

**【表紙】**

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年10月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	債券コア・セレクション
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	(1)当初申込額 50億円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したこと等に伴い、平成28年12月9日に提出した有価証券届出書（平成29年1月31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】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

##### (3) ファンドの仕組み

< 訂正前 >

(前略)

委託会社の概況（平成28年11月30日現在）

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

委託会社の概況（平成29年 7月31日現在）

(後略)

#### 2 投資方針

##### (2) 投資対象

(参考) 投資対象ファンドの概要を以下の内容に更新・訂正します。

< 更新・訂正後 >

(参考) 投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、平成29年 7月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

##### 1. 国内債券インデックス マザーファンド

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

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

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す

投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 2. 日本物価連動国債 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の物価連動国債
投資態度	<p>主としてわが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。</p> <p>運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。</p> <p>債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	平成26年4月3日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### 3.世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、日本を含む世界各国の債券に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への投資割合を決定します。</p> <p>運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。</p> <p>債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
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	該当事項はありません。
信託財産留保額	<p>設定時：該当事項はありません。</p> <p>解約時：0.1%</p>
設定日	平成26年10月8日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

#### 4. 世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ・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>運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。</p> <p>インフレ連動国債（物価連動国債）への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
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、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
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	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成29年1月31日
信託期間	原則として無期限
助言会社	三井住友信託銀行株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・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・パークレイズ・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。

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

投資顧問会社	ヌビーン・アセット・マネジメント・エルエルシー
発行地	ケイマン籍
形態	契約型 / 非上場
表示通貨	日本円
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>
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。
投資態度	<p>主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築は、米国の地方財政や米国地方債における各セクターの幅広いテクニカル要因及びファンダメンタルズ要因等の状況を精査した上で、個別銘柄に対する詳細な分析に基づいて行います。</p> <p>米国の投資適格地方債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p> <p>一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	毎月
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0.44%（税抜0.44%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等及びデリバティブ取引に要する費用等並びに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
設定日	平成28年2月26日

## 6.HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

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

主な投資制限	<p>第一順位担保権付のバンクローンへの投資割合は、投資信託財産の純資産総額の80%以上とします。</p> <p>組入比率上位3業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の15%を上限とします。その他の業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の12%を上限とします。</p> <p>組入比率上位10銘柄への投資割合の合計は、投資信託財産の純資産総額の20%を上限とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
ベンチマーク	クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	<p>年率0.65%（税抜0.65%）</p> <p>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、受託会社・管理事務代行会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。</p> <p>この他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	平成25年10月2日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <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>

## 7. マネープールマザーファンド

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

投資態度	<p>主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（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。）を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

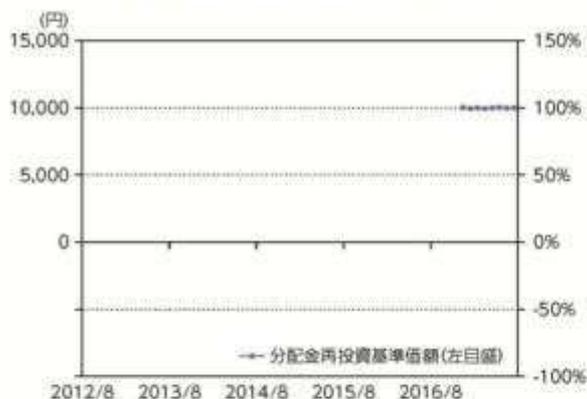
信託報酬	該当事項はありません。
設定日	平成22年2月26日
信託期間	原則として無期限
運用再委託会社 又は助言会社	該当事項はありません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### 3 投資リスク

〔参考情報〕を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

## 〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

\*2012年8月～2017年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>\*1</sup>

先進国株… MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)<sup>\*2</sup>

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)<sup>\*3</sup>

日本国債… NOMJRA-BPI国債<sup>\*4</sup>

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)<sup>\*5</sup>

新興国債… JPMオルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)<sup>\*6</sup>

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

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

\*2 MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

\*3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

\*4 NOMJRA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

\*5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

## 4 手数料等及び税金

## (5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(前略)

上記は、平成28年11月30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;

（前略）

上記は、平成29年 7月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

## 5 運用状況

以下は、平成29年 7月31日現在の状況について記載してあります。

## 債券コア・セレクション

## （1）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	15,979,258,372	39.75
親投資信託受益証券	日本	23,832,888,970	59.28
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		388,549,373	0.97
合計（純資産総額）		40,200,696,715	100.00

（注1）国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （2）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	15,044,703,636	1.0555	15,880,583,294	1.0617	15,972,961,850	39.73
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	7,175,615,523	1,114.7	7,998,714,963	1,118.41	8,025,318,187	19.96
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	825,042.3357	9,616.83	7,934,294,751	9,640.64	7,953,940,185	19.79
日本	親投資信託受益証券	日本物価連動国債 マザーファンド	4,017,755,619	0.9843	3,955,039,819	0.9790	3,933,382,751	9.78
日本	親投資信託受益証券	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	3,969,805,250	0.9802	3,891,218,940	0.9891	3,926,534,372	9.77
日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	9,956	1.0042	9,997	1.0042	9,997	0.00

（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）投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## □ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	39.75
親投資信託受益証券	59.28
合計	99.03

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (3) 運用実績

## 純資産の推移

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (平成29年 7月10日)	33,873,218,722	33,873,218,722	9,938	9,938
平成28年12月末日	191,873,064		10,006	
平成29年 1月末日	4,629,663,372		9,941	
2月末日	10,185,613,470		9,986	
3月末日	19,070,726,733		9,948	
4月末日	20,380,236,557		9,983	
5月末日	25,516,237,608		10,026	
6月末日	31,487,728,545		9,982	
7月末日	40,200,696,715		9,983	

## 分配の推移

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成28年12月29日～平成29年 7月10日	0

## 収益率の推移

	期 間	収益率（％）
--	-----	--------

第1期計算期間	平成28年12月29日～平成29年 7月10日	0.6
---------	-------------------------	-----

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4) 設定及び解約の実績

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	平成28年12月29日～平成29年 7月10日	48,317,935,633	14,232,219,622	34,085,716,011

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

#### (参考)

#### 日本物価連動国債 マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	24,934,193,710	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		529,355,581	2.08
合計(純資産総額)		25,463,549,291	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### 投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第18回利付国債(物価連動・10年)	13,150,000,000	104.45	14,064,819,200	103.10	13,937,264,200	0.100	2024/3/10	54.73
日本	国債証券	第19回利付国債(物価連動・10年)	4,140,000,000	105.15	4,335,797,160	103.60	4,289,040,000	0.100	2024/9/10	16.84
日本	国債証券	第20回利付国債(物価連動・10年)	3,630,000,000	105.40	3,818,367,960	103.55	3,766,382,730	0.100	2025/3/10	14.79
日本	国債証券	第22回利付国債(物価連動・10年)	1,980,000,000	104.90	2,081,781,706	104.05	2,069,172,426	0.100	2027/3/10	8.13
日本	国債証券	第21回利付国債(物価連動・10年)	840,000,000	105.83	885,682,102	103.70	872,334,354	0.100	2026/3/10	3.43

