

世界経済インデックスファンド

追加型投信／内外／資産複合

交付運用報告書

第6期 (決算日 2015年1月20日)
(作成対象期間 2014年1月21日～2015年1月20日)

| 第6期末(2015年1月20日) | |
|-------------------------|-----------|
| 基準価額 | 20,530円 |
| 純資産総額 | 10,344百万円 |
| (2014年1月21日～2015年1月20日) | |
| 騰落率 | 13.1% |
| 分配金合計 | 20円 |

(注1) 以下本書において、基準価額及び分配金は1万口当たりで表記しています。

(注2) 騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

お問い合わせ先

フリーダイヤル:0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

モバイルサイト <http://m.smtam.jp/>

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。さて、当ファンドは、このたび、上記の決算を行いました。当ファンドは、国内、先進国および新興国の公社債および株式等に実質的に分散投資(原則として株式50%、債券50%)することでリスクの低減をはかりながら、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した。ここに期間中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

なお、2014年12月1日より投資信託及び投資法人に関する法律が改正されたことに伴い、新たにみなさまに交付する運用報告書は、本紙「交付運用報告書」となります。別途「運用報告書(全体版)」を弊社のホームページに掲載しています。

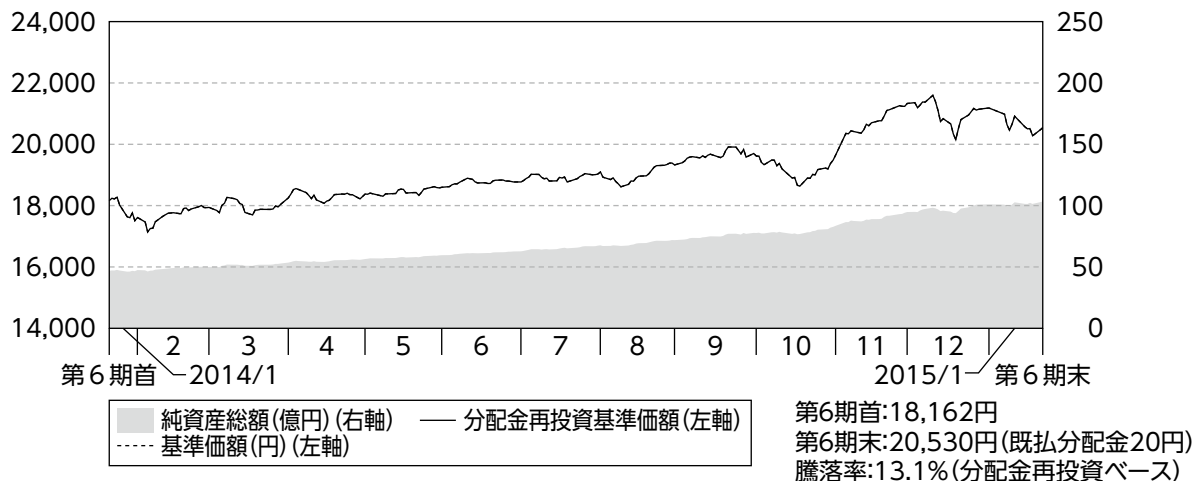
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

当ファンドは、投資信託約款において運用報告書(全体版)を電磁的方法によりご提供することを定めております。上記PCサイトにアクセスし、「ファンドを検索する」等から、当ファンドのページを表示させることにより、運用報告書(全体版)を閲覧及びダウンロードすることができます。なお、ご請求いただいた場合には交付いたしますので、販売会社までお問い合わせください。

運用経過の説明

1 基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2014年1月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

2 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は地政学的リスクの高まりや外国為替市場の影響、原油価格下落に対する警戒感等により下落する場面も見られましたが、米国景気の回復基調や世界的な金融緩和の流れを受けて、当ファンドが実質的な投資対象とする国内、先進国および新興国の株式並びに公社債は概ね堅調に推移したことから当ファンドの基準価額も上昇しました。

| 組入ファンド | 投資資産 | 基本組入比率 | 当作成対象 期間末組入比率 | 騰落率 |
|---------------------|-------|--------|------------------|-------|
| 国内債券インデックス マザーファンド | 国内債券 | 5.0% | 3.7% | 4.7% |
| 国内株式インデックス マザーファンド | 国内株式 | 5.0% | 5.4% | 10.2% |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 先進国債券 | 27.5% | 27.7% | 15.1% |
| 外国株式インデックス マザーファンド | 先進国株式 | 27.5% | 28.6% | 18.5% |
| 新興国債券インデックス マザーファンド | 新興国債券 | 17.5% | 16.5% | 8.1% |
| 新興国株式インデックス マザーファンド | 新興国株式 | 17.5% | 16.7% | 13.6% |

