

【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8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】	SMT 日米インデックスバランス・オープン
【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)当初自己設定額 50万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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29年2月8日に提出した有価証券届出書（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 5月31日現在）

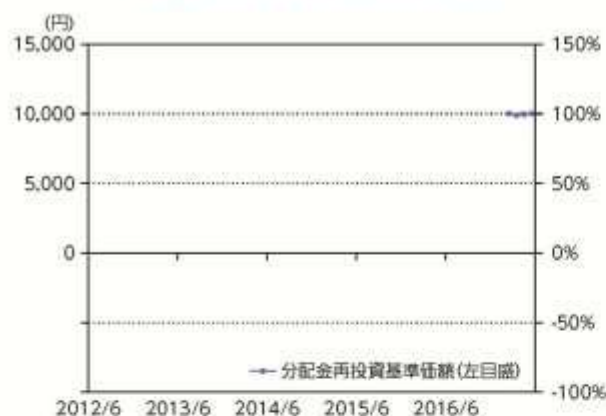
(後略)

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6月～2017年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}

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

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}

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

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

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

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

※5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、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）

<訂正後>

（前略）

上記は、平成29年 5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 5月31日現在の状況について記載してあります。

SMT 日米インデックスバランス・オープン

（1）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	21,160,986	96.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		795,284	3.62
合計(純資産総額)		21,956,270	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	日本株配当貴族インデックスマザーファンド	3,611,807	1.2267	4,430,722	1.2304	4,443,967	20.24
日本	親投資信託受益証券	米国株配当貴族インデックスマザーファンド	3,795,915	1.1455	4,348,291	1.1221	4,259,396	19.40
日本	親投資信託受益証券	米国国債インデックスマザーファンド	4,304,808	1.0012	4,310,192	0.9858	4,243,679	19.33
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	2,926,018	1.3814	4,042,103	1.3829	4,046,390	18.43
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,340,148	1.5783	2,115,169	1.5595	2,089,960	9.52
日本	親投資信託受益証券	米国REITインデックス マザーファンド	2,142,955	0.9866	2,114,387	0.9695	2,077,594	9.46

(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（％）
親投資信託受益証券	96.38
合計	96.38

(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 5月10日）	23,464,711	23,464,711	10,107	10,107
平成29年 2月末日	500,520		10,010	
3月末日	18,167,695		9,899	
4月末日	22,472,486		9,957	
5月末日	21,956,270		10,011	

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29年 2月27日～平成29年 5月10日	0

収益率の推移

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成29年 2月27日～平成29年 5月10日	1.1

(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29年 2月27日～平成29年 5月10日	24,319,189	1,102,254	23,216,935

(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)

日本株配当貴族インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	312,721,930	96.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,203,998	3.46
合計(純資産総額)		323,925,928	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（％）
株価指数先物取引	買建	日本	10,990,000	3.39

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	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	株式	SANKYO	機械	2,700	3,920.77	10,586,100	3,715.00	10,030,500	3.10
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,300	3,807.56	8,757,400	4,161.00	9,570,300	2.95
日本	株式	イオンフィナンシャルサービス	その他金融業	4,100	2,148.20	8,807,638	2,275.00	9,327,500	2.88
日本	株式	中国電力	電気・ガス業	6,900	1,225.20	8,453,915	1,261.00	8,700,900	2.69

日本	株式	サンリオ	卸売業	4,100	2,115.06	8,671,782	2,069.00	8,482,900	2.62
日本	株式	日本取引所グループ	その他金融業	4,700	1,653.72	7,772,500	1,790.00	8,413,000	2.60
日本	株式	北陸電力	電気・ガス業	7,500	1,024.72	7,685,460	1,080.00	8,100,000	2.50
日本	株式	伊藤忠テクノソリューションズ	情報・通信業	2,100	3,604.42	7,569,285	3,775.00	7,927,500	2.45
日本	株式	ローソン	小売業	1,000	7,544.00	7,544,000	7,550.00	7,550,000	2.33
日本	株式	パナホーム	建設業	6,000	1,230.00	7,380,000	1,229.00	7,374,000	2.28
日本	株式	協和エクシオ	建設業	4,000	1,837.04	7,348,187	1,840.00	7,360,000	2.27
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	2,600	2,730.00	7,098,000	2,717.00	7,064,200	2.18
日本	株式	電源開発	電気・ガス業	2,400	2,783.87	6,681,300	2,941.00	7,058,400	2.18
日本	株式	大東建託	建設業	400	17,015.00	6,806,000	17,470.00	6,988,000	2.16
日本	株式	第一興商	卸売業	1,300	4,981.23	6,475,600	5,350.00	6,955,000	2.15
日本	株式	平和	機械	2,800	2,891.82	8,097,100	2,409.00	6,745,200	2.08
日本	株式	りそなホールディングス	銀行業	11,900	607.80	7,232,834	566.70	6,743,730	2.08
日本	株式	ユー・エス・エス	サービス業	3,000	2,034.70	6,104,100	2,229.00	6,687,000	2.06
日本	株式	日清紡ホールディングス	電気機器	6,200	1,179.05	7,310,120	1,047.00	6,491,400	2.00
日本	株式	アズビル	電気機器	1,600	3,974.68	6,359,500	4,035.00	6,456,000	1.99
日本	株式	ファンケル	化学	3,100	1,891.74	5,864,400	2,079.00	6,444,900	1.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,100	3,036.62	6,376,917	3,066.00	6,438,600	1.99
日本	株式	科研製薬	医薬品	1,000	6,868.60	6,868,600	6,380.00	6,380,000	1.97
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,200	5,050.00	6,060,000	5,308.00	6,369,600	1.97
日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	11,000	554.57	6,100,300	575.00	6,325,000	1.95
日本	株式	東京センチュリー	その他金融業	1,500	3,991.13	5,986,700	4,195.00	6,292,500	1.94
日本	株式	阪和興業	卸売業	8,000	819.00	6,552,000	771.00	6,168,000	1.90
日本	株式	ケーズホールディングス	小売業	2,700	2,319.22	6,261,900	2,280.00	6,156,000	1.90
日本	株式	ツムラ	医薬品	1,500	3,835.00	5,752,500	4,045.00	6,067,500	1.87
日本	株式	ユナイテッドアローズ	小売業	1,800	3,512.38	6,322,297	3,345.00	6,021,000	1.86

(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.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	建設業	10.00
		食料品	2.95
		化学	6.37
		医薬品	8.52
		機械	6.90
		電気機器	4.00
		輸送用機器	1.34
		電気・ガス業	10.94
		陸運業	3.28

	情報・通信業	10.31
	卸売業	6.67
	小売業	6.09
	銀行業	6.43
	その他金融業	10.69
	サービス業	2.06
	小計	96.54
合計		96.54

(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または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	7円		11,098,500	10,990,000	3.39

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

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

米国株配当貴族インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	721,116,774	93.17
	アイルランド	31,345,386	4.05
	小計	752,462,160	97.22
投資信託受益証券	アメリカ	6,355,788	0.82
投資証券	アメリカ	13,450,546	1.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,689,645	0.22
合計(純資産総額)		773,958,139	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	買建		1,997,100	0.26
	売建		887,600	0.11

(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	業種	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 （％）
アメリカ	株式	BARD C R INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	527	33,970.23	17,902,315	34,400.92	18,129,289	2.34
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サー ビス	999	16,044.31	16,028,266	16,636.23	16,619,597	2.15
アメリカ	株式	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	食品・飲 料・タバコ	2,881	5,496.79	15,836,261	5,710.00	16,450,515	2.13
アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	1,013	15,252.54	15,450,827	15,624.27	15,827,393	2.04
アメリカ	株式	GENERAL DYNAMICS CORP	資本財	705	21,839.36	15,396,749	22,415.02	15,802,596	2.04
アイルラ ンド	株式	PENTAIR PLC	資本財	2,130	7,511.38	15,999,245	7,395.48	15,752,381	2.04
アメリカ	株式	3 M COMPANY	資本財	696	21,987.21	15,303,100	22,462.74	15,634,069	2.02
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	3,094	4,837.38	14,966,855	5,040.91	15,596,584	2.02
アイルラ ンド	株式	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア 機器・サー ビス	1,656	9,254.67	15,325,744	9,416.06	15,593,005	2.01
アメリカ	株式	DOVER CORP	資本財	1,680	8,832.26	14,838,202	9,252.95	15,544,963	2.01
アメリカ	株式	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	素材	971	16,116.24	15,648,878	15,974.91	15,511,639	2.00
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	1,094	13,689.71	14,976,550	14,104.12	15,429,913	1.99
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活 必需品小売 り	1,778	8,519.68	15,148,000	8,671.52	15,417,970	1.99
アメリカ	株式	ECOLAB INC	素材	1,056	13,960.93	14,742,747	14,597.89	15,415,380	1.99
アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	1,825	7,955.26	14,518,366	8,442.94	15,408,377	1.99
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバコ	1,175	12,532.53	14,725,724	13,094.38	15,385,908	1.99
アメリカ	株式	CONSOLIDATED EDISON INC	公益事業	1,685	8,760.97	14,762,240	9,120.91	15,368,737	1.99
アメリカ	株式	SYSCO CORP	食品・生活 必需品小売 り	2,553	6,089.62	15,546,804	6,014.03	15,353,824	1.98
アメリカ	株式	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	素材	411	37,532.11	15,425,699	37,211.54	15,293,945	1.98
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア 機器・サー ビス	3,061	4,958.26	15,177,254	4,993.19	15,284,185	1.97