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.92
合計	97.92

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	28,451,000,200	18.89
	ベルギー	13,473,255,486	8.94
	アイルランド	13,374,822,872	8.88
	ポーランド	11,677,502,502	7.75
	デンマーク	11,163,626,876	7.41
	フィンランド	7,500,111,181	4.98
	スペイン	7,193,386,119	4.77
	ハンガリー	6,969,032,484	4.63
	リトアニア	6,922,508,477	4.60
	フィリピン	6,797,950,363	4.51
	オランダ	6,391,160,019	4.24
	スウェーデン	6,085,801,256	4.04
	オーストリア	5,556,284,743	3.69
	フランス	5,112,693,297	3.39
	シンガポール	3,606,414,327	2.39
	アメリカ	3,275,957,543	2.17
	ペルー	2,047,067,538	1.36
	小計	145,598,575,283	96.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,049,628,077	3.35
合計(純資産総額)		150,648,203,360	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		118,212,528,254	78.47

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	13,730,000,000	100.42	13,788,727,000	100.33	13,775,858,200	0.100	2027/3/20	9.14
ベルギー	国債証券	BGB 0.8% 06/22/25	76,800,000	13,325.63	10,234,088,702	13,279.53	10,198,679,731	0.800	2025/6/22	6.77
日本	国債証券	第104回利付国債(20年)	7,600,000,000	121.70	9,249,818,000	121.46	9,231,264,000	2.100	2028/6/20	6.13
アイルランド	国債証券	IRISH 5.4% 03/13/25	50,600,000	17,837.08	9,025,567,377	17,597.26	8,904,216,014	5.400	2025/3/13	5.91
フィンランド	国債証券	RFGB 0.5% 04/15/26	58,000,000	13,109.65	7,603,600,404	12,931.22	7,500,111,181	0.500	2026/4/15	4.98
デンマーク	国債証券	DGB 1.5% 11/15/23	393,000,000	1,923.98	7,561,252,566	1,902.07	7,475,159,308	1.500	2023/11/15	4.96
オランダ	国債証券	NETHER 1.75% 07/15/23	44,600,000	14,326.80	6,389,755,132	14,329.95	6,391,160,019	1.750	2023/7/15	4.24
リトアニア	国債証券	LITHUN 7.375% 02/11/20	44,900,000	12,881.80	5,783,932,351	12,450.73	5,590,380,161	7.375	2020/2/11	3.71
スウェーデン	国債証券	SGB 1.5% 11/13/23	380,000,000	1,490.48	5,663,834,240	1,464.65	5,565,703,440	1.500	2023/11/13	3.69
オーストリア	国債証券	RAGB 0.75% 10/20/26	42,300,000	13,339.59	5,642,650,118	13,135.42	5,556,284,743	0.750	2026/10/20	3.69
フィリピン	国債証券	PHILIP 4% 01/15/21	45,000,000	11,922.26	5,365,018,370	11,760.82	5,292,372,206	4.000	2021/1/15	3.51
フランス	国債証券	FRTR 0.25% 11/25/26	41,200,000	12,327.48	5,078,923,491	12,409.44	5,112,693,297	0.250	2026/11/25	3.39
スペイン	国債証券	SPGB 1.5% 04/30/27	38,800,000	12,847.99	4,985,021,756	12,946.58	5,023,276,804	1.500	2027/4/30	3.33
アイルランド	国債証券	IRISH 1% 05/15/26	34,000,000	13,013.49	4,424,588,887	13,148.84	4,470,606,858	1.000	2026/5/15	2.97
デンマーク	国債証券	DGB 1.75% 11/15/25	190,000,000	1,961.35	3,726,581,816	1,941.29	3,688,467,568	1.750	2025/11/15	2.45
シンガポール	国債証券	SIGB 2.75% 07/01/23	42,000,000	8,659.85	3,637,137,836	8,586.70	3,606,414,327	2.750	2023/7/1	2.39
ポーランド	国債証券	POLAND 3% 03/17/23	30,400,000	11,339.63	3,447,247,926	11,234.89	3,415,409,303	3.000	2023/3/17	2.27
アメリカ	国債証券	T 1.75% 06/30/22	29,800,000	10,947.25	3,262,282,126	10,993.14	3,275,957,543	1.750	2022/6/30	2.17

ベルギー	国債証券	BGB 2.6% 06/22/24	21,800,000	15,044.58	3,279,719,748	15,020.98	3,274,575,755	2.600	2024/6/22	2.17
ポーランド	国債証券	POLAND 4% 01/22/24	26,500,000	11,840.76	3,137,802,250	11,822.01	3,132,834,293	4.000	2024/1/22	2.08
ポーランド	国債証券	POLAND 5% 03/23/22	25,500,000	12,365.51	3,153,207,110	12,235.93	3,120,164,458	5.000	2022/3/23	2.07
日本	国債証券	第10回利付国債(30年)	2,700,000,000	111.28	3,004,776,000	111.36	3,006,774,000	1.100	2033/3/20	2.00
ハンガリー	国債証券	HGB 6.0% 11/24/23	5,000,000,000	51.48	2,574,447,225	52.00	2,600,433,055	6.000	2023/11/24	1.73
ハンガリー	国債証券	REPUN 6.25% 01/29/20	20,800,000	12,124.28	2,521,850,620	12,057.06	2,507,868,834	6.250	2020/1/29	1.66
スペイン	国債証券	SPGB 2.75% 10/31/24	14,900,000	14,580.43	2,172,485,411	14,564.49	2,170,109,315	2.750	2024/10/31	1.44
ペルー	国債証券	PERU 8.75% 11/21/33	12,000,000	16,911.13	2,029,336,500	17,058.89	2,047,067,538	8.750	2033/11/21	1.36
日本	国債証券	第9回利付国債(20年)	1,400,000,000	121.04	1,694,672,000	120.73	1,690,346,000	2.100	2027/12/20	1.12
フィリピン	国債証券	PHILIP 9.5% 02/02/30	7,500,000	17,444.49	1,308,337,188	17,813.52	1,336,014,347	9.500	2030/2/2	0.89
リトアニア	国債証券	LITHUN 6.125% 03/09/21	10,700,000	12,666.11	1,355,274,560	12,449.79	1,332,128,316	6.125	2021/3/9	0.88
ポーランド	国債証券	POLAND 5.125% 04/21/21	10,600,000	12,136.62	1,286,482,370	12,145.39	1,287,412,069	5.125	2021/4/21	0.85