運用経過の説明

3 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 (2014年1月21日~2015年1月20日) | | 項目の概要 |
|------------------|-------------------------------|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 103円 | 0.540% | (a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は19,147円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (投信会社) | (41) | (0.216) | |
| (販売会社) | (52) | (0.270) | |
| (受託会社) | (10) | (0.054) | |
| (b) 売買委託手数料 | 4 | 0.019 | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株式) | (2) | (0.011) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (オプション証券等) | (-) | (-) | |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-) | (-) | |
| (投資信託証券) | (1) | (0.003) | |
| (商品) | (-) | (-) | |
| (先物・オプション) | (1) | (0.005) | |
| (c) 有価証券取引税 | 4 | 0.023 | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (4) | (0.023) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (オプション証券等) | (-) | (-) | |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-) | (-) | |
| (公社債) | (-) | (-) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 23 | 0.121 | (d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、証拠金利息の調整金額等 |
| (保管費用) | (22) | (0.116) | |
| (監査費用) | (1) | (0.005) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 134 | 0.703 | |

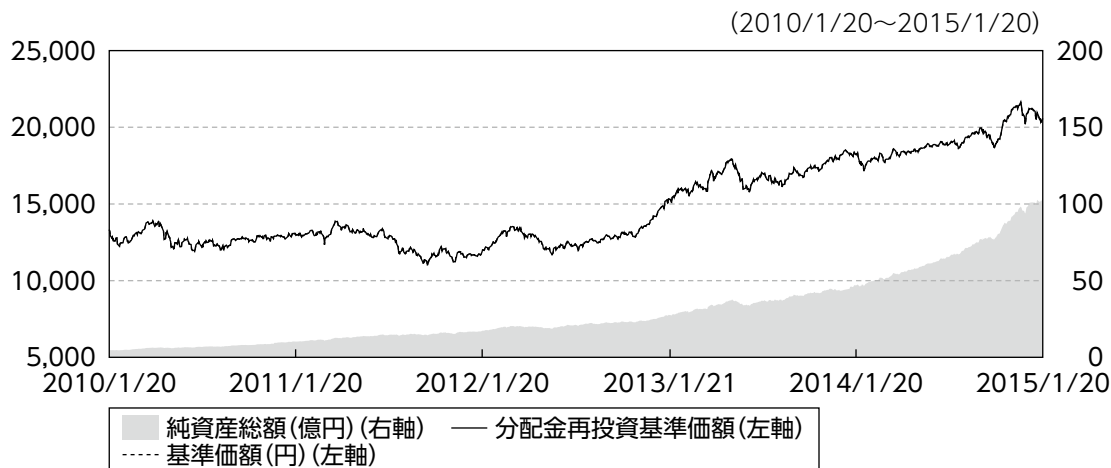
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) -印は該当がないことを示します。

4 最近5年間の基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したもとして計算しております。

(注2) 分配金再投資基準価額は、2010年1月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

| 決算日 | 2010年1月20日 期初 | 2011年1月20日 決算日 | 2012年1月20日 決算日 | 2013年1月21日 決算日 | 2014年1月20日 決算日 | 2015年1月20日 決算日 |
|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (円) | 13,329 | 12,972 | 12,000 | 15,282 | 18,162 | 20,530 |
| 期間分配金合計(税引前) (円) | — | 0 | 0 | 20 | 20 | 20 |
| 分配金再投資基準価額騰落率 (%) | — | △2.7 | △7.5 | 27.5 | 19.0 | 13.1 |
| 純資産総額 (百万円) | 473 | 1,022 | 1,737 | 2,751 | 4,684 | 10,344 |

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

5 投資環境

国内債券市場

日銀による大規模な国債購入を背景に需給の引き締まった状態が続いたことに加え、地政学的リスクの高まりやECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和観測などを背景に国内金利は低下基調となりました。2014年10月末に日銀が追加金融緩和を発表したことで金利低下圧力が一層強まり、また、世界的な低金利を背景に当期末にかけては低下余地を探る展開となりました。

国内株式市場

当期初は主に天候要因による米国経済指標の悪化や地政学的リスクへの警戒感から軟調に推移する場面も見られましたが、その後は米国の景気回復期待が高まったことや円安が進行したことなどから堅調に推移しました。2014年10月には世界的な景気減速が懸念されたことから急落しましたが、10月末に日銀が追加金融緩和を発表したことで急激に円安が進行し、国内株式市場は大幅に上昇しました。当期末にかけては原油安などを背景に上値の重い展開が続きました。