アメリカ	株式	ILLINOIS TOOL WORKS	資本財	976	15,417.89	15,047,862	15,656.45	15,280,701	1.97
アメリカ	株式	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	食品・飲料・タバコ	1,327	11,083.80	14,708,205	11,508.77	15,272,139	1.97
アメリカ	株式	FRANKLIN RESOURCES INC	各種金融	3,250	4,804.38	15,614,257	4,617.04	15,005,398	1.94
アメリカ	株式	BECTON DICKINSON & CO	ヘルスケア機器・サービス	719	20,080.47	14,437,865	20,868.24	15,004,270	1.94
アメリカ	株式	CARDINAL HEALTH	ヘルスケア機器・サービス	1,838	8,037.99	14,773,841	8,161.10	15,000,117	1.94
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,046	7,342.22	15,022,189	7,325.57	14,988,135	1.94
アメリカ	株式	CINTAS CORP	商業・専門サービス	1,082	13,497.11	14,603,876	13,842.25	14,977,325	1.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	1,652	9,127.49	15,078,614	8,998.85	14,866,110	1.92
アメリカ	株式	CLOROX COMPANY	家庭用品・パーソナル用品	992	14,706.31	14,588,668	14,971.83	14,852,058	1.92
アメリカ	株式	TARGET (DAYTON HUDSON)	小売	2,433	6,429.80	15,643,717	6,096.14	14,831,914	1.92

(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.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.82
		素材	9.69
		資本財	15.57
		商業・専門サービス	1.94
		耐久消費財・アパレル	3.70
		消費者サービス	2.15
		小売	5.63
		食品・生活必需品小売り	5.80
		食品・飲料・タバコ	11.73
		家庭用品・パーソナル用品	7.69
		ヘルスケア機器・サービス	10.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.93
		各種金融	5.84
		保険	3.81
		ソフトウェア・サービス	1.89
電気通信サービス	1.84		
公益事業	1.99		
		小計	97.22
投資信託受益証券			0.82
投資証券			1.74
合計			99.78

(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または当該業種の時価の比率です。

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	買建	18,000.00	1,997,148	1,997,100	0.26
	アメリカドル	売建	8,000.00	890,628	887,600	0.11

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	249,100,147,000	82.30
	ポーランド	200,418,000	0.07
	小計	249,300,565,000	82.36
地方債証券	日本	17,414,821,907	5.75
特殊債券	日本	22,334,281,501	7.38
社債券	日本	11,041,168,350	3.65
	フランス	500,816,000	0.17
	オーストラリア	401,400,000	0.13
	オランダ	200,074,000	0.07
	スウェーデン	199,663,000	0.07
	イギリス	100,651,000	0.03
小計		12,443,772,350	4.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,185,873,137	0.39
合計(純資産総額)		302,679,313,895	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131回利付国債(5年)	5,530,000,000	101.05	5,588,617,800	101.06	5,588,673,300	0.100	2022/3/20	1.85
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	4,700,000,000	100.61	4,728,826,800	100.58	4,727,495,000	0.100	2027/3/20	1.56
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	3,790,000,000	100.93	3,825,474,400	100.91	3,824,716,400	0.100	2021/3/20	1.26
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	100.58	3,792,054,500	100.58	3,791,979,100	0.200	2018/12/20	1.25
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.81	3,639,385,400	100.79	3,638,735,600	0.100	2020/9/20	1.20
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	100.64	3,542,563,200	100.64	3,542,528,000	0.100	2019/12/20	1.17
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	100.73	3,535,658,100	100.72	3,535,587,900	0.200	2019/6/20	1.17
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,300,000,000	100.66	3,322,077,000	100.66	3,322,011,000	0.200	2019/3/20	1.10
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,200,000,000	103.43	3,309,760,000	103.42	3,309,664,000	0.400	2025/6/20	1.09
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	100.99	3,231,872,000	100.99	3,231,808,000	0.100	2021/9/20	1.07
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	100.70	3,162,074,200	100.70	3,162,042,800	0.100	2020/3/20	1.04
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	100.87	2,985,900,000	100.85	2,985,337,600	0.100	2020/12/20	0.99
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,760,000,000	103.45	2,855,247,600	103.44	2,855,192,400	0.400	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,770,000,000	102.61	2,842,297,000	102.60	2,842,269,300	0.300	2025/12/20	0.94
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	2,600,000,000	100.83	2,621,710,000	100.83	2,621,710,000	0.100	2026/3/20	0.87
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	100.81	2,580,736,000	100.80	2,580,684,800	0.200	2019/9/20	0.85
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,530,000,000	100.81	2,550,594,200	100.81	2,550,568,900	0.100	2026/6/20	0.84
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,390,000,000	104.75	2,503,525,000	104.74	2,503,429,400	0.600	2024/6/20	0.83
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	2,450,000,000	100.48	2,461,858,000	100.48	2,461,809,000	0.200	2018/9/20	0.81
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	104.82	2,400,584,100	104.79	2,399,828,400	0.800	2022/9/20	0.79
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,290,000,000	104.07	2,383,225,900	104.06	2,383,157,200	0.500	2024/9/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	105.45	2,372,625,000	105.41	2,371,792,500	0.800	2023/6/20	0.78
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,230,000,000	104.51	2,330,706,800	104.47	2,329,837,100	0.600	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	102.18	2,145,780,000	102.17	2,145,591,000	1.500	2018/9/20	0.71
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	2,110,000,000	100.66	2,124,073,700	100.66	2,124,052,600	0.100	2026/12/20	0.70
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1,910,000,000	103.72	1,981,052,000	103.71	1,980,899,200	1.300	2019/12/20	0.65
日本	国債証券	第377回利付国債(2年)	1,970,000,000	100.52	1,980,362,200	100.53	1,980,460,700	0.100	2019/6/15	0.65
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	100.75	1,964,644,500	100.73	1,964,313,000	0.100	2020/6/20	0.65
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,800,000,000	103.40	1,861,254,000	103.40	1,861,218,000	0.400	2025/3/20	0.61
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	1,720,000,000	104.08	1,790,262,000	104.05	1,789,677,200	0.600	2023/3/20	0.59

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	82.36
地方債証券	5.75
特殊債券	7.38
社債券	4.11
合計	99.61

(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。

米国国債インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	199,142,577	97.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,779,874	2.82
合計(純資産総額)		204,922,451	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(%)
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	30,000	11,064.08	3,319,224	11,228.03	3,368,410	2.250	2024/11/15	1.64
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	30,000	10,777.32	3,233,196	10,976.28	3,292,884	2.000	2025/8/15	1.61
アメリカ	国債証券	T 3.125% 02/15/43	20,000	11,354.14	2,270,829	11,634.01	2,326,802	3.125	2043/2/15	1.14
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	20,000	11,495.28	2,299,057	11,624.00	2,324,800	2.750	2024/2/15	1.13

アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	20,000	11,176.33	2,235,267	11,340.07	2,268,015	2.375	2024/8/15	1.11
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	20,000	10,972.16	2,194,433	11,171.90	2,234,380	2.250	2025/11/15	1.09
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	20,000	11,159.47	2,231,894	11,140.84	2,228,169	1.500	2019/1/31	1.09
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	20,000	10,927.67	2,185,535	11,049.91	2,209,983	1.750	2022/9/30	1.08
アメリカ	国債証券	T 1% 03/15/19	20,000	11,042.68	2,208,536	11,043.98	2,208,796	1.000	2019/3/15	1.08
アメリカ	国債証券	T 1.375% 05/31/21	20,000	10,900.82	2,180,164	10,979.58	2,195,916	1.375	2021/5/31	1.07
アメリカ	国債証券	T 1.125% 07/31/21	20,000	10,764.89	2,152,980	10,851.99	2,170,398	1.125	2021/7/31	1.06
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	20,000	10,374.09	2,074,819	10,588.03	2,117,607	1.625	2026/5/15	1.03
アメリカ	国債証券	T 6.25% 05/15/30	10,000	15,754.88	1,575,488	15,946.25	1,594,625	6.250	2030/5/15	0.78
アメリカ	国債証券	T 4.75% 02/15/41	10,000	14,661.70	1,466,170	14,903.95	1,490,395	4.750	2041/2/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 5.5% 08/15/28	10,000	14,406.05	1,440,605	14,610.26	1,461,026	5.500	2028/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/40	10,000	14,282.55	1,428,255	14,604.64	1,460,464	4.625	2040/2/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 4.5% 02/15/36	10,000	14,116.22	1,411,622	14,345.51	1,434,551	4.500	2036/2/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 4.375% 05/15/41	10,000	13,844.59	1,384,459	14,164.28	1,416,428	4.375	2041/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 4.375% 02/15/38	10,000	13,889.63	1,388,963	14,156.86	1,415,686	4.375	2038/2/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/15/39	10,000	13,810.42	1,381,042	14,112.74	1,411,274	4.375	2039/11/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 3.75% 11/15/43	10,000	12,675.74	1,267,574	12,953.77	1,295,377	3.750	2043/11/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	10,000	12,396.78	1,239,678	12,696.52	1,269,652	3.625	2044/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 3.625% 08/15/43	10,000	12,400.45	1,240,045	12,677.35	1,267,735	3.625	2043/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/44	10,000	11,874.05	1,187,405	12,169.10	1,216,910	3.375	2044/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	10,000	11,910.78	1,191,078	11,910.50	1,191,050	3.625	2021/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	10,000	11,777.85	1,177,785	11,756.79	1,175,679	3.500	2020/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	10,000	11,792.16	1,179,216	11,752.56	1,175,256	3.625	2020/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	10,000	11,700.40	1,170,040	11,727.85	1,172,785	3.125	2021/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/41	10,000	11,373.18	1,137,318	11,678.44	1,167,844	3.125	2041/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 3.625% 08/15/19	10,000	11,716.04	1,171,604	11,652.46	1,165,246	3.625	2019/8/15	0.57