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.65
合計	96.65

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	314,633,480.00	35,528,918,866	34,704,072,844	23.04
	ユーロ	売建	454,377,560.00	58,269,431,730	58,910,050,654	39.10
	スウェーデンクローナ	売建	453,256,600.00	6,031,938,832	6,164,289,760	4.09
	デンマーククローネ	売建	646,905,800.00	11,152,362,238	11,282,037,152	7.49
	ハンガリーフォリント	売建	8,359,719,700.00	3,480,151,311	3,555,388,788	2.36
	シンガポールドル	売建	44,245,160.00	3,616,152,520	3,596,689,056	2.39

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

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

## 世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	10,570,024,755	42.55
	イギリス	6,935,100,365	27.92
	フランス	2,303,648,534	9.27
	イタリア	1,580,770,882	6.36
	ドイツ	668,138,192	2.69
	カナダ	497,014,718	2.00
	スペイン	410,779,578	1.65
	オーストラリア	303,313,268	1.22
	スウェーデン	248,612,884	1.00
	ニュージーランド	111,293,963	0.45
	デンマーク	55,841,480	0.22
	小計	23,684,538,619	95.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,154,108,313	4.65
合計(純資産総額)		24,838,646,932	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		23,732,510,074	95.55

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 04/15/19	4,640,000	11,182.87	537,211,711	11,051.98	535,544,976	0.125	2019/4/15	2.16

アメリカ	国債証券	TII 0.25% 01/15/25	4,280,000	10,998.58	482,011,336	10,916.59	482,718,832	0.250	2025/1/15	1.94
アメリカ	国債証券	TII 0.625% 01/15/26	4,150,000	11,297.63	478,428,979	11,179.65	477,809,486	0.625	2026/1/15	1.92
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 04/15/20	3,800,000	11,221.50	440,853,612	11,080.29	439,977,611	0.125	2020/4/15	1.77
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 01/15/22	3,640,000	11,156.38	434,751,375	11,073.64	435,798,689	0.125	2022/1/15	1.75
アメリカ	国債証券	TII 0.375% 07/15/23	3,500,000	11,261.21	410,528,189	11,179.70	411,444,930	0.375	2023/7/15	1.66
イギリス	国債証券	UKTI 1.25% 11/22/55	800,000	37,875.28	421,047,504	34,519.92	390,182,853	1.250	2055/11/22	1.57
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 04/15/21	3,260,000	11,192.44	372,744,140	11,063.33	372,379,084	0.125	2021/4/15	1.50
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/22	3,150,000	11,181.76	371,093,736	11,097.67	371,988,233	0.125	2022/7/15	1.50
アメリカ	国債証券	TII 0.625% 01/15/24	3,090,000	11,364.44	364,768,425	11,266.98	365,122,024	0.625	2024/1/15	1.47
アメリカ	国債証券	TII 1.125% 01/15/21	2,840,000	11,654.06	366,575,041	11,486.79	364,928,375	1.125	2021/1/15	1.47
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 01/15/23	3,080,000	11,099.00	358,624,569	11,007.31	359,417,744	0.125	2023/1/15	1.45
イギリス	国債証券	UKTI 0.125% 03/22/68	990,000	37,070.79	392,553,440	32,425.68	349,115,887	0.125	2068/3/22	1.41
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/24	3,100,000	10,990.86	347,450,255	10,915.63	348,732,470	0.125	2024/7/15	1.40
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/26	3,180,000	10,831.95	348,490,076	10,720.61	348,033,839	0.125	2026/7/15	1.40
イギリス	国債証券	UKTI 0.375% 03/22/62	950,000	35,198.34	378,323,878	31,363.92	343,097,856	0.375	2062/3/22	1.38
アメリカ	国債証券	TII 1.25% 07/15/20	2,650,000	11,682.75	344,512,342	11,513.78	342,360,833	1.250	2020/7/15	1.38
イギリス	国債証券	UKTI 1.125% 11/22/37	1,020,000	25,007.18	336,682,557	23,784.14	325,744,009	1.125	2037/11/22	1.31
アメリカ	国債証券	TII 3.875% 04/15/29	1,450,000	15,325.59	327,575,181	15,062.10	325,097,954	3.875	2029/4/15	1.31
アメリカ	国債証券	TII 0.375% 01/15/27	2,920,000	11,053.75	325,007,378	10,905.74	322,597,178	0.375	2027/1/15	1.30
イギリス	国債証券	UKTI 0.75% 11/22/47	920,000	28,688.43	339,147,579	26,753.60	321,703,431	0.750	2047/11/22	1.30
イギリス	国債証券	UKTI 1.25% 11/22/27	1,150,000	20,066.68	317,455,957	19,425.43	312,593,185	1.250	2027/11/22	1.26
イギリス	国債証券	UKTI 0.125% 03/22/44	1,250,000	23,386.71	322,147,954	22,060.88	308,901,988	0.125	2044/3/22	1.24
イギリス	国債証券	UKTI 0.625% 03/22/40	1,070,000	24,363.13	321,209,812	23,009.00	308,774,573	0.625	2040/3/22	1.24
イギリス	国債証券	UKTI 0.5% 03/22/50	920,000	28,622.59	329,259,094	26,370.74	308,729,598	0.500	2050/3/22	1.24
イギリス	国債証券	UKTI 2.5% 07/17/24	560,000	53,727.44	300,873,699	53,096.59	297,340,931	2.500	2024/7/17	1.20
イギリス	国債証券	UKTI 0.625% 11/22/42	950,000	25,478.87	304,166,331	24,116.27	292,825,498	0.625	2042/11/22	1.18
アメリカ	国債証券	TII 0.375% 07/15/25	2,570,000	11,139.83	292,244,450	11,032.42	292,575,141	0.375	2025/7/15	1.18
アメリカ	国債証券	TII 3.625% 04/15/28	1,300,000	14,702.74	286,208,099	14,513.57	285,460,026	3.625	2028/4/15	1.15
イギリス	国債証券	UKTI 2.5% 04/16/20	530,000	54,068.79	286,564,614	53,563.88	283,888,572	2.500	2020/4/16	1.14

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	95.35
合計	95.35

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	95,805,700.00	10,810,931,843	10,568,326,767	42.55
	カナダドル	売建	5,791,200.00	504,548,845	512,173,728	2.06
	ユーロ	売建	38,344,300.00	4,915,604,617	4,971,338,495	20.01
	イギリスポンド	売建	48,001,700.00	7,010,052,809	6,956,406,364	28.01
	スウェーデンクローナ	売建	18,429,100.00	245,309,739	250,635,760	1.01
	デンマーククローネ	売建	3,191,400.00	55,018,640	55,658,016	0.22
	オーストラリアドル	売建	3,481,900.00	298,698,444	305,884,915	1.23
	ニュージーランドドル	売建	1,351,900.00	110,953,535	112,086,029	0.45