先進国債券市場

米国では、FRB（米連邦準備理事会）が緩和的な金融政策を継続する姿勢を示したことや地政学的リスクの高まりなどを受けて利回りは低下しました。欧州では、ユーロ圏における低インフレが顕著となったことや域内の弱い経済指標が相次いだことなどをを受けてECBによる追加金融緩和観測が高まり、利回りは低下基調となりました。また、当期末にかけては原油安を背景に世界的に低インフレ傾向が強まったこともあり、利回りの低下基調が継続しました。

先進国株式市場

当期初は悪天候による影響を受けた米国経済指標の一時的な悪化や地政学的リスクなどを背景に株価が調整する場面が見られたものの、FRBによる超低金利政策の長期化観測やECBの追加金融緩和観測など世界的な金融緩和の流れを受けて底堅い推移となりました。2014年10月には世界経済の成長見通しが引き下げられたことなどを背景に株価は一時急落しましたが、FRBが利上げを急がない姿勢を示したことなどが好感され反発しました。当期末にかけては原油安やギリシャの政情不安などを背景に不安定な市場動向となり上値の重い展開となりました。

新興国債券市場

FRBが金融緩和を継続する姿勢を示したことなどを背景に堅調な推移が続いていましたが、ウクライナ情勢の緊迫化など地政学的リスクの高まりなどを受けて利回りが上昇する場面も見られました。当期末にかけては、原油安の影響が警戒されリスクを抑制する投資行動が広がったことなどを背景に軟調な推移となりました。

新興国株式市場

地政学的リスクの高まりや世界景気の先行き懸念などから下落する場面もありましたが、FRBが利上げを急がない姿勢を示したことやECBによる追加金融緩和期待などをを受けて底堅い推移となりました。当期末にかけては中国の景気減速懸念や原油安による産油国経済への影響などが警戒され軟調な展開が続きました。

6 当該投資信託のポートフォリオ

○当ファンド

国内、先進国および新興国の株式・公社債へ実質的に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行いました。各資産への配分は、概ね基本組入比率を維持する運用を行いました。

○国内債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合インデックスに連動する投資成果を目標として、ベンチマークに合わせてデュレーション、債券種別や残存期間を調整しました。また、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む国内債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

○国内株式インデックス マザーファンド

ベンチマークである東証株価指数(TOPIX)に連動する投資成果を目標として、現物株式については、東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外した上で、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、設定や解約による資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む国内株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

○外国債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させた運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む外国債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

○外国株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む外国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

○新興国債券インデックス マザーファンド

ベンチマークである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・ディバシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させた運用を行いました。

○新興国株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるMSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行い、また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む新興国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

運用経過の説明

7 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

8 分配金

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第6期 | |
|-----------|-----------------------|---------|
| | 2014年1月21日~2015年1月20日 | |
| 当期分配金 | (円) | 20 |
| (対基準価額比率) | (%) | (0.097) |
| 当期の収益 | (円) | 20 |
| 当期の収益以外 | (円) | — |
| 翌期繰越分配対象額 | (円) | 10,529 |

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)―印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

○当ファンド

主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。株式(DR(預託証券)を含みます。)と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。

○国内債券インデックス マザーファンド

NOMURA-BPI総合インデック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。

○国内株式インデックス マザーファンド

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、東証株価指数(TOPIX)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。

○外国債券インデックス マザーファンド

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。

○外国株式インデックス マザーファンド

原則として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(除く日本、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。

○新興国債券インデックス マザーファンド

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、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・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

○新興国株式インデックス マザーファンド

主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

お知らせ

運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月1日)

信託契約の解約、変更等における書面決議の要件を緩和するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月1日)

信託契約の解約、変更等における書面決議に反対の受益者による買取請求権に係る条項を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。なお、反対の受益者は解約の実行の請求を選択することによって対応できます。

(変更日:2014年12月1日)

