29年 3月29日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	37,361,213
<b>営業収益合計</b>	<b>37,361,213</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	18,924
受託者報酬	181,372
委託者報酬	4,389,098
その他費用	18,077
<b>営業費用合計</b>	<b>4,607,471</b>
営業利益又は営業損失（ ）	32,753,742
経常利益又は経常損失（ ）	32,753,742
中間純利益又は中間純損失（ ）	32,753,742
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（ ）	12,472,359
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>13,915,771</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,915,771
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>2,254,509</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,254,509
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	31,942,645

## ( 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	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. 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	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は設定日(平成28年9月30日)から平成29年7月10日までとなっており、第1期中間計算期間は設定日(平成28年9月30日)から平成29年3月29日までとなっております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第1期中間計算期間末 平成29年 3月29日現在
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	669,520,943口
2. 中間計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	1.0477円 (10,477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

項目	第1期中間計算期間末 平成29年 3月29日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

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期中間計算期間 自 平成28年 9月30日 至 平成29年 3月29日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	478,437,048円
期中追加設定元本額	463,098,926円
期中一部解約元本額	272,015,031円

## 2【ファンドの現況】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「2 ファンドの現況」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】(平成29年4月28日現在)

むさしのコア投資ファンド(安定型)

資産総額	1,434,291,978円
負債総額	1,690,199円
純資産総額( - )	1,432,601,779円
発行済口数	1,397,774,885口
1口当たり純資産額( / )	1.0249円
(1万口当たり純資産額)	(10,249円)

むさしのコア投資ファンド(成長型)

資産総額	763,656,348円
負債総額	2,346,665円
純資産総額( - )	761,309,683円
発行済口数	721,695,979口
1口当たり純資産額( / )	1.0549円
(1万口当たり純資産額)	(10,549円)

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「1 委託会社等の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

<訂正前>

##### (2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成29年4月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

##### (2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成29年6月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

平成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（マザーファンドは除きます。）は次のとおりです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>7</u>	<u>35,452</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>7</u>	<u>35,452</u>



&lt; 訂正後 &gt;

( 前略 )

平成29年4月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドは除きます。）は次のとおりです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	12	47,717
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	12	47,717

## 5【その他】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「5 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

## (2)訴訟事件その他の重要事項

平成29年4月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

<訂正後>

（前略）

## (2)訴訟事件その他の重要事項

平成29年6月29日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

## (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）

（中略）

## (2)販売会社

名称 : 株式会社武蔵野銀行

資本金の額 : 45,743百万円（平成28年9月末日現在）

（後略）

< 訂正後 >

(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29年3月末日現在)  
( 中略 )

(2)販売会社

名称 : 株式会社武蔵野銀行  
資本金の額 : 45,743百万円 (平成29年3月末日現在)

( 後略 )

### 3【資本関係】

< 訂正前 >

( 前略 )

(2)販売会社

株式会社武蔵野銀行は委託会社の株式の20% ( 800株 ) を所有しています。

( 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)  
( 後略 )

< 訂正後 >

( 前略 )

(2)販売会社

株式会社武蔵野銀行は委託会社の株式の20% ( 800株 ) を所有しています。

( 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29年3月末日現在)  
( 後略 )

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29年5月29日

ちばぎんアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているむさしのコア投資ファンド（安定型）の平成28年9月30日から平成29年3月29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、むさしのコア投資ファンド（安定型）の平成29年3月29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9月30日から平成29年3月29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

ちばぎん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

- (注) 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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29年5月29日

ちばぎんアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているむさしのコア投資ファンド（成長型）の平成28年9月30日から平成29年3月29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、むさしのコア投資ファンド（成長型）の平成29年3月29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9月30日から平成29年3月29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

ちばぎん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

- (注) 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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月30日

ちばぎんアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 田 島 昇 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 宮 田 八 郎 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているちばぎん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31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、ちばぎん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

- (注) 1. 上記は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. XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月14日

ちばぎんアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 田 島 昇指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 宮 田 八 郎

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」に掲げられているちばぎん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32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、ちばぎん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

(注) 1. 上記は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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。