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

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

#### マネープールマザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		149,178,185,643	100.00
合計(純資産総額)		149,178,185,643	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

##### ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 参考情報

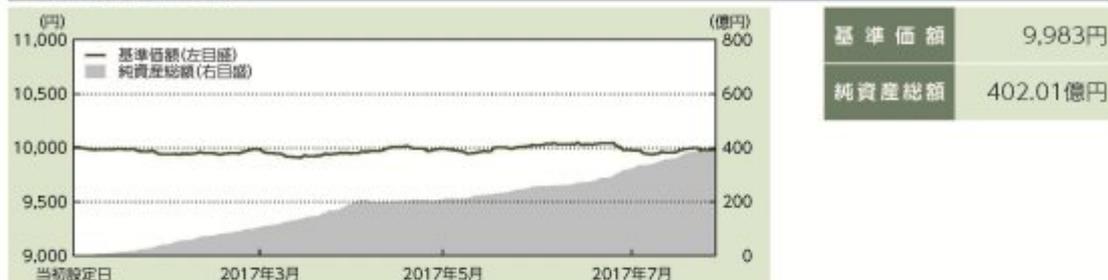
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2016年12月29日

作成基準日：2017年7月31日

### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

### 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2017年7月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-

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

### 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	39.7%
HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス	20.0%
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	19.8%
日本物価連動国債 マザーファンド	9.8%
世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	9.8%
マネーボールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(平成28年12月29日から平成29年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1 財務諸表

## 債券コア・セレクション

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

		第1期 (平成29年7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		851,785,798
投資信託受益証券		13,508,069,714
親投資信託受益証券		20,089,452,050
流動資産合計		34,449,307,562
<b>資産合計</b>		<b>34,449,307,562</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金		217,380,000
未払解約金		352,344,366
未払受託者報酬		344,051
未払委託者報酬		5,963,570
未払利息		1,630
その他未払費用		55,223
流動負債合計		576,088,840
<b>負債合計</b>		<b>576,088,840</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		34,085,716,011
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		212,497,289
(分配準備積立金)		111,662,098
元本等合計		33,873,218,722
<b>純資産合計</b>		<b>33,873,218,722</b>
<b>負債純資産合計</b>		<b>34,449,307,562</b>

## (2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

		第1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年7月10日
<b>営業収益</b>		
受取配当金		54,571,798
受取利息		130
有価証券売買等損益		122,136,424

	第1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年 7月10日
営業収益合計	67,564,496
営業費用	
支払利息	237,442
受託者報酬	2,778,925
委託者報酬	48,167,955
その他費用	463,554
営業費用合計	51,647,876
営業利益又は営業損失（ ）	119,212,372
経常利益又は経常損失（ ）	119,212,372
当期純利益又は当期純損失（ ）	119,212,372
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	41,183,799
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	52,108,319
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	52,108,319
剰余金減少額又は欠損金増加額	104,209,437
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	104,209,437
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	212,497,289

## ( 3 ) 注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
3. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、平成28年12月29日から平成29年 7月10日までとなっております。</p>

( 貸借対照表に関する注記 )

		第1期 (平成29年 7月10日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			34,085,716,011口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損		212,497,289円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		0.9938円 (9,938円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年 7月10日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	111,662,098円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	55,879,713円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	167,541,811円
当ファンドの期末残存口数	F	34,085,716,011口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	49円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## ( 金融商品に関する注記 )

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		第1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年 7月10日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。		

	第1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年 7月10日
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (平成29年 7月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	第1期 自 平成28年12月29日 至 平成29年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	191,755,914円
期中追加設定元本額	48,126,179,719円
期中一部解約元本額	14,232,219,622円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (平成29年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	12,636,091
親投資信託受益証券	103,886,086
合計	116,522,177

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	6,089,779.4228	6,786,244,963	
	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	699,231.7375	6,721,824,751	
投資信託受益証券合計		6,789,011.1603	13,508,069,714	
親投資信託受益証券	日本物価連動国債 マザーファンド	3,400,152,116	3,348,809,819	
	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	3,354,768,117	3,284,988,940	
	世界ハインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	12,757,792,068	13,455,643,294	

マネープールマザーファンド	9,956	9,997	
親投資信託受益証券合計	19,512,722,257	20,089,452,050	
合計		33,597,521,764	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本物価連動国債 マザーファンド

### 貸借対照表

	平成29年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	636,051,713
国債証券	24,289,028,487
未収利息	7,428,293
前払費用	275,508
流動資産合計	24,932,784,001
資産合計	24,932,784,001
負債の部	
流動負債	
未払金	294,621,720
未払解約金	50,799,553
未払利息	1,217
その他未払費用	1,001
流動負債合計	345,423,491
負債合計	345,423,491
純資産の部	
元本等	
元本	24,965,370,754
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	378,010,244
元本等合計	24,587,360,510
純資産合計	24,587,360,510
負債純資産合計	24,932,784,001

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	24,965,370,754口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 378,010,244円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9849円 (1万口当たり純資産額) (9,849円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年12月29日
期首元本額	23,159,136,637円
期中追加設定元本額	4,130,899,938円
期中一部解約元本額	2,324,665,821円
期末元本額	24,965,370,754円

区分	平成29年 7月10日現在
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	13,540,145,577円
日本物価連動国債ファンド（SMA専用）	259,370,388円
債券コア戦略ファンド	37,106,583円
債券コア・セレクション	3,400,152,116円
FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	6,954,038,617円
FOFs用 日本物価連動国債ファンドS（適格機関投資家専用）	774,557,473円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	100,923,414
合計	100,923,414

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第18回利付国債（物価連動・10年）	13,150,000,000	14,018,241,900	
	第19回利付国債（物価連動・10年）	4,140,000,000	4,313,701,980	
	第20回利付国債（物価連動・10年）	3,630,000,000	3,793,509,720	
	第21回利付国債（物価連動・10年）	840,000,000	878,719,077	
	第22回利付国債（物価連動・10年）	1,220,000,000	1,284,855,810	
	合計	22,980,000,000	24,289,028,487	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり

## 貸借対照表

項目	平成29年 7月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	13,644,579,186
コール・ローン	5,695,888,471
国債証券	143,206,929,876
未収入金	189,715,620
未収利息	809,234,188
前払費用	223,049,527
流動資産合計	163,769,396,868
資産合計	163,769,396,868
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,556,273,800
未払金	16,416,886,911
未払解約金	4,192,531
未払利息	10,904
その他未払費用	6,023
流動負債合計	17,977,370,169
負債合計	17,977,370,169
純資産の部	
元本等	
元本	138,230,569,606
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,561,457,093
元本等合計	145,792,026,699
純資産合計	145,792,026,699
負債純資産合計	163,769,396,868