(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	97.18
合計	97.18

(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。

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	67,584,078,800	98.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,361,456,012	1.97
合計(純資産総額)		68,945,534,812	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(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	1,351,590,500	1.96

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	8,376	596,242.75	4,994,129,294	590,000	4,941,840,000	7.17
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,176	584,271.22	4,777,001,553	582,000	4,758,432,000	6.90
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	24,815	167,652.41	4,160,294,769	166,600	4,134,179,000	6.00
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	16,640	228,737.4	3,806,190,442	215,300	3,582,592,000	5.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	19,077	171,981.71	3,280,895,105	163,000	3,109,551,000	4.51
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	16,688	173,165.73	2,889,789,712	175,400	2,927,075,200	4.25
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	8,896	285,187.47	2,537,027,754	285,200	2,537,139,200	3.68
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	10,118	239,406.95	2,422,319,549	240,700	2,435,402,600	3.53
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,008	290,506.26	2,326,374,187	293,800	2,352,750,400	3.41
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,461	445,516.84	2,432,967,496	423,500	2,312,733,500	3.35
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	3,738	500,511.11	1,870,910,530	511,000	1,910,118,000	2.77
日本	投資証券	GLP投資法人	15,143	129,462.58	1,960,451,924	124,900	1,891,360,700	2.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	23,490	75,160.04	1,765,509,510	80,300	1,886,247,000	2.74
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,528	614,977.66	1,554,663,535	617,000	1,559,776,000	2.26
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	2,942	478,364.3	1,407,347,794	484,500	1,425,399,000	2.07
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,874	467,004.03	1,342,169,593	491,500	1,412,571,000	2.05

日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	9,292	145,635.59	1,353,245,921	141,300	1,312,959,600	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,495	224,354.36	1,232,827,222	238,200	1,308,909,000	1.90
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,350	526,232.1	1,236,645,452	500,000	1,175,000,000	1.70
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	6,182	163,354.07	1,009,854,894	179,600	1,110,287,200	1.61
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,865	577,157.31	1,076,398,392	564,000	1,051,860,000	1.53
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	7,745	141,818.17	1,098,381,738	131,300	1,016,918,500	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	5,546	178,912.56	992,249,106	183,200	1,016,027,200	1.47
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	19,286	53,294.93	1,027,846,068	52,100	1,004,800,600	1.46
日本	投資証券	プレミアム投資法人	7,813	132,584.05	1,035,879,243	119,000	929,747,000	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	7,589	124,928.44	948,081,986	121,800	924,340,200	1.34
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	9,729	77,231.41	751,384,416	82,700	804,588,300	1.17
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	5,799	136,290.1	790,346,323	137,800	799,102,200	1.16
日本	投資証券	積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	6,558	117,693.46	771,833,736	120,600	790,894,800	1.15
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,155	243,209.91	767,327,295	245,100	773,290,500	1.12

(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(%)
投資証券	98.03
合計	98.03

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	773円		1,383,268,040	1,351,590,500	1.96

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

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

米国REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

投資信託受益証券	アメリカ	6,379,978	3.30
投資証券	アメリカ	186,041,126	96.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,091,364	0.56
合計(純資産総額)		193,512,468	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	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	693	21,779.46	15,093,172	17,196.58	11,917,230	6.16
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	331	24,011.32	7,947,750	23,784.27	7,872,595	4.07
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	1,184	5,796.21	6,862,722	6,194.89	7,334,758	3.79
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	814	7,825.71	6,370,136	8,044.59	6,548,304	3.38
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	308	18,949.09	5,836,321	21,228.86	6,538,491	3.38
アメリカ	投資信託受益証券	VANGUARD REIT ETF	700	9,110.60	6,377,426	9,114.25	6,379,978	3.30
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	824	6,821.69	5,621,074	7,246.79	5,971,361	3.09
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	798	7,505.52	5,989,412	7,383.27	5,891,856	3.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	363	10,843.84	3,936,317	13,093.28	4,752,861	2.46
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	332	14,122.98	4,688,832	13,406.18	4,450,854	2.30
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	143	23,142.92	3,309,438	28,315.88	4,049,171	2.09
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	391	10,880.93	4,254,444	10,224.96	3,997,961	2.07
アメリカ	投資証券	HCP INC	1,019	3,725.90	3,796,701	3,464.17	3,529,990	1.82
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	548	6,939.43	3,802,812	6,102.79	3,344,334	1.73
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	1,677	1,744.29	2,925,177	1,980.63	3,321,527	1.72
アメリカ	投資証券	GGP INC	1,274	2,919.35	3,719,261	2,463.31	3,138,259	1.62
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	240	10,169.31	2,440,636	11,212.50	2,691,002	1.39
アメリカ	投資証券	UDR INC	618	3,753.77	2,319,835	4,254.20	2,629,100	1.36
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	231	11,728.47	2,709,277	11,231.37	2,594,447	1.34
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	804	2,888.28	2,322,185	3,163.47	2,543,430	1.31
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	280	8,465.13	2,370,238	8,562.78	2,397,579	1.24
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	174	11,681.86	2,032,645	12,982.32	2,258,924	1.17
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	161	16,395.45	2,639,668	13,739.06	2,211,990	1.14
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	321	7,938.81	2,548,359	6,734.16	2,161,666	1.12
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	551	3,800.37	2,094,009	3,888.03	2,142,309	1.11
アメリカ	投資証券	VEREIT INC	2,102	1,081.85	2,274,069	914.31	1,921,880	0.99
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	205	8,709.24	1,785,396	9,227.43	1,891,624	0.98
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	293	8,308.44	2,434,373	6,385.74	1,871,024	0.97
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	922	3,112.42	2,869,659	1,940.69	1,789,317	0.92
アメリカ	投資証券	APARTMENT INVEST & MGMT	374	4,807.89	1,798,154	4,762.40	1,781,139	0.92

(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（％）
投資信託受益証券	3.30
投資証券	96.14
合計	99.44

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2017年2月27日

作成基準日：2017年5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5月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-

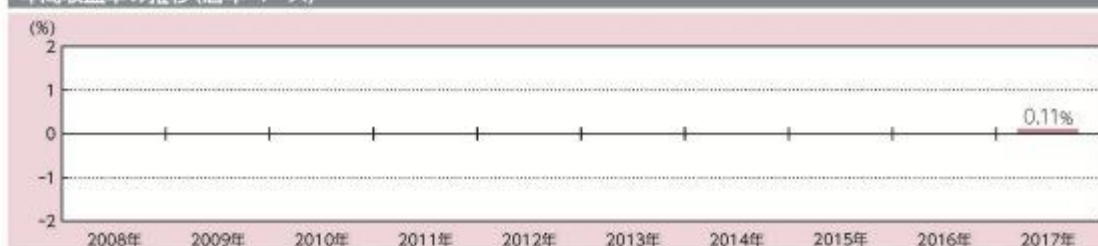
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株投資インデックスマザーファンド	20.2%	SANKYO	日本	株式	機械	-	-	0.6%
		日本たばこ産業	日本	株式	食品	-	-	0.6%
米留株投資インデックスマザーファンド	19.4%	BARD C R INC	アメリカ	株式	ヘルスケア機器・サービス	-	-	0.5%
		MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	消費者サービス	-	-	0.4%
米国国債インデックスマザーファンド	19.3%	T 2.25% 11/15/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/11/15	0.3%
		T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.3%
国内債券インデックスマザーファンド	18.4%	第131回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.3%
		第346回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2027/03/20	0.3%
J-REITインデックスマザーファンド	9.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
米国REITインデックスマザーファンド	9.5%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%

※投資比率及び実質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)



※2017年は当初設定日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29年 2月27日から平成29年 5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

SMT 日米インデックスバランス・オープン

(1) 貸借対照表

(単位：円)

		第1期 (平成29年 5月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		938,977
親投資信託受益証券		22,658,539
未収入金		16,186
流動資産合計		23,613,702
資産合計		23,613,702
負債の部		
流動負債		
未払解約金		132,870
未払受託者報酬		1,602
未払委託者報酬		14,382
未払利息		1
その他未払費用		136
流動負債合計		148,991
負債合計		148,991
純資産の部		
元本等		
元本		23,216,935
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		247,776
(分配準備積立金)		348,980
元本等合計		23,464,711
純資産合計		23,464,711
負債純資産合計		23,613,702