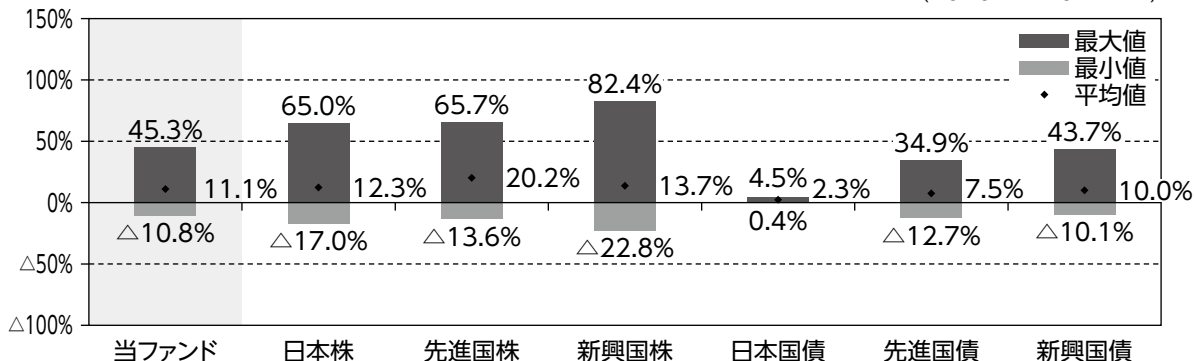
米国シティグループが同社の企業ブランドを「シティグループ」から「シティ」に変更したことに伴い、同社が算出するインデックスおよび指数開発者の名称が変更となりました。

当該投資信託の概要

| | | |
|--------|---|--|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合 | |
| 信託期間 | 信託期間は2009年1月16日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。 | |
| 主要投資対象 | 世界経済インデックスファンド | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | 国内債券インデックス マザーファンド | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| | 国内株式インデックス マザーファンド | わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。 |
| | 外国債券インデックス マザーファンド | 日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。 |
| | 外国株式インデックス マザーファンド | 原則として、MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)を構成している国の株式を主要投資対象とします。 |
| | 新興国債券インデックス マザーファンド | 新興国の債券を主要投資対象とします。 |
| | 新興国株式インデックス マザーファンド | 取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | 世界経済インデックスファンド | 主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。株式(DR(預託証券)を含みます。)と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。 |
| | 国内債券インデックス マザーファンド | NOMURA-BPI総合インデック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。 |
| | 国内株式インデックス マザーファンド | 原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、東証株価指数(TOPIX)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。 |
| | 外国債券インデックス マザーファンド | 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。 |
| | 外国株式インデックス マザーファンド | 原則として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(除く日本、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。 |
| | 新興国債券インデックス マザーファンド | 主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、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・ディバースィファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| | 新興国株式インデックス マザーファンド | 主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 分配方針 | 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 | |

代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2010/1~2014/12)



(注1) 2010年1月~2014年12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たものであり、決算日に対応した数値とは異なります。

(注2) 当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

(注3) 各資産クラスの指数

日本株・・・ TOPIX (東証株価指数、配当込み) *1

先進国株・・・ MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース) *2

新興国株・・・ MSCIエマーシング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) *3

日本国債・・・ NOMURA-BPI国債*4

先進国債・・・ シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース) *5

新興国債・・・ JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース) *6

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。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※1 TOPIX (東証株価指数) とは、株式会社東京証券取引所 (以下「東証」) が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、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エマーシング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

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

※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.

当該投資信託のデータ

1 当該投資信託の組入資産の内容

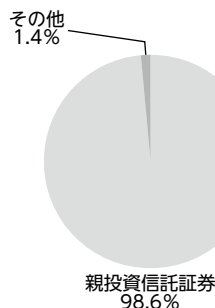
○組入ファンド

| | 第6期末 |
|---------------------|------------|
| | 2015年1月20日 |
| 外国株式インデックス マザーファンド | 28.6% |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 27.7% |
| 新興国株式インデックス マザーファンド | 16.7% |
| 新興国債券インデックス マザーファンド | 16.5% |
| 国内株式インデックス マザーファンド | 5.4% |
| 国内債券インデックス マザーファンド | 3.7% |
| その他 | 1.4% |
| 組入ファンド数 | 6 |

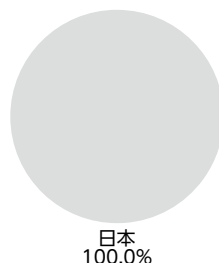
(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載されています。

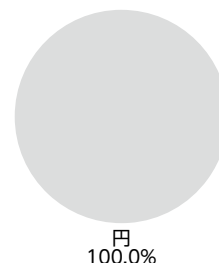
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

2 純資産等

| 項目 | 第6期末 |
|------------|-----------------|
| | 2015年1月20日 |
| 純資産総額 | 10,344,646,326円 |
| 受益権総口数 | 5,038,845,504口 |
| 1万口当たり基準価額 | 20,530円 |