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

平成29年 7月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成29年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	138,230,569,606口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0547円 (1万口当たり純資産額) (10,547円)

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

平成29年 7月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	平成29年 7月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年12月29日
期首元本額	149,617,275,616円
期中追加設定元本額	41,885,477,119円
期中一部解約元本額	53,272,183,129円
期末元本額	138,230,569,606円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	51,168,158,602円
世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（SMA専用）	559,534,992円
債券コア戦略ファンド	139,314,819円
債券コア・セレクション	12,757,792,068円
FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	26,983,542,428円
世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	43,702,788,440円
FOFs用 世界ハイインカム入替戦略ファンドS（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,919,438,257円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,667,489,278
合計	1,667,489,278

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成29年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	115,727,594,543	-	117,283,868,343	1,556,273,800
	アメリカドル	34,390,866,666	-	34,712,077,452	321,210,786
	ユーロ	57,296,821,881	-	58,169,180,832	872,358,951
	スウェーデンク ローナ	6,031,938,832	-	6,141,626,930	109,688,098
	デンマーククロー ネ	10,998,317,416	-	11,166,841,000	168,523,584
	ハンガリーフォリ ント	3,480,151,311	-	3,530,309,629	50,158,318
	シンガポールドル	3,529,498,437	-	3,563,832,500	34,334,063
	合計	115,727,594,543	-	117,283,868,343	1,556,273,800

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	円	第3 4 6 回利付国債(10年)	13,430,000,000	13,449,339,200	
		第1 0 回利付国債(30年)	2,700,000,000	2,994,435,000	
		第9 9 回利付国債(20年)	1,400,000,000	1,687,574,000	
		第1 0 4 回利付国債(20年)	7,300,000,000	8,851,177,000	
		第1 4 5 回利付国債(20年)	600,000,000	720,114,000	
		第1 4 7 回利付国債(20年)	20,000,000	23,702,200	
			円 小計		25,450,000,000

アメリカドル	LITHUN 6.125% 03/09/21	10,700,000.00	12,043,171.00	
	LITHUN 7.375% 02/11/20	42,900,000.00	48,391,200.00	
	PERU 8.75% 11/21/33	12,000,000.00	18,279,060.00	
	PHILIP 10.625% 03/16/25	1,000,000.00	1,530,705.00	
	PHILIP 4% 01/15/21	42,500,000.00	45,157,312.50	
	PHILIP 9.5% 02/02/30	7,500,000.00	11,933,325.00	
	POLAND 3% 03/17/23	28,400,000.00	28,689,822.00	
	POLAND 4% 01/22/24	26,500,000.00	28,173,740.00	
	POLAND 5.125% 04/21/21	10,600,000.00	11,626,080.00	
	POLAND 5% 03/23/22	24,000,000.00	26,453,880.00	
	POLAND 6.375% 07/15/19	6,000,000.00	6,518,040.00	
	REPHUN 6.25% 01/29/20	20,000,000.00	21,825,900.00	
	REPHUN 6.375% 03/29/21	8,000,000.00	8,970,960.00	
	T 1.75% 06/30/22	29,300,000.00	29,023,022.70	
アメリカドル 小計		269,400,000.00	298,616,218.20 (34,093,013,631)	
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	74,800,000.00	76,042,802.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	21,800,000.00	25,133,874.00	
	FRTR 0.25% 11/25/26	40,500,000.00	38,258,730.00	
	IRISH 1% 05/15/26	34,000,000.00	34,120,530.00	
	IRISH 5.4% 03/13/25	50,000,000.00	67,446,250.00	
	NETHER 1.75% 07/15/23	43,600,000.00	47,925,338.00	
	RAGB 0.75% 10/20/26	41,500,000.00	41,586,735.00	
	RFGB 0.5% 04/15/26	57,000,000.00	56,478,450.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	37,800,000.00	37,040,409.00	
	SPGB 2.75% 10/31/24	14,900,000.00	16,543,991.50	
ユーロ 小計		415,900,000.00	440,577,109.50 (57,336,705,030)	
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	380,000,000.00	410,156,800.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	32,700,000.00	38,366,583.00	
スウェーデンクローナ 小計		412,700,000.00	448,523,383.00 (6,073,006,605)	
デンマーククローネ	DGB 1.5% 11/15/23	385,000,000.00	417,578,700.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	190,000,000.00	210,273,000.00	
デンマーククローネ 小計		575,000,000.00	627,851,700.00 (10,987,404,750)	
ハンガリーフォリント	HGB 5.5% 06/24/25	1,700,000,000.00	2,025,388,500.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	5,000,000,000.00	6,110,000,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		6,700,000,000.00	8,135,388,500.00 (3,435,574,563)	
シンガポールドル	SIGB 2.75% 07/01/23	41,000,000.00	43,021,710.00	
シンガポールドル 小計		41,000,000.00	43,021,710.00 (3,554,883,897)	

合計		143,206,929,876 (115,480,588,476)
----	--	--------------------------------------

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 14銘柄	100.0%	29.5%
ユーロ	国債証券 10銘柄	100.0%	49.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 2銘柄	100.0%	5.3%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	9.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 2銘柄	100.0%	3.0%
シンガポールドル	国債証券 1銘柄	100.0%	3.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

## 貸借対照表

項目	平成29年 7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,600,963
コール・ローン	499,811,989
国債証券	23,125,740,238
未収入金	64,577,505
未収利息	58,068,953
前払費用	32,119,338
流動資産合計	23,781,918,986
資産合計	23,781,918,986
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	250,809,751
未払金	66,042,524

	平成29年 7月10日現在
項目	金額（円）
未払解約金	5,461,493
未払利息	956
その他未払費用	1,275
流動負債合計	322,315,999
負債合計	322,315,999
純資産の部	
元本等	
元本	23,957,136,940
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	497,533,953
元本等合計	23,459,602,987
純資産合計	23,459,602,987
負債純資産合計	23,781,918,986

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年 7月10日現在
--	---------------

1. 計算期間の末日における受益権の総数		23,957,136,940口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	497,533,953円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9792円 (9,792円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
----------------------------	--

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年1月31日
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	25,002,677,656円
期中一部解約元本額	1,046,540,716円
期末元本額	23,957,136,940円
期末元本額の内訳	
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	13,213,351,361円
債券コア戦略ファンド	36,580,478円
債券コア・セレクション	3,354,768,117円
世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	119,152,400円
FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	6,474,563,794円
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)	758,720,790円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		608,444,137
合計		608,444,137