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

		第1期 自 平成29年 2月27日 至 平成29年 5月10日
営業収益		
有価証券売買等損益		353,302
営業収益合計		353,302
営業費用		

	第1期 自 平成29年 2月27日 至 平成29年 5月10日
支払利息	57
受託者報酬	1,602
委託者報酬	14,382
その他費用	136
営業費用合計	16,177
営業利益又は営業損失（ ）	337,125
経常利益又は経常損失（ ）	337,125
当期純利益又は当期純損失（ ）	337,125
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（ ）	11,855
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	3,001
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,001
剰余金減少額又は欠損金増加額	104,205
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	104,205
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	247,776

(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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月11日から11月10日まで、及び11月11日から翌年5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29年 2月27日から平成29年 5月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成29年 5月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,216,935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 1.0107円 (1万口当たり純資産額) (10,107円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期

自 平成29年 2月27日

至 平成29年 5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	96,682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	252,298円
収益調整金額	C	73,125円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	422,105円
当ファンドの期末残存口数	F	23,216,935口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	181円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 平成29年 2月27日 至 平成29年 5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (平成29年 5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29年 2月27日 至 平成29年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	23,819,189円
期中一部解約元本額	1,102,254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 5月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	360,589
合計	360,589

(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
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,423,546	2,247,494	
	国内債券インデックス マザーファンド	3,106,018	4,290,963	
	米国REITインデックス マザーファンド	2,275,102	2,245,070	
	日本株配当貴族インデックスマザーファンド	3,824,573	4,691,221	
	米国株配当貴族インデックスマザーファンド	4,024,183	4,611,713	
	米国国債インデックスマザーファンド	4,564,775	4,572,078	
合計		19,218,197	22,658,539	

(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。

日本株配当貴族インデックスマザーファンド

貸借対照表

	平成29年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,736,186
株式	313,195,200
派生商品評価勘定	322,397
未収入金	1,106,950
未収配当金	4,070,290
差入委託証拠金	395,500
流動資産合計	327,826,523
資産合計	327,826,523
負債の部	
流動負債	
前受金	323,000
未払金	1,688,840
未払解約金	1,247,829
未払利息	13
その他未払費用	21
流動負債合計	3,259,703
負債合計	3,259,703
純資産の部	
元本等	
元本	264,610,583
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,956,237
元本等合計	324,566,820
純資産合計	324,566,820
負債純資産合計	327,826,523

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 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

平成29年 5月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 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 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	264,610,583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 1.2266円 (1万口当たり純資産額) (12,266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 5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、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、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>

	平成29年 5月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 5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ぬ。
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つた場合、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 5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 2月27日
期首元本額	247,604,959円
期中追加設定元本額	63,821,643円
期中一部解約元本額	46,816,019円
期末元本額	264,610,583円
期末元本額の内訳	
SMT 日本株配当貴族インデックス・オープン	260,786,010円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	3,824,573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 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	23,893,533
合計	23,893,533

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株配当貴族インデックスマザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成29年 5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	株価指数先物取引				
	買建	10,776,103	-	11,098,500	322,397
合計		10,776,103	-	11,098,500	322,397

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
コムシスホールディングス	2,300	2,263.00	5,204,900	
大東建託	400	17,015.00	6,806,000	
パナホーム	6,000	1,230.00	7,380,000	
きんでん	3,100	1,765.00	5,471,500	
協和エクシオ	4,100	1,835.00	7,523,500	
日本たばこ産業	2,300	3,791.00	8,719,300	
カネカ	5,000	907.00	4,535,000	
ダイセル	4,100	1,310.00	5,371,000	
日本化薬	3,000	1,546.00	4,638,000	
ファンケル	3,200	1,886.00	6,035,200	
田辺三菱製薬	2,400	2,506.00	6,014,400	
科研製薬	1,000	6,890.00	6,890,000	
エーザイ	900	5,994.00	5,394,600	
ツムラ	1,600	3,835.00	6,136,000	
キッセイ薬品工業	1,400	2,842.00	3,978,800	
栗田工業	1,900	3,020.00	5,738,000	
平和	2,800	2,908.00	8,142,400	
SANKYO	2,700	3,925.00	10,597,500	
日清紡ホールディングス	6,200	1,186.00	7,353,200	
アズビル	1,600	3,975.00	6,360,000	
ユニプレス	1,700	2,469.00	4,197,300	
中国電力	6,900	1,223.00	8,438,700	
北陸電力	7,500	1,021.00	7,657,500	
電源開発	2,400	2,776.00	6,662,400	
東京瓦斯	11,000	551.50	6,066,500	
大阪瓦斯	12,000	422.90	5,074,800	
日本通運	7,000	658.00	4,606,000	
セイノーホールディングス	4,200	1,353.00	5,682,600	
伊藤忠テクノソリューションズ	2,100	3,605.00	7,570,500	
日本電信電話	1,200	5,050.00	6,060,000	
KDDI	2,100	3,036.00	6,375,600	
光通信	500	10,880.00	5,440,000	
NTTドコモ	2,700	2,730.00	7,371,000	
第一興商	1,300	4,975.00	6,467,500	
阪和興業	8,000	819.00	6,552,000	

サンリオ	4,100	2,117.00	8,679,700	
ローソン	1,000	7,550.00	7,550,000	
ユニテッドアローズ	1,800	3,520.00	6,336,000	
ケーズホールディングス	2,700	2,320.00	6,264,000	
りそなホールディングス	12,000	610.10	7,321,200	
千葉銀行	7,000	772.00	5,404,000	
静岡銀行	5,000	963.00	4,815,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	2,800	1,839.00	5,149,200	
芙蓉総合リース	900	5,300.00	4,770,000	
東京センチュリー	1,500	3,995.00	5,992,500	
イオンフィナンシャルサービス	4,100	2,142.00	8,782,200	
三菱UFJリース	9,300	603.00	5,607,900	
日本取引所グループ	4,800	1,651.00	7,924,800	
ユー・エス・エス	3,000	2,029.00	6,087,000	
合 計	186,600		313,195,200	

(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

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。

米国株配当貴族インデックスマザーファンド

貸借対照表

	平成29年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,978,243
コール・ローン	649,106
株式	736,744,826
投資信託受益証券	16,227,896
投資証券	13,927,964
未収配当金	743,874
流動資産合計	778,271,909
資産合計	778,271,909
負債の部	
流動負債	

項目	平成29年 5月10日現在
	金額（円）
派生商品評価勘定	103
未払金	13,016,475
未払解約金	3,270
未払利息	1
その他未払費用	9
流動負債合計	13,019,858
負債合計	13,019,858
純資産の部	
元本等	
元本	667,755,856
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	97,496,195
元本等合計	765,252,051
純資産合計	765,252,051
負債純資産合計	778,271,909

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 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.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。</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>

平成29年 5月10日現在	
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>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>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> <p>(2) 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 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	667,755,856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 1.1460円 (1万口当たり純資産額) (11,460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 5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 5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、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 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 5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 2月27日
期首元本額	595,205,732円
期中追加設定元本額	132,335,938円
期中一部解約元本額	59,785,814円
期末元本額	667,755,856円
期末元本額の内訳	
SMT 米国株配当貴族インデックス・オープン	663,731,673円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	4,024,183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 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	29,881,457
投資信託受益証券	3,985
投資証券	800,104
合計	29,077,368

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株配当貴族インデックスマザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成29年 5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 買建	5,351,053	-	5,350,950	103
	アメリカドル	5,351,053	-	5,350,950	103
合計		5,351,053	-	5,350,950	103

(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

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	CHEVRON CORP	1,217	105.08	127,882.36	
	EXXON MOBIL	1,581	82.31	130,132.11	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	929	145.30	134,983.70	
	ECOLAB INC	1,019	125.61	127,996.59	
	NUCOR CORP	2,127	58.80	125,067.60	
	PPG INDUSTRIES INC	1,218	107.85	131,361.30	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	393	338.38	132,983.34	
	3 M COMPANY	666	197.96	131,841.36	
	DOVER CORP	1,609	79.43	127,802.87	
	EMERSON ELECTRIC CO	2,097	58.85	123,408.45	
	GENERAL DYNAMICS CORP	675	196.59	132,698.25	
	GRAINGER (WW) INC	654	187.77	122,801.58	
	ILLINOIS TOOL WORKS	976	138.95	135,615.20	
	PENTAIR PLC	2,058	67.73	139,388.34	
	STANLEY BLACK&DECKER	928	138.85	128,852.80	
	CINTAS CORP	1,036	121.50	125,874.00	
	LEGGETT & PLATT INC	2,432	53.49	130,087.68	
	VF CORP	2,353	55.58	130,779.74	
	MCDONALD'S CORP	957	144.36	138,152.52	
	GENUINE PARTS CO	1,371	92.83	127,269.93	
LOWES COMPANIES	1,529	85.85	131,264.65		