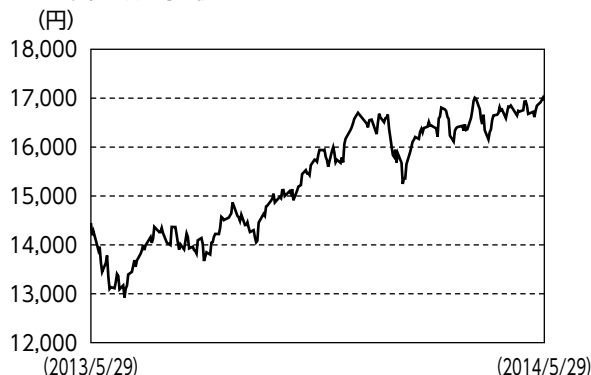
※当期間中における追加設定元本額は3,411,351,368円、同解約元本額は951,621,550円です。

当該投資信託のデータ

3 組入ファンドの概要

外国株式インデックス マザーファンド

○基準価額の推移



○1万口当たりの費用明細

(2013年5月30日~2014年5月29日)

| 項目 | |
|--|--------------------------------|
| (a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション) | 0円 (0) (0) (0) (0) |
| (b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券) | 0 (0) (0) (0) |
| (c) 保管費用等 | 6 |
| 合計 | 6 |

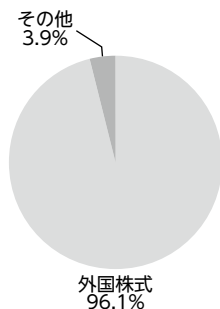
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|----|---------------------|------|------|
| 1 | APPLE INC | アメリカ | 1.8% |
| 2 | EXXON MOBIL | アメリカ | 1.4% |
| 3 | MICROSOFT CORP | アメリカ | 1.0% |
| 4 | JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 0.9% |
| 5 | GENERAL ELECTRIC CO | アメリカ | 0.9% |
| 6 | WELLS FARGO & CO | アメリカ | 0.8% |

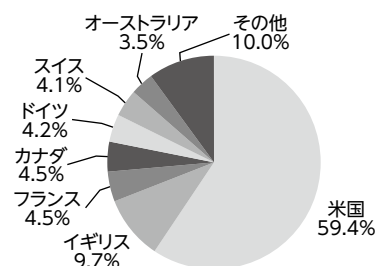
| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|-------|------------------------|------|-------|
| 7 | NESTLE SA - REGISTERED | スイス | 0.8% |
| 8 | CHEVRON CORP | アメリカ | 0.7% |
| 9 | PROCTER & GAMBLE CO | アメリカ | 0.7% |
| 10 | JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 0.7% |
| 組入銘柄数 | | | 1,290 |

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

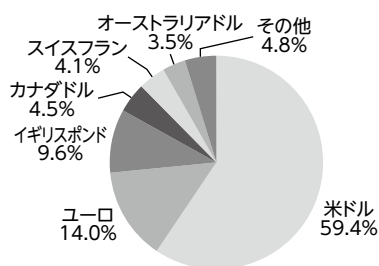
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2014年5月29日現在のものです。

(注2) 1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の決算期のものです。費用項目の概要等については「運用経過の説明 1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

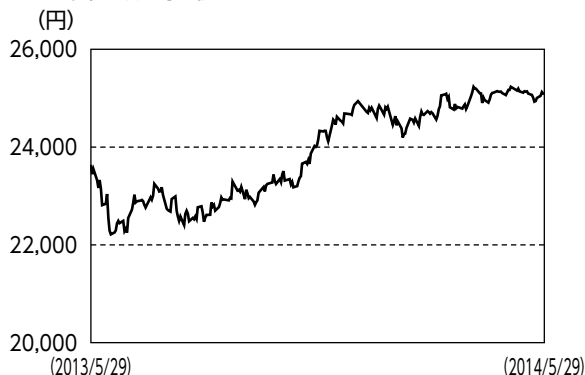
(注3) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

当該投資信託のデータ

3 組入ファンドの概要

外国債券インデックス マザーファンド

○基準価額の推移



○1万口当たりの費用明細

(2013年5月30日~2014年5月29日)

| 項目 | |
|---------------------------|-----------|
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 0円 (0) |
| (b) 保管費用等 | 7 |
| 合計 | 7 |