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

## 通貨関連

(平成29年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	23,152,171,313	-	23,402,981,064	250,809,751
	アメリカドル	10,440,966,510	-	10,546,701,774	105,735,264
	カナダドル	488,155,940	-	496,260,824	8,104,884
	ユーロ	4,757,608,816	-	4,831,467,345	73,858,529
	イギリスポンド	6,778,801,626	-	6,832,538,240	53,736,614
	スウェーデンク ローナ	237,436,193	-	241,622,654	4,186,461
	デンマーククロー ネ	53,454,179	-	54,274,500	820,321
	オーストラリアド ル	288,413,536	-	291,756,212	3,342,676
	ニュージーランド ドル	107,334,513	-	108,359,515	1,025,002
	合計	23,152,171,313	-	23,402,981,064	250,809,751

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	TII 0.125% 01/15/22	3,640,000.00	3,915,590.97	
		TII 0.125% 01/15/23	3,080,000.00	3,222,582.25	
		TII 0.125% 04/15/19	3,890,000.00	4,057,990.77	
		TII 0.125% 04/15/20	3,800,000.00	3,968,561.24	
		TII 0.125% 04/15/21	3,260,000.00	3,351,863.47	
		TII 0.125% 04/15/22	1,250,000.00	1,247,201.60	
		TII 0.125% 07/15/22	3,150,000.00	3,336,440.35	
		TII 0.125% 07/15/24	3,100,000.00	3,122,565.32	
		TII 0.125% 07/15/26	3,180,000.00	3,112,359.45	
		TII 0.25% 01/15/25	4,280,000.00	4,319,804.41	
		TII 0.375% 01/15/27	2,920,000.00	2,885,259.16	
		TII 0.375% 07/15/23	3,500,000.00	3,687,494.89	
		TII 0.375% 07/15/25	2,570,000.00	2,617,420.53	
		TII 0.625% 01/15/24	2,720,000.00	2,879,846.89	
		TII 0.625% 01/15/26	4,150,000.00	4,277,397.74	
		TII 0.625% 02/15/43	1,740,000.00	1,677,232.34	
		TII 0.625% 07/15/21	2,150,000.00	2,385,079.38	
		TII 0.75% 02/15/42	1,750,000.00	1,776,587.82	
		TII 0.75% 02/15/45	1,750,000.00	1,678,878.75	
		TII 0.875% 02/15/47	1,000,000.00	966,288.21	
		TII 1.125% 01/15/21	2,840,000.00	3,288,605.84	
		TII 1.25% 07/15/20	2,650,000.00	3,090,723.78	
		TII 1.375% 01/15/20	1,280,000.00	1,498,044.74	
		TII 1.375% 02/15/44	1,720,000.00	1,935,278.22	
		TII 1.375% 07/15/18	450,000.00	518,195.22	
		TII 1.75% 01/15/28	1,150,000.00	1,486,681.44	

	TII 1.875% 07/15/19	1,520,000.00	1,812,412.45
	TII 1% 02/15/46	1,540,000.00	1,562,908.41
	TII 2.125% 01/15/19	1,450,000.00	1,703,807.01
	TII 2.125% 02/15/40	1,130,000.00	1,572,423.43
	TII 2.125% 02/15/41	1,820,000.00	2,510,695.33
	TII 2.375% 01/15/25	1,290,000.00	1,898,013.09
	TII 2.375% 01/15/27	800,000.00	1,124,278.43
	TII 2.5% 01/15/29	1,200,000.00	1,632,391.96
	TII 2% 01/15/26	1,060,000.00	1,456,097.63
	TII 3.375% 04/15/32	370,000.00	694,882.50
	TII 3.625% 04/15/28	1,300,000.00	2,552,290.50
	TII 3.875% 04/15/29	1,350,000.00	2,708,588.96
	アメリカドル 小計	81,800,000.00	91,532,764.48 (10,450,295,720)
カナダドル	CANI 0.5% 12/01/50	60,000.00	56,673.33
	CANI 1.25% 12/01/47	580,000.00	708,299.23
	CANI 1.5% 12/01/44	580,000.00	785,302.44
	CANI 2% 12/01/41	500,000.00	757,680.80
	CANI 3% 12/01/36	420,000.00	758,942.25
	CANI 4.25% 12/01/21	400,000.00	737,981.75
	CANI 4.25% 12/01/26	390,000.00	780,808.19
	CANI 4% 12/01/31	440,000.00	924,494.08
	カナダドル 小計	3,370,000.00	5,510,182.07 (488,202,131)
ユーロ	BTPS 1.3% 05/15/28	310,000.00	310,009.90
	BTPSI 0.1% 05/15/22	560,000.00	570,424.40
	BTPSI 1.25% 09/15/32	610,000.00	592,495.01
	BTPSI 1.7% 09/15/18	800,000.00	845,998.82
	BTPSI 2.1% 09/15/21	1,260,000.00	1,515,322.85
	BTPSI 2.35% 09/15/19	1,300,000.00	1,557,785.06
	BTPSI 2.35% 09/15/24	1,040,000.00	1,170,405.85
	BTPSI 2.35% 09/15/35	990,000.00	1,344,213.16
	BTPSI 2.55% 09/15/41	650,000.00	797,998.75
	BTPSI 2.6% 09/15/23	1,360,000.00	1,778,940.74
	BTPSI 3.1% 09/15/26	910,000.00	1,144,075.43
	DBRI 0.1% 04/15/23	1,190,000.00	1,329,862.38
	DBRI 0.1% 04/15/26	860,000.00	943,675.79
	DBRI 0.1% 04/15/46	450,000.00	497,115.71
	DBRI 0.5% 04/15/30	630,000.00	720,615.49
	DBRI 1.75% 04/15/20	1,200,000.00	1,443,197.87
	FRTRI 0.1% 03/01/21	400,000.00	425,588.32
	FRTRI 0.1% 03/01/25	570,000.00	608,123.25
	FRTRI 0.1% 03/01/28	270,000.00	282,401.67