TARGET (DAYTON HUDSON)	2,329	58.08	135,268.32	
SYSCO CORP	2,445	54.91	134,254.95	
WAL-MART STORES	1,703	76.72	130,654.16	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,526	85.98	131,205.48	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,775	42.36	117,549.00	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,703	49.41	133,555.23	
COCA-COLA CO	2,958	43.51	128,702.58	
HORMEL FOODS CORP	3,679	34.58	127,219.82	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,271	99.72	126,744.12	
PEPSICO INC	1,125	112.72	126,810.00	
CLOROX COMPANY	950	132.43	125,808.50	
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,748	71.50	124,982.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	982	128.21	125,902.22	
PROCTER & GAMBLE CO	1,411	86.40	121,910.40	
ABBOTT LABORATORIES	2,932	44.67	130,972.44	
BARD C R INC	504	305.97	154,208.88	
BECTON DICKINSON & CO	689	180.66	124,474.74	
CARDINAL HEALTH	1,760	72.39	127,406.40	
MEDTRONIC PLC	1,586	83.34	132,177.24	
ABBVIE INC	2,046	66.17	135,383.82	
JOHNSON & JOHNSON	1,048	123.21	129,124.08	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,011	43.43	130,767.73	
PRICE T ROWE GROUP INC	1,778	71.52	127,162.56	
S&P GLOBAL INC	970	137.31	133,190.70	
AFLAC	1,775	73.86	131,101.50	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,768	68.99	121,974.32	
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,201	97.08	116,593.08	
AT&T INC	3,196	38.22	122,151.12	
CONSOLIDATED EDISON INC	1,613	78.81	127,120.53	
アメリカドル 小計	81,307		6,470,620.29 (736,744,826)	
合 計	81,307		736,744,826 (736,744,826)	

(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
投資信託受益証券	アメリカドル	PROSHARES S&P 500 DIVIDEND A	2,500	142,525.00	
		アメリカドル 小計	2,500	142,525.00 (16,227,896)	
投資信託受益証券合計			2,500	16,227,896 (16,227,896)	

投資証券	アメリカドル	FEDERAL REALTY INVS TRUST	937	122,325.35	
	アメリカドル 小計		937	122,325.35 (13,927,964)	
投資証券合計			937	13,927,964 (13,927,964)	
合計				30,155,860 (30,155,860)	

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	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 50銘柄	96.1%			96.1%
	投資信託受 1銘柄 益証券		2.1%		2.1%
	投資証券 1銘柄			1.8%	1.8%

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成29年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	583,004,305
国債証券	245,674,164,750
地方債証券	16,991,590,242
特殊債証券	22,339,611,758
社債証券	12,450,289,110
未収入金	307,015,900
未収利息	656,439,528

	平成29年 5月10日現在
項目	金額（円）
前払費用	9,715,487
流動資産合計	299,011,831,080
資産合計	299,011,831,080
負債の部	
流動負債	
未払金	60,367,200
未払解約金	460,357,761
未払利息	906
その他未払費用	5,247
流動負債合計	520,731,114
負債合計	520,731,114
純資産の部	
元本等	
元本	216,063,047,401
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,428,052,565
元本等合計	298,491,099,966
純資産合計	298,491,099,966
負債純資産合計	299,011,831,080

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 5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、地方債証券、特殊債券、社債券 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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	216,063,047,401口

平成29年 5月10日現在	
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 104,897,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3815円 (1万口当たり純資産額) (13,815円)

(注) 担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成29年 5月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 5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。

	平成29年 5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>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 5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 2月27日
期首元本額	216,616,249,632円
期中追加設定元本額	9,792,859,700円
期中一部解約元本額	10,346,061,931円
期末元本額	216,063,047,401円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,980,122,358円
S B I 資産設計オープン（分配型）	22,388,450円
S M T 国内債券インデックス・オープン	9,196,599,799円
世界経済インデックスファンド	790,704,141円
D C マイセレクション 2 5	15,747,291,995円
D C マイセレクション 5 0	18,229,765,901円
D C マイセレクション 7 5	4,953,964,932円
D C 日本債券インデックス・オープン	448,779,563円

区分	平成29年 5月10日現在
D C日本債券インデックス・オープンS	69,197,004,072円
D C日本債券インデックス・オープンP	30,915,416,644円
D CマイセレクションS 2 5	6,433,063,131円
D CマイセレクションS 5 0	7,192,304,520円
D CマイセレクションS 7 5	1,391,943,085円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	1,271,581,805円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	886,435,255円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	259,035,725円
D C世界経済インデックスファンド	865,890,647円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	191,805,880円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,329,705円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	104,648,926円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	18,012,890円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	929,660円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	398,747,460円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	585,675,138円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	104,991,528円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	238,140,619円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	6,298,958,280円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,231,649,591円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,682,122,753円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	1,066,651,663円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	523,630,640円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,666,883,091円
グローバルバランスファンドV A 3 5（適格機関投資家専用）	1,596,667,834円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,826,533,196円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,584,506,810円
国内バランス2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	190,713,407円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,686,337,684円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,987,747,107円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	28,098,952円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	352,769,369円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	59,653,783円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,983,312円
S M T インデックスバランス・オープン	85,569,811円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	3,106,018円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	6,719,663,031円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

平成29年 5月10日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	7,508,598,450
地方債証券	298,771,946
特殊債券	314,437,526
社債券	135,713,920
合計	8,257,521,842

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

(デリバティブ取引に関する注記)

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365回利付国債(2年)	400,000,000	401,268,000	
	第366回利付国債(2年)	1,110,000,000	1,113,785,100	
	第367回利付国債(2年)	1,280,000,000	1,284,684,800	
	第368回利付国債(2年)	650,000,000	652,496,000	
	第369回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,064,399,000	
	第370回利付国債(2年)	1,340,000,000	1,345,882,600	
	第371回利付国債(2年)	760,000,000	763,518,800	
	第372回利付国債(2年)	920,000,000	924,489,600	
	第373回利付国債(2年)	140,000,000	140,718,200	
	第374回利付国債(2年)	760,000,000	764,066,000	
	第375回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,226,710,000	
	第376回利付国債(2年)	60,000,000	60,343,200	
	第112回利付国債(5年)	900,000,000	905,931,000	
	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	4,414,101,100	
	第114回利付国債(5年)	810,000,000	815,402,700	
	第115回利付国債(5年)	2,450,000,000	2,463,009,500	
	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	3,794,014,900	
	第117回利付国債(5年)	3,300,000,000	3,323,925,000	
第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,537,448,200		

第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,005,700,000	
第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,582,118,400	
第121回利付国債(5年)	630,000,000	633,950,100	
第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,544,428,800	
第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,163,864,000	
第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,965,814,500	
第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,641,082,100	
第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,987,380,000	
第127回利付国債(5年)	3,790,000,000	3,826,725,100	
第128回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,313,156,000	
第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,233,664,000	
第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,375,776,000	
第131回利付国債(5年)	3,350,000,000	3,387,620,500	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	213,351,000	
第2回利付国債(40年)	420,000,000	577,327,800	
第3回利付国債(40年)	420,000,000	579,763,800	
第4回利付国債(40年)	630,000,000	873,098,100	
第5回利付国債(40年)	490,000,000	652,033,200	
第6回利付国債(40年)	390,000,000	508,111,500	
第7回利付国債(40年)	630,000,000	783,575,100	
第8回利付国債(40年)	670,000,000	770,017,600	
第9回利付国債(40年)	970,000,000	799,309,100	
第293回利付国債(10年)	190,000,000	194,193,300	
第294回利付国債(10年)	180,000,000	183,772,800	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	101,874,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,148,195,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	574,408,800	
第298回利付国債(10年)	550,000,000	563,260,500	
第299回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,274,261,200	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	856,028,800	
第301回利付国債(10年)	340,000,000	352,005,400	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	206,616,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,441,513,400	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	496,651,200	
第305回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,983,286,700	
第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,222,158,600	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	729,204,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,034,965,800	
第309回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,673,063,700	
第310回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,132,313,800	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	629,562,700	
第312回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,751,779,900	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	240,000,000	253,442,400	

第314回利付国債(10年)	310,000,000	324,960,600
第315回利付国債(10年)	900,000,000	949,815,000
第316回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,145,818,900
第317回利付国債(10年)	410,000,000	432,201,500
第318回利付国債(10年)	650,000,000	682,344,000
第319回利付国債(10年)	680,000,000	718,773,600
第320回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,178,665,600
第321回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,614,058,200
第322回利付国債(10年)	750,000,000	787,545,000
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,020,837,700
第324回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,340,505,600
第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,402,965,700
第326回利付国債(10年)	600,000,000	627,420,000
第327回利付国債(10年)	740,000,000	777,999,000
第328回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,791,431,600
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,374,402,500
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,522,440,000
第331回利付国債(10年)	680,000,000	710,232,800
第332回利付国債(10年)	2,230,000,000	2,332,267,800
第333回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,183,369,900
第334回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,505,245,800
第335回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,384,783,100
第336回利付国債(10年)	610,000,000	635,376,000
第337回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,385,545,500
第338回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,861,668,000
第339回利付国債(10年)	2,680,000,000	2,772,513,600
第340回利付国債(10年)	2,760,000,000	2,857,041,600
第341回利付国債(10年)	2,710,000,000	2,782,357,000
第342回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,623,010,000
第343回利付国債(10年)	2,720,000,000	2,742,249,600
第344回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,511,205,000
第345回利付国債(10年)	2,110,000,000	2,125,149,800
第346回利付国債(10年)	3,180,000,000	3,200,288,400
第1回利付国債(30年)	40,000,000	52,829,600
第2回利付国債(30年)	160,000,000	204,622,400
第3回利付国債(30年)	120,000,000	152,271,600
第4回利付国債(30年)	110,000,000	149,015,900
第5回利付国債(30年)	50,000,000	63,380,000
第6回利付国債(30年)	190,000,000	247,085,500
第7回利付国債(30年)	180,000,000	232,246,800
第8回利付国債(30年)	50,000,000	60,904,000
第9回利付国債(30年)	240,000,000	278,116,800
第10回利付国債(30年)	160,000,000	177,891,200
第11回利付国債(30年)	90,000,000	108,441,900