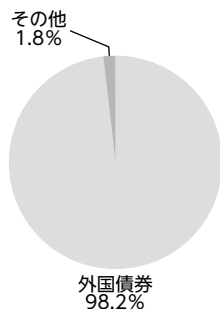
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|----|-------------------|------|------|
| 1 | T 1.375% 11/30/15 | アメリカ | 1.3% |
| 2 | T 0.375% 06/30/15 | アメリカ | 1.0% |
| 3 | T 0.375% 06/15/15 | アメリカ | 0.9% |
| 4 | T 0.25% 04/15/16 | アメリカ | 0.8% |
| 5 | T 0.875% 04/15/17 | アメリカ | 0.7% |
| 6 | T 0.25% 10/15/15 | アメリカ | 0.7% |

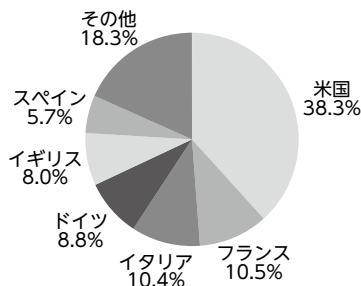
| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|-------|-------------------|------|------|
| 7 | T 1.75% 07/31/15 | アメリカ | 0.7% |
| 8 | T 0.25% 07/15/15 | アメリカ | 0.6% |
| 9 | T 1.875% 06/30/15 | アメリカ | 0.6% |
| 10 | T 0.625% 07/15/16 | アメリカ | 0.6% |
| 組入銘柄数 | | | 556 |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

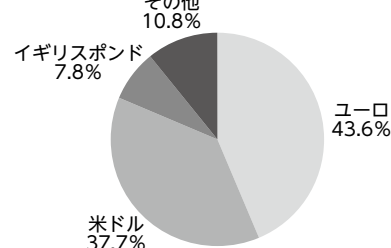
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2014年5月29日現在のものです。

(注2) 1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の決算期のものです。費用項目の概要等については「運用経過の説明 1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

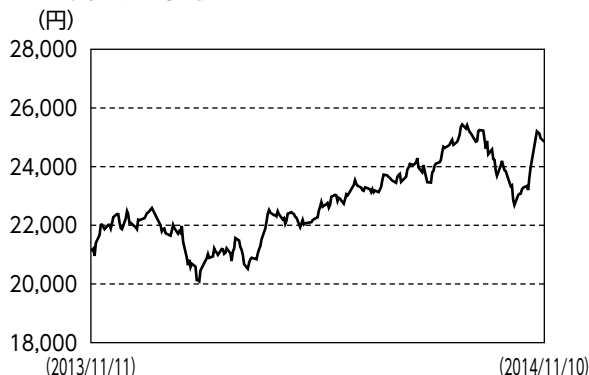
(注3) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

当該投資信託のデータ

3 組入ファンドの概要

新興国株式インデックス マザーファンド

○基準価額の推移



○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|----|------------------------------------|--------|------|
| 1 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 韓国 | 2.8% |
| 2 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台湾 | 2.4% |
| 3 | TENCENT HOLDINGS LTD | ケイマン諸島 | 1.9% |
| 4 | CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R | 香港 | 1.7% |
| 5 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 中国 | 1.2% |

○1万口当たりの費用明細

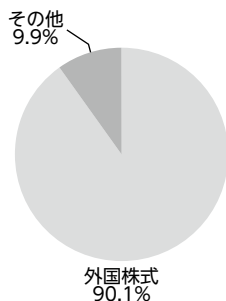
(2013年11月12日~2014年11月10日)

| 項目 | |
|--|----------------------------------|
| (a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション) | 20円 (11) (0) (5) (4) |
| (b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券) | 21 (21) (0) (0) |
| (c) 保管費用等 | 54 |
| 合計 | 95 |

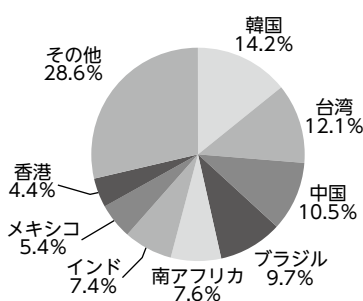
| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|-------|------------------------------|-------|------|
| 6 | NASPERS LTD-N SHS | 南アフリカ | 1.1% |
| 7 | IND&COMM BK OF CHINA-H | 中国 | 1.1% |
| 8 | AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L | メキシコ | 0.9% |
| 9 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA | ブラジル | 0.9% |
| 10 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 台湾 | 0.9% |
| 組入銘柄数 | | | 805 |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

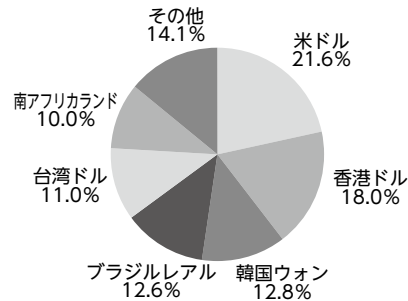
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2014年11月10日現在のものです。