	FRTRI 0.1% 07/25/21	580,000.00	622,736.61
	FRTRI 0.1% 07/25/47	450,000.00	441,508.13
	FRTRI 0.25% 07/25/18	820,000.00	881,278.02
	FRTRI 0.25% 07/25/24	1,030,000.00	1,139,026.39
	FRTRI 0.7% 07/25/30	710,000.00	805,662.83
	FRTRI 1.1% 07/25/22	1,320,000.00	1,618,175.14
	FRTRI 1.3% 07/25/19	880,000.00	1,000,562.48
	FRTRI 1.8% 07/25/40	860,000.00	1,395,760.99
	FRTRI 1.85% 07/25/27	1,120,000.00	1,490,337.17
	FRTRI 2.1% 07/25/23	1,210,000.00	1,595,641.76
	FRTRI 2.25% 07/25/20	1,470,000.00	2,025,511.07
	FRTRI 3.15% 07/25/32	780,000.00	1,466,813.83
	FRTRI 3.4% 07/25/29	650,000.00	1,197,148.25
	SPGBEI 0.3% 11/30/21	300,000.00	318,289.80
	SPGBEI 0.55% 11/30/19	730,000.00	769,196.30
	SPGBEI 0.65% 11/30/27	380,000.00	382,044.51
	SPGBEI 1.8% 11/30/24	970,000.00	1,104,707.54
	SPGBEI 1% 11/30/30	450,000.00	458,107.65
	ユーロ 小計	30,070,000.00	36,590,758.92 (4,761,921,365)
イギリスポンド	UKTI 0.125% 03/22/24	1,140,000.00	1,468,276.11
	UKTI 0.125% 03/22/26	730,000.00	900,642.08
	UKTI 0.125% 03/22/29	1,090,000.00	1,525,079.49
	UKTI 0.125% 03/22/44	1,160,000.00	1,947,775.55
	UKTI 0.125% 03/22/46	1,020,000.00	1,648,935.25
	UKTI 0.125% 03/22/58	820,000.00	1,604,527.64
	UKTI 0.125% 03/22/68	940,000.00	2,244,852.64
	UKTI 0.125% 11/22/19	560,000.00	651,842.06
	UKTI 0.125% 11/22/36	490,000.00	696,966.09
	UKTI 0.125% 11/22/56	180,000.00	331,281.03
	UKTI 0.125% 11/22/65	550,000.00	1,197,858.32
	UKTI 0.25% 03/22/52	940,000.00	1,831,225.62
	UKTI 0.375% 03/22/62	950,000.00	2,323,933.24
	UKTI 0.5% 03/22/50	920,000.00	2,096,498.23
	UKTI 0.625% 03/22/40	1,070,000.00	2,107,100.26
	UKTI 0.625% 11/22/42	890,000.00	1,868,561.05
	UKTI 0.75% 03/22/34	1,090,000.00	1,824,338.56
	UKTI 0.75% 11/22/47	870,000.00	2,063,723.96
	UKTI 1.125% 11/22/37	970,000.00	2,116,808.26
	UKTI 1.25% 11/22/27	1,060,000.00	1,977,673.82
	UKTI 1.25% 11/22/32	1,030,000.00	1,918,639.40
	UKTI 1.25% 11/22/55	760,000.00	2,515,139.02

	UKTI 1.875% 11/22/22	1,190,000.00	1,940,804.83
	UKTI 2.5% 04/16/20	530,000.00	1,956,744.10
	UKTI 2.5% 07/17/24	510,000.00	1,861,854.45
	UKTI 2% 01/26/35	690,000.00	1,807,106.55
	UKTI 4.125% 07/22/30	360,000.00	1,305,916.20
イギリスポンド 小計		22,510,000.00	45,734,103.81 (6,735,261,468)
スウェーデンクローナ	SGBI 0.125% 06/01/19	1,700,000.00	1,818,084.26
	SGBI 0.125% 06/01/26	1,060,000.00	1,219,439.37
	SGBI 0.125% 06/01/32	650,000.00	732,456.58
	SGBI 0.125% 12/01/27	500,000.00	567,287.80
	SGBI 0.25% 06/01/22	2,300,000.00	2,605,614.07
	SGBI 1% 06/01/25	1,790,000.00	2,183,188.91
	SGBI 3.5% 12/01/28	2,260,000.00	4,348,150.77
	SGBI 4% 12/01/20	2,630,000.00	4,169,281.78
スウェーデンクローナ 小計		12,890,000.00	17,643,503.54 (238,893,037)
デンマーククローネ	DGBI 0.1% 11/15/23	2,770,000.00	3,090,997.07
デンマーククローネ 小計		2,770,000.00	3,090,997.07 (54,092,448)
オーストラリアドル	ACGBI 1.25% 02/21/22	390,000.00	444,681.90
	ACGBI 1.25% 08/21/40	200,000.00	208,854.00
	ACGBI 1% 11/21/18	360,000.00	386,607.60
	ACGBI 2.5% 09/20/30	290,000.00	400,255.10
	ACGBI 2% 08/21/35	280,000.00	342,860.00
	ACGBI 3% 09/20/25	540,000.00	754,120.80
	ACGBI 4% 08/20/20	430,000.00	793,246.80
オーストラリアドル 小計		2,490,000.00	3,330,626.20 (289,231,579)
ニュージーランドドル	NZGBI 2.5% 09/20/35	290,000.00	310,934.39
	NZGBI 2.5% 09/20/40	130,000.00	133,642.93
	NZGBI 2% 09/20/25	410,000.00	435,969.83
	NZGBI 3% 09/20/30	360,000.00	418,603.44
ニュージーランドドル 小計		1,190,000.00	1,299,150.59 (107,842,490)
合計			23,125,740,238 (23,125,740,238)

## 有価証券明細表注記

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

## 4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 38銘柄	100.0%	45.2%
カナダドル	国債証券 8銘柄	100.0%	2.1%
ユーロ	国債証券 37銘柄	100.0%	20.6%
イギリスポンド	国債証券 27銘柄	100.0%	29.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	1.0%
デンマーククローネ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.2%
オーストラリアドル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## マネープールマザーファンド

## 貸借対照表

	平成29年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	149,189,698,544
流動資産合計	149,189,698,544
資産合計	149,189,698,544
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16
未払利息	285,626
その他未払費用	273,268
流動負債合計	558,910
負債合計	558,910
純資産の部	
元本等	
元本	148,562,460,190
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	626,679,444
元本等合計	149,189,139,634
純資産合計	149,189,139,634
負債純資産合計	149,189,698,544

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

	平成29年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	148,562,460,190口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0042円 (1万口当たり純資産額) (10,042円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	平成29年 7月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年12月29日
期首元本額	99,533,637円
期中追加設定元本額	148,512,874,677円
期中一部解約元本額	49,948,124円
期末元本額	148,562,460,190円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円

区分	平成29年 7月10日現在
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(米ドルコース)	1,005,802円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)	6,379,762円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)	12,459,876円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン(円コース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(豪ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(ユーロコース)(SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
欧州REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,953円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
SLI GARSファンド(米ドルコース)(SMA専用)	4,976円
ブルーベイ クレジットLSファンド(米ドルコース)(SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
GIVI世界株式ファンド(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS(SMA専用)	1,004,876円
欧州REIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,950円