第12回利付国債(30年)	190,000,000	240,887,700	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	363,677,400	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	395,991,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	454,682,000	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	495,718,600	
第17回利付国債(30年)	330,000,000	437,127,900	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	451,601,550	
第19回利付国債(30年)	280,000,000	366,724,400	
第20回利付国債(30年)	420,000,000	565,525,800	
第21回利付国債(30年)	270,000,000	354,547,800	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	539,700,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	580,998,800	
第24回利付国債(30年)	260,000,000	351,470,600	
第25回利付国債(30年)	290,000,000	381,851,700	
第26回利付国債(30年)	410,000,000	548,223,300	
第27回利付国債(30年)	600,000,000	815,706,000	
第28回利付国債(30年)	690,000,000	940,842,600	
第29回利付国債(30年)	660,000,000	889,970,400	
第30回利付国債(30年)	640,000,000	852,684,800	
第31回利付国債(30年)	740,000,000	973,410,800	
第32回利付国債(30年)	880,000,000	1,179,490,400	
第33回利付国債(30年)	920,000,000	1,177,839,200	
第34回利付国債(30年)	845,000,000	1,121,281,200	
第35回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,492,456,000	
第36回利付国債(30年)	930,000,000	1,198,649,100	
第37回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,345,521,600	
第38回利付国債(30年)	540,000,000	673,725,600	
第39回利付国債(30年)	840,000,000	1,068,387,600	
第40回利付国債(30年)	600,000,000	749,370,000	
第41回利付国債(30年)	480,000,000	588,321,600	
第42回利付国債(30年)	650,000,000	796,932,500	
第43回利付国債(30年)	750,000,000	920,872,500	
第44回利付国債(30年)	470,000,000	577,254,000	
第45回利付国債(30年)	690,000,000	813,944,700	
第46回利付国債(30年)	810,000,000	955,476,000	
第47回利付国債(30年)	870,000,000	1,047,741,000	
第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,270,170,000	
第49回利付国債(30年)	710,000,000	819,666,600	
第50回利付国債(30年)	520,000,000	520,000,000	
第51回利付国債(30年)	790,000,000	687,007,700	
第52回利付国債(30年)	880,000,000	809,529,600	
第53回利付国債(30年)	930,000,000	878,115,300	
第54回利付国債(30年)	690,000,000	686,688,000	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	103,378,000	

第41回利付国債（20年）	330,000,000	340,348,800	
第42回利付国債（20年）	80,000,000	84,146,400	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	150,143,000	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	182,967,600	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	311,288,900	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	182,520,500	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	97,128,900	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	142,481,300	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	152,201,000	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	237,509,800	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	108,845,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	120,759,100	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	88,270,400	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	221,602,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	154,501,200	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	166,254,000	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	264,772,800	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	332,505,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	220,364,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	379,715,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	255,621,600	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	337,798,400	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	223,348,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	360,726,400	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	248,936,600	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	371,213,700	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	147,741,100	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	219,858,500	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	448,597,500	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	470,564,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	232,426,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	730,308,600	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	416,044,800	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	232,662,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	151,801,000	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	311,026,500	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	336,347,800	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	196,582,900	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	314,412,300	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	257,976,400	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	455,769,600	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	706,206,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	342,571,200	

第84回利付国債(20年)	470,000,000	551,150,200
第85回利付国債(20年)	290,000,000	343,771,800
第86回利付国債(20年)	210,000,000	252,655,200
第87回利付国債(20年)	550,000,000	656,848,500
第88回利付国債(20年)	420,000,000	507,507,000
第89回利付国債(20年)	350,000,000	419,737,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	758,293,200
第91回利付国債(20年)	450,000,000	545,841,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,055,023,200
第93回利付国債(20年)	410,000,000	489,121,800
第94回利付国債(20年)	610,000,000	733,708,000
第95回利付国債(20年)	610,000,000	748,390,700
第96回利付国債(20年)	320,000,000	386,160,000
第97回利付国債(20年)	340,000,000	415,116,200
第98回利付国債(20年)	440,000,000	532,677,200
第99回利付国債(20年)	870,000,000	1,056,519,300
第100回利付国債(20年)	480,000,000	589,507,200
第101回利付国債(20年)	415,000,000	518,608,900
第102回利付国債(20年)	320,000,000	401,286,400
第103回利付国債(20年)	160,000,000	198,884,800
第104回利付国債(20年)	360,000,000	439,570,800
第105回利付国債(20年)	760,000,000	930,711,200
第106回利付国債(20年)	230,000,000	284,245,500
第107回利付国債(20年)	150,000,000	184,107,000
第108回利付国債(20年)	610,000,000	734,726,700
第109回利付国債(20年)	130,000,000	156,863,200
第110回利付国債(20年)	990,000,000	1,217,690,100
第111回利付国債(20年)	290,000,000	361,119,600
第112回利付国債(20年)	610,000,000	752,331,300
第113回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,594,259,400
第114回利付国債(20年)	690,000,000	854,903,100
第115回利付国債(20年)	380,000,000	475,509,200
第116回利付国債(20年)	630,000,000	789,887,700
第117回利付国債(20年)	630,000,000	781,974,900
第118回利付国債(20年)	690,000,000	849,169,200
第119回利付国債(20年)	220,000,000	265,126,400
第120回利付国債(20年)	330,000,000	389,254,800
第121回利付国債(20年)	930,000,000	1,134,962,700
第122回利付国債(20年)	280,000,000	338,069,200
第123回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,249,220,000
第124回利付国債(20年)	390,000,000	482,040,000
第125回利付国債(20年)	310,000,000	392,261,600
第126回利付国債(20年)	570,000,000	705,933,600
第127回利付国債(20年)	460,000,000	563,141,200

第128回利付国債(20年)	840,000,000	1,030,260,000	
第129回利付国債(20年)	100,000,000	121,286,000	
第130回利付国債(20年)	630,000,000	764,820,000	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	456,057,000	
第132回利付国債(20年)	650,000,000	780,630,500	
第133回利付国債(20年)	600,000,000	729,012,000	
第134回利付国債(20年)	560,000,000	681,391,200	
第135回利付国債(20年)	420,000,000	504,693,000	
第136回利付国債(20年)	410,000,000	486,834,000	
第137回利付国債(20年)	350,000,000	421,116,500	
第138回利付国債(20年)	390,000,000	457,633,800	
第139回利付国債(20年)	510,000,000	605,813,700	
第140回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,576,951,800	
第141回利付国債(20年)	360,000,000	433,530,000	
第142回利付国債(20年)	420,000,000	512,022,000	
第143回利付国債(20年)	850,000,000	1,011,117,500	
第144回利付国債(20年)	390,000,000	457,711,800	
第145回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,662,775,800	
第146回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,373,871,000	
第147回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,594,144,400	
第148回利付国債(20年)	1,170,000,000	1,373,217,300	
第149回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,466,625,000	
第150回利付国債(20年)	1,220,000,000	1,411,149,600	
第151回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,492,738,800	
第152回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,524,791,200	
第153回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,547,068,000	
第154回利付国債(20年)	1,010,000,000	1,130,785,900	
第155回利付国債(20年)	1,530,000,000	1,657,403,100	
第156回利付国債(20年)	850,000,000	828,214,500	
第157回利付国債(20年)	1,400,000,000	1,309,616,000	
第158回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,263,270,400	
第159回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,353,550,500	
第160回利付国債(20年)	910,000,000	927,790,500	
第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	200,446,000	
国債証券合計	225,245,000,000	245,674,164,750	
地方債証券			
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,179,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,952,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	130,058,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,366,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,418,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,393,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	236,156,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,526,000	

第695回東京都公募公債	100,000,000	104,547,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	104,800,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	104,353,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	209,400,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	104,206,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	103,565,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	105,190,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	104,052,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	104,865,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	209,386,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,398,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	134,221,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	117,432,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,550,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	207,548,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	205,460,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,553,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	237,380,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,491,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,386,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,561,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,208,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,932,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,229,000	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,235,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,939,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	103,845,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	118,484,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,820,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,561,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	107,270,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	103,459,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,897,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	104,223,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,815,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,667,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	113,698,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	108,180,781	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	104,478,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,820,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	123,075,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	208,190,000	

平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,390,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,818,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,490,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,601,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,234,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	122,896,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,110,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,354,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,607,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	202,223,470	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,104,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,683,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	104,140,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,833,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	121,280,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	209,580,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	126,898,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,463,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	103,970,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	124,162,800	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	105,054,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,546,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,538,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,257,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,195,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,967,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	155,345,571	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,037,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,455,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,523,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,779,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	375,120,760	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,683,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,624,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,819,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,101,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,379,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,265,000	