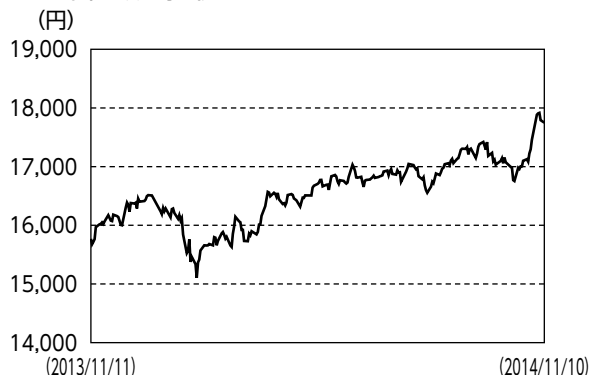
(注2) 1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の決算期のものです。費用項目の概要等については「運用経過の説明 1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

(注3) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

3 組入ファンドの概要

新興国債券インデックス マザーファンド

○基準価額の推移



○1万口当たりの費用明細

(2013年11月12日~2014年11月10日)

| 項目 | |
|-----------|-----|
| (a) 保管費用等 | 24円 |
| 合計 | 24 |

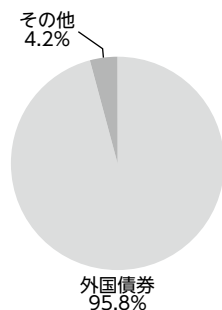
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|----|-----------------------|-------|------|
| 1 | COLOM 4.375% 03/21/23 | コロンビア | 3.1% |
| 2 | COLOM 12% 10/22/15 | コロンビア | 2.0% |
| 3 | SAGB 10.5% 12/21/26 | 南アフリカ | 2.0% |
| 4 | RUSSIA 7.85% 03/10/18 | ロシア | 1.8% |
| 5 | BNTNF 10% 01/01/17 | ブラジル | 1.8% |
| 6 | TURKGB 8.8% 11/14/18 | トルコ | 1.5% |

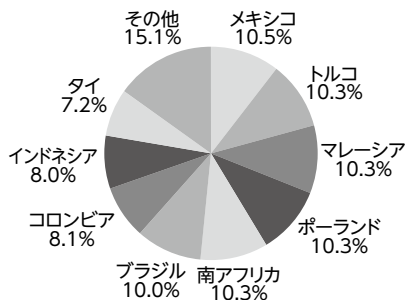
| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|-------|------------------------|-------|------|
| 7 | COLOM 7.75% 04/14/21 | コロンビア | 1.5% |
| 8 | BRAZIL 12.5% 01/05/16 | ブラジル | 1.5% |
| 9 | THAIGB 3.875% 06/13/19 | タイ | 1.3% |
| 10 | TURKGB 7.1% 03/08/23 | トルコ | 1.3% |
| 組入銘柄数 | | | 164 |

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

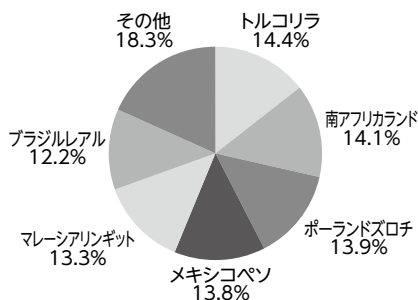
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2014年11月10日現在のものです。

(注2) 1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の決算期のものです。費用項目の概要等については「運用経過の説明 1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

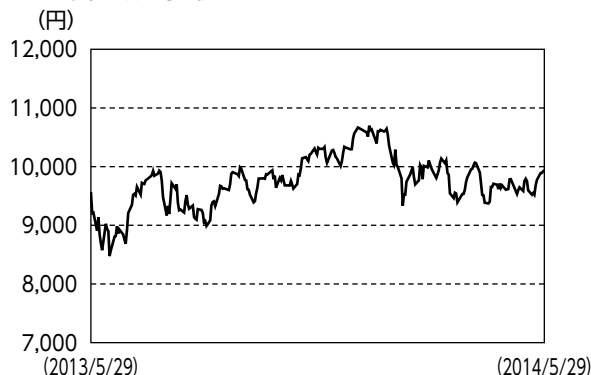
(注3) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

当該投資信託のデータ

3 組入ファンドの概要

国内株式インデックス マザーファンド

○基準価額の推移



○1万口当たりの費用明細

(2013年5月30日~2014年5月29日)

| 項目 | |
|---------------------|-----------|
| (a) 売買委託手数料 (株式) | 0円 (0) |
| (先物・オプション) | (0) |
| 合計 | 0 |