区分	平成29年 7月10日現在
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
ニューメリックインベスターズ 世界株式LSファンド(SMA専用)	996円
NMS 米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	996円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	9,957円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	996円
米国ハイイールド・リスクレーダー戦略ファンド	996円
米国株式ベアファンド(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	10,952,515,892円
日本債券ベアファンド3(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	5,077,856,600円
225ベアファンド6(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	132,477,399,446円
225ベアファンド7(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	298,686円
私募マネープールファンドAL(適格機関投資家専用)	11,186,576円

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2 ファンドの現況

## 債券コア・セレクション

## 純資産額計算書

（平成29年 7月31日現在）

資産総額	41,206,203,667円
負債総額	1,005,506,952円
純資産総額（ - ）	40,200,696,715円
発行済口数	40,270,744,435口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9983円
（1万口当たり純資産額）	（9,983円）

（参考）

## 日本物価連動国債 マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年 7月31日現在）

資産総額	25,464,826,737円
負債総額	1,277,446円
純資産総額（ - ）	25,463,549,291円
発行済口数	26,011,009,081口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9790円
（1万口当たり純資産額）	（9,790円）

## 世界ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり

## 純資産額計算書

（平成29年 7月31日現在）

資産総額	151,748,227,863円
負債総額	1,100,024,503円
純資産総額（ - ）	150,648,203,360円
発行済口数	141,886,882,249口

1口当たり純資産額（ / ）	1.0617円
（1万口当たり純資産額）	（10,617円）

## 世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

## 純資産額計算書

（平成29年 7月31日現在）

資産総額	24,917,072,888円
負債総額	78,425,956円
純資産総額（ - ）	24,838,646,932円
発行済口数	25,111,495,542口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9891円
（1万口当たり純資産額）	（9,891円）

## マネープールマザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年 7月31日現在）

資産総額	149,180,399,894円
負債総額	2,214,251円
純資産総額（ - ）	149,178,185,643円
発行済口数	148,558,224,240口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0042円
（1万口当たり純資産額）	（10,042円）

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1 委託会社等の概況

<訂正前>

(1)資本金の額（平成28年11月30日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成29年 1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)資本金の額（平成29年 7月31日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成29年10月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### 2 事業の内容及び営業の概況

<訂正前>

（前略）

平成28年11月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	471	8,722,226
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	42	193,545
単位型公社債投資信託	0	0
合計	513	8,915,771

<訂正後>

（前略）

平成29年7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	482	9,149,087
追加型公社債投資信託	0	0

単位型株式投資信託	55	214,665
単位型公社債投資信託	0	0
合計	537	9,363,752

### 3 委託会社等の経理状況

< 更新・訂正後 >

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。  
 なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1) 貸借対照表

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日現在）		当事業年度 （平成29年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		16,534,066		20,260,630
前払費用		102,445		143,622
未収委託者報酬		5,528,610		5,252,944
繰延税金資産		121,367		61,677
その他		5,566		5,474
流動資産合計		22,292,056		25,724,348
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	55,487	1	47,993
器具備品	1	90,924	1	73,765
その他	1	3,748	1	2,830
有形固定資産合計		150,160		124,589
無形固定資産				
ソフトウェア		215,175		221,499
その他		5,886		6,656
無形固定資産合計		221,062		228,156
投資その他の資産				
投資有価証券		63,797		71,153
長期前払費用		8,021		9,828
長期貸付金		22,838		19,838

会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	123,235	137,359
その他	235	145
貸倒引当金	22,838	19,838
投資その他の資産合計	220,289	243,485
固定資産合計	591,512	596,231
資産合計	22,883,569	26,320,580

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	68,500	71,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000

繰越利益剰余金	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612
旅費交通費	67,392	61,961
租税公課	73,989	106,691

不動産賃借料		125,339		113,697
減価償却費		126,985		134,710
業務委託費	1	209,510	1	486,690
諸経費		217,580		223,685
一般管理費合計		3,246,214		3,304,885
営業利益		6,525,812		6,261,346

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)		(自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		8,092		4,669
収益分配金		2,026		129
投資有価証券売却益		350		307
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(単位：千円)

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

当期末残高	300,000	350,000	350,000
-------	---------	---------	---------

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					

剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

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

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28千円増加しております。

#### 追加情報

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

#### 注記事項

##### （貸借対照表関係）

##### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
建 物	54,302	千円	62,231	千円
器具備品	263,257	"	298,576	"
そ の 他	841	"	1,759	"
計	318,401	"	362,567	"

##### （損益計算書関係）

##### 1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
業務委託費	39,733	千円	39,286	千円
長期前払費用償却	27,866	"	4,644	"

##### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

##### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

##### 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成29年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当金の原資	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	16,534,066	16,534,066	-
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

(\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	20,260,630	20,260,630	-
(2) 未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
(4) 未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
(5) 未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

(\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## (1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 投資有価証券

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

## (4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

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

（単位：千円）

区分	平成28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	3

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499

（有価証券関係）

1. 其他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

当事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

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

ません。

## ２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

### １．採用している退職給付制度の概要

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

### ２．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
（１）退職給付債務	389,941	437,197
（２）退職給付引当金	389,941	437,197

（注）１．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

２．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

### ３．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
（１）退職給付費用	73,742	76,106

（注）１．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

２．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,434千円、当事業年度で14,321千円であります。

### ４．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

### １．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成28年3月31日）		当事業年度 （平成29年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	86,931	千円	28,688	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,993	"	6,074	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,437	"	30,265	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	119,400	"	133,869	"
その他	7,674	"	6,972	"
繰延税金資産 合計	251,436	"	205,870	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	244,602	"	199,037	"

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

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

## (持分法損益等)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

## (セグメント情報)

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

## (関連情報)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,979,867千円

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,568,158千円

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

## (報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

## (報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

## (報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度	当事業年度
--	-------	-------

	(平成28年3月31日)	(平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	5,848,968円06銭	7,282,436円46銭
1株当たり当期純利益金額	1,447,521円33銭	1,443,463円05銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。  
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 5 その他

### < 訂正前 >

#### (1) 定款の変更

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

#### (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成29年 1月31日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

### < 訂正後 >

#### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

#### (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成29年10月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1 名称、資本金の額及び事業の内容

#### < 訂正前 >

#### (1) 受託会社

( 中略 )

資本金の額：342,037百万円（平成28年9月末日現在）

( 中略 )

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成28年9月末日現在）	事業の内容
----	-----------------------------	-------

（後略）

<訂正後>

(1)受託会社

（中略）

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	資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在）	事業の内容
----	-----------------------------	-------

（後略）

### 3 資本関係

<訂正前>

（前略）

(参考)再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成28年9月末日現在）

（後略）

<訂正後>

（前略）

(参考)再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成29年3月末日現在）

（後略）

# 独立監査人の監査報告書

平成29年9月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

山田信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている債券コア・セレクションの平成28年12月29日から平成29年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、債券コア・セレクションの平成29年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成29年 6月 2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。