第 1 1 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,900,000	
第 1 1 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,962,000	
第 1 2 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,928,000	
第 1 2 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,120,000	
第 1 2 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,007,000	
第 1 3 0 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,558,000	
第 1 3 2 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,519,000	
第 1 3 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,918,000	
第 1 3 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,597,000	
第 1 4 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,149,000	
第 1 4 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,752,000	
第 1 4 6 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,140,000	
第 1 5 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,468,000	
平成 2 4 年度第 2 回熊本県公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	208,514,000	
平成 2 2 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	103,498,000	
第 1 3 回大阪市公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	243,012,000	
平成 2 2 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	103,958,000	
第 5 回名古屋市公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	132,430,000	
第 9 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	120,058,000	
第 1 1 回名古屋市公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	118,669,000	
第 4 8 1 回名古屋市公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	104,031,000	
平成 2 2 年度第 2 回京都市公募公債	102,000,000	105,664,860	
平成 2 3 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	104,830,000	
平成 2 4 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	104,252,000	
平成 2 4 年度第 5 回京都市公募公債	100,000,000	104,740,000	
第 5 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	116,616,000	
第 2 0 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	121,234,000	
平成 2 1 年度第 1 回横浜市公募公債	200,000,000	206,358,000	
平成 2 1 年度第 5 回横浜市公募公債	100,000,000	103,893,000	
平成 2 3 年度第 5 回横浜市公募公債	100,000,000	104,672,000	
平成 2 4 年度第 1 0 回札幌市公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	104,345,000	
平成 2 6 年度第 9 回札幌市公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	102,571,000	
第 1 1 回川崎市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	118,674,000	
第 8 1 回川崎市公募公債	100,000,000	102,884,000	
第 8 2 回川崎市公募公債	100,000,000	103,545,000	
平成 2 6 年度第 2 回北九州市公募公債	100,000,000	102,734,000	
平成 2 6 年度第 5 回福岡市公募公債	200,000,000	206,816,000	
平成 2 2 年度第 6 回広島市公募公債	100,000,000	104,823,000	
平成 2 5 年度第 3 回広島市公募公債	150,000,000	156,285,000	
平成 2 6 年度第 2 回広島市公募公債	100,000,000	102,773,000	
平成 2 3 年度第 2 回千葉市公募公債	200,000,000	209,442,000	
	200,000,000	203,604,000	

	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）			
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	120,703,000	
	地方債証券合計	15,824,590,000	16,991,590,242	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,244,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,053,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,617,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,485,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,320,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,936,000	
	第14回道路債券	100,000,000	110,291,000	
	第17回道路債券	100,000,000	108,221,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	480,364,000	
	第21回道路債券	100,000,000	133,161,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,414,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	143,901,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,130,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,123,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,226,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,557,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,967,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,393,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	243,584,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,158,000	
	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,854,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,880,000	
	第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,768,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	143,583,480		
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,621,000		
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,162,000		

第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,394,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,263,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,958,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,584,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,908,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,855,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,562,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,267,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,754,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,761,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,378,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	314,174,770	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,374,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,733,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,391,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,849,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,421,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,926,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,640,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,112,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,758,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,463,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,156,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	155,718,200	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,470,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,948,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	106,768,500	

第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,559,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,230,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,759,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,242,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,354,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,097,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,718,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	326,925,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	116,299,700	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,660,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,551,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	133,717,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,957,200	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,911,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,056,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,301,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,080,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,291,590	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,407,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,138,880	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,268,160	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,540,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,092,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,362,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	519,875,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,044,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,855,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,368,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,794,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,360,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,996,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,541,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,374,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,385,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,987,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	104,154,230	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,955,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	104,264,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	116,012,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	108,919,000	

第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	21,226,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,226,000	21,399,714	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,392,000	20,662,369	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,812,000	21,278,682	
第 3 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	103,879,000	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,556,000	23,020,730	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	21,204,000	22,627,848	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	16,948,000	17,719,642	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	35,640,000	37,948,402	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	20,712,000	21,963,211	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	18,785,000	20,004,897	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	21,905,000	23,274,938	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	18,699,000	19,932,760	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	21,627,000	22,840,707	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	25,116,000	26,020,427	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	25,484,000	26,372,627	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,278,000	31,728,275	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,415,000	33,067,188	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,742,000	35,633,118	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,660,000	39,401,801	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,633,000	41,457,072	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,518,000	42,270,428	
第 3 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,072,000	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,582,000	89,378,411	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,809,000	20,779,046	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,187,000	47,009,665	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,927,000	20,889,075	
第 4 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,880,000	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,582,000	20,877,349	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,632,000	51,900,070	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,160,000	19,302,445	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,931,000	52,350,298	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,467,000	49,815,876	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,019,000	21,385,496	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,672,000	97,318,078	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,078,000	53,187,843	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,526,000	21,813,390	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,535,000	64,859,120	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,490,000	62,714,358	

第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,372,000	62,647,553	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,424,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,974,000	132,313,011	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,720,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,821,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,042,000	140,463,936	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,359,000	70,993,555	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,413,000	71,712,558	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,930,000	73,401,325	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,661,000	65,701,311	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,421,000	66,979,802	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,270,000	72,935,768	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,715,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,515,000	66,041,626	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,824,000	73,445,904	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,651,000	75,386,310	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,450,000	73,895,733	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,181,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,894,000	155,974,600	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,367,000	78,571,715	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,872,000	161,501,477	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,377,000	86,640,834	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,550,000	89,564,525	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,803,000	89,319,418	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,934,000	182,617,120	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,988,000	90,565,168	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,050,000	95,808,002	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,724,000	97,466,985	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,990,000	97,448,115	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,337,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,362,000	98,293,146	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,748,000	99,265,439	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,980,000	99,294,756	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	125,149,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	119,956,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,577,000	
い第786号商工債	300,000,000	301,797,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,654,000	
い第768号農林債	100,000,000	100,562,000	

	い第780号農林債	100,000,000	100,698,000	
	い第795号農林債	100,000,000	99,827,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,648,000	
	第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,430,000	
	第300回信金中金債（5年）	300,000,000	301,527,000	
	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,630,000	
	第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,658,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,074,000	
	第201号商工債（3年）	300,000,000	299,889,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,912,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	208,990,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,143,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,690,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券	200,000,000	208,164,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券	100,000,000	103,927,000	
	特殊債券合計	20,975,470,000	22,339,611,758	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,299,000	
	第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	100,231,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	99,810,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	100,067,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	99,612,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ピーエ ルシー円貨社債	100,000,000	99,827,000	
	第6回ピー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,264,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	100,469,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円 貨社債	100,000,000	100,233,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	100,000,000	100,324,000	
	第9回オーストラリア・ニュージーランド銀 行円貨社債	100,000,000	100,448,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,106,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,337,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,484,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	103,822,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,171,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,611,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	103,237,000		

第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,063,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,654,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,549,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,465,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,917,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,028,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,457,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,645,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	100,831,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,215,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,797,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	203,136,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,671,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,462,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,160,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,566,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,521,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,998,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,544,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,844,000	
第6回JANA三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,010,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,388,000	
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	100,573,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,854,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,134,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,712,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,799,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,378,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,494,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,269,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	126,590,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,866,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,406,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	120,398,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,582,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,259,000	

第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,823,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	103,085,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,470,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,150,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,943,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,844,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,272,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,576,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,837,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,349,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,287,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,178,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,823,000	
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,601,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,105,000	
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,626,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,169,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,828,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,257,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,270,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,397,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,985,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,352,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,444,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,842,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,619,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	246,498,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,019,130	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	122,805,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,302,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,094,800	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,248,000	

第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,275,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,197,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	206,022,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,164,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,754,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	123,154,800	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,415,900	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,338,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,103,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,378,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,983,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,678,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,819,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,145,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,980,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,038,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,749,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,365,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,304,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,954,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,189,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	133,315,560	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,337,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,838,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,939,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,708,920	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,518,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,761,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,774,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	104,290,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,116,000	
社債券合計	11,996,000,000	12,450,289,110	
合計		297,455,655,860	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

米国国債インデックスマザーファンド

貸借対照表

	平成29年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,846,568
コール・ローン	850,054
国債証券	202,492,198
未収利息	785,819
前払費用	438,724
流動資産合計	208,413,363
資産合計	208,413,363
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,270
未払利息	1
その他未払費用	6
流動負債合計	3,277
負債合計	3,277
純資産の部	
元本等	
元本	208,076,840
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	333,246
元本等合計	208,410,086
純資産合計	208,410,086
負債純資産合計	208,413,363

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 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

平成29年 5月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	208,076,840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 1.0016円 (1万口当たり純資産額) (10,016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 5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、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

	平成29年 5月10日現在

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 5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 5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 2月27日
期首元本額	200,487,107円

区分	平成29年 5月10日現在
期中追加設定元本額	9,112,624円
期中一部解約元本額	1,522,891円
期末元本額	208,076,840円
期末元本額の内訳	
SMT 日米インデックスバランス・オープン	4,564,775円
米国国債インデックスファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	203,512,065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 5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		151,446
合計		151,446

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

（デリバティブ取引に関する注記）

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	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.625% 04/30/18	10,000.00	9,945.40	
		T 0.625% 06/30/18	10,000.00	9,933.50	
		T 0.75% 07/31/18	10,000.00	9,941.24	
		T 0.75% 08/15/19	10,000.00	9,855.81	
		T 0.75% 08/31/18	10,000.00	9,935.43	
		T 0.75% 09/30/18	10,000.00	9,929.36	
		T 0.75% 10/31/18	10,000.00	9,922.41	
		T 0.875% 04/15/19	10,000.00	9,912.16	