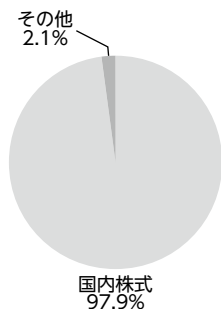
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|----|-------------------|----|------|
| 1 | トヨタ自動車 | 日本 | 4.5% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本 | 2.5% |
| 3 | ソフトバンク | 日本 | 2.0% |
| 4 | 本田技研工業 | 日本 | 1.8% |
| 5 | 三井住友フィナンシャルグループ | 日本 | 1.7% |
| 6 | みずほフィナンシャルグループ | 日本 | 1.4% |

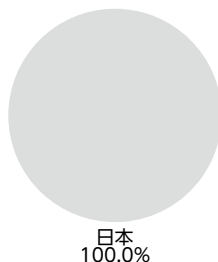
| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|-------|---------|----|-------|
| 7 | 日本電信電話 | 日本 | 1.3% |
| 8 | 日本たばこ産業 | 日本 | 1.2% |
| 9 | ファナック | 日本 | 1.1% |
| 10 | キヤノン | 日本 | 1.1% |
| 組入銘柄数 | | | 1,752 |

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

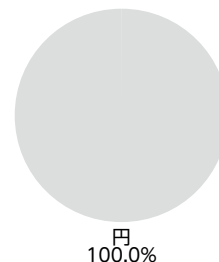
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2014年5月29日現在のものです。

(注2) 1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の決算期のものです。費用項目の概要等については「運用経過の説明 1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

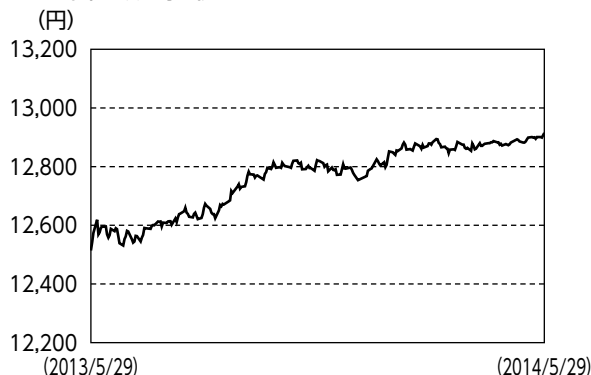
(注3) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

当該投資信託のデータ

3 組入ファンドの概要

国内債券インデックス マザーファンド

○基準価額の推移



○1万口当たりの費用明細

(2013年5月30日～2014年5月29日)

| 項目 | |
|---------------------------|-----------|
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 0円 (0) |
| 合計 | 0 |

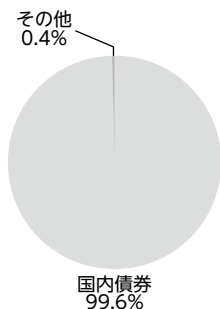
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|----|----------------|----|------|
| 1 | 第113回利付国債(5年) | 日本 | 1.5% |
| 2 | 第332回利付国債(10年) | 日本 | 1.2% |
| 3 | 第116回利付国債(5年) | 日本 | 1.1% |
| 4 | 第105回利付国債(5年) | 日本 | 1.1% |
| 5 | 第328回利付国債(10年) | 日本 | 1.1% |
| 6 | 第97回利付国債(5年) | 日本 | 1.1% |

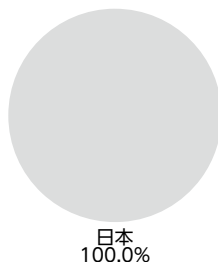
| 順位 | 銘柄名 | 国 | 組入比率 |
|-------|----------------|----|------|
| 7 | 第289回利付国債(10年) | 日本 | 1.0% |
| 8 | 第325回利付国債(10年) | 日本 | 0.9% |
| 9 | 第329回利付国債(10年) | 日本 | 0.9% |
| 10 | 第117回利付国債(5年) | 日本 | 0.9% |
| 組入銘柄数 | | | 748 |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

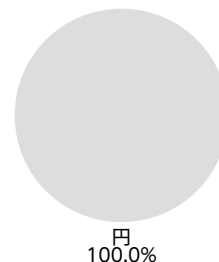
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2014年5月29日現在のものです。

(注2) 1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の決算期のものです。費用項目の概要等については「運用経過の説明 1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

(注3) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。