T 0.875% 05/31/18	10,000.00	9,965.69	
T 0.875% 07/15/18	10,000.00	9,959.35	
T 0.875% 07/31/19	10,000.00	9,887.83	
T 0.875% 09/15/19	10,000.00	9,875.74	
T 0.875% 10/15/18	10,000.00	9,943.67	
T 1.125% 01/15/19	10,000.00	9,970.16	
T 1.125% 01/31/19	10,000.00	9,968.79	
T 1.125% 02/28/21	10,000.00	9,768.20	
T 1.125% 04/30/20	10,000.00	9,879.22	
T 1.125% 06/15/18	10,000.00	9,991.04	
T 1.125% 06/30/21	10,000.00	9,723.86	
T 1.125% 07/31/21	20,000.00	19,424.88	
T 1.125% 08/31/21	10,000.00	9,702.69	
T 1.125% 09/30/21	10,000.00	9,689.76	
T 1.25% 01/31/20	10,000.00	9,937.35	
T 1.25% 03/31/21	10,000.00	9,804.27	
T 1.25% 07/31/23	10,000.00	9,489.32	
T 1.25% 11/15/18	10,000.00	9,995.26	
T 1.25% 11/30/18	10,000.00	9,992.66	
T 1.25% 12/15/18	10,000.00	9,992.05	
T 1.25% 12/31/18	10,000.00	9,991.52	
T 1.375% 01/15/20	10,000.00	9,972.21	
T 1.375% 01/31/20	10,000.00	9,971.67	
T 1.375% 02/15/20	10,000.00	9,966.55	
T 1.375% 02/28/19	10,000.00	10,008.78	
T 1.375% 02/29/20	10,000.00	9,961.62	
T 1.375% 03/31/20	10,000.00	9,956.60	
T 1.375% 04/30/20	10,000.00	9,948.67	
T 1.375% 04/30/21	10,000.00	9,842.63	
T 1.375% 05/31/20	10,000.00	9,939.46	
T 1.375% 05/31/21	20,000.00	19,665.04	
T 1.375% 06/30/23	10,000.00	9,573.67	
T 1.375% 07/31/18	10,000.00	10,016.97	
T 1.375% 08/31/23	10,000.00	9,550.13	
T 1.375% 12/15/19	10,000.00	9,978.86	
T 1.5% 01/31/19	20,000.00	20,062.58	
T 1.5% 01/31/22	10,000.00	9,817.04	
T 1.5% 02/28/19	10,000.00	10,030.82	
T 1.5% 02/28/23	10,000.00	9,686.99	
T 1.5% 03/31/23	10,000.00	9,675.36	
T 1.5% 05/31/19	10,000.00	10,029.64	
T 1.5% 05/31/20	10,000.00	9,977.20	
	10,000.00	9,266.50	

T 1.5% 08/15/26			
T 1.5% 08/31/18	10,000.00	10,032.17	
T 1.5% 10/31/19	10,000.00	10,017.26	
T 1.5% 11/30/19	10,000.00	10,013.06	
T 1.625% 02/15/26	10,000.00	9,413.38	
T 1.625% 03/15/20	10,000.00	10,028.83	
T 1.625% 03/31/19	10,000.00	10,054.84	
T 1.625% 04/30/19	10,000.00	10,055.02	
T 1.625% 04/30/23	10,000.00	9,735.04	
T 1.625% 05/15/26	20,000.00	18,784.23	
T 1.625% 06/30/19	10,000.00	10,052.64	
T 1.625% 06/30/20	10,000.00	10,008.83	
T 1.625% 07/31/20	10,000.00	10,002.77	
T 1.625% 08/31/19	10,000.00	10,049.79	
T 1.625% 10/31/23	10,000.00	9,682.70	
T 1.625% 11/15/22	10,000.00	9,793.94	
T 1.625% 11/30/20	10,000.00	9,975.01	
T 1.625% 12/31/19	10,000.00	10,040.50	
T 1.75% 02/28/22	10,000.00	9,922.50	
T 1.75% 05/15/22	10,000.00	9,911.16	
T 1.75% 05/15/23	10,000.00	9,802.98	
T 1.75% 09/30/19	10,000.00	10,077.63	
T 1.75% 09/30/22	20,000.00	19,738.65	
T 1.75% 10/31/18	10,000.00	10,069.89	
T 1.75% 10/31/20	10,000.00	10,023.89	
T 1.75% 12/31/20	10,000.00	10,011.02	
T 1.875% 03/31/22	10,000.00	9,978.47	
T 1.875% 05/31/22	10,000.00	9,970.51	
T 1.875% 08/31/22	10,000.00	9,943.22	
T 1.875% 10/31/22	10,000.00	9,924.82	
T 1.875% 11/30/21	10,000.00	9,997.86	
T 1% 03/15/19	20,000.00	19,881.04	
T 1% 05/15/18	10,000.00	9,980.17	
T 1% 05/31/18	10,000.00	9,978.42	
T 1% 08/15/18	10,000.00	9,970.57	
T 1% 09/15/18	10,000.00	9,965.15	
T 1% 10/15/19	10,000.00	9,899.06	
T 1% 11/15/19	10,000.00	9,889.91	
T 1% 11/30/18	10,000.00	9,954.98	
T 2.125% 01/31/21	10,000.00	10,140.47	
T 2.125% 05/15/25	10,000.00	9,863.46	
T 2.125% 06/30/21	10,000.00	10,124.14	
T 2.125% 06/30/22	10,000.00	10,080.88	

T 2.125% 08/15/21	10,000.00	10,121.21
T 2.125% 08/31/20	10,000.00	10,156.31
T 2.125% 09/30/21	10,000.00	10,110.74
T 2.125% 11/30/23	10,000.00	9,979.92
T 2.125% 12/31/21	10,000.00	10,102.23
T 2.25% 02/15/27	10,000.00	9,874.08
T 2.25% 03/31/21	10,000.00	10,180.57
T 2.25% 04/30/21	10,000.00	10,177.59
T 2.25% 07/31/21	10,000.00	10,168.05
T 2.25% 08/15/46	10,000.00	8,461.47
T 2.25% 11/15/24	30,000.00	29,967.73
T 2.25% 11/15/25	20,000.00	19,847.98
T 2.25% 12/31/23	10,000.00	10,047.26
T 2.375% 08/15/24	20,000.00	20,186.82
T 2.375% 12/31/20	10,000.00	10,235.40
T 2.5% 02/15/45	10,000.00	8,988.79
T 2.5% 02/15/46	10,000.00	8,963.11
T 2.5% 05/15/24	10,000.00	10,189.49
T 2.5% 05/15/46	10,000.00	8,957.52
T 2.5% 08/15/23	10,000.00	10,219.92
T 2.625% 08/15/20	10,000.00	10,317.71
T 2.625% 11/15/20	10,000.00	10,320.74
T 2.75% 02/15/19	10,000.00	10,251.31
T 2.75% 02/15/24	20,000.00	20,715.20
T 2.75% 08/15/42	10,000.00	9,537.70
T 2.75% 11/15/23	10,000.00	10,363.71
T 2.75% 11/15/42	10,000.00	9,529.91
T 2.875% 05/15/43	10,000.00	9,740.63
T 2.875% 08/15/45	10,000.00	9,696.99
T 2.875% 11/15/46	10,000.00	9,695.21
T 2% 02/15/22	10,000.00	10,053.65
T 2% 02/15/23	10,000.00	9,964.16
T 2% 02/15/25	10,000.00	9,794.10
T 2% 02/28/21	10,000.00	10,096.01
T 2% 05/31/21	10,000.00	10,081.70
T 2% 07/31/22	10,000.00	10,012.32
T 2% 08/15/25	30,000.00	29,252.84
T 2% 09/30/20	10,000.00	10,114.18
T 2% 10/31/21	10,000.00	10,054.00
T 2% 11/15/21	10,000.00	10,057.81
T 2% 11/15/26	10,000.00	9,667.77
T 2% 11/30/22	10,000.00	9,983.42

T 2% 12/31/21	10,000.00	10,045.94
T 3.125% 02/15/43	20,000.00	20,407.58
T 3.125% 05/15/19	10,000.00	10,353.14
T 3.125% 05/15/21	10,000.00	10,517.20
T 3.125% 08/15/44	10,000.00	10,196.13
T 3.125% 11/15/41	10,000.00	10,241.84
T 3.375% 05/15/44	10,000.00	10,671.70
T 3.375% 11/15/19	10,000.00	10,476.71
T 3.5% 05/15/20	10,000.00	10,572.30
T 3.625% 02/15/20	10,000.00	10,575.29
T 3.625% 02/15/21	10,000.00	10,691.71
T 3.625% 02/15/44	10,000.00	11,140.54
T 3.625% 08/15/19	10,000.00	10,495.48
T 3.625% 08/15/43	10,000.00	11,128.39
T 3.75% 11/15/18	10,000.00	10,368.63
T 3.75% 11/15/43	10,000.00	11,370.86
T 3% 05/15/45	10,000.00	9,944.81
T 3% 11/15/44	10,000.00	9,952.82
T 3% 11/15/45	10,000.00	9,939.40
T 4.375% 02/15/38	10,000.00	12,468.71
T 4.375% 05/15/41	10,000.00	12,450.39
T 4.375% 11/15/39	10,000.00	12,411.75
T 4.5% 02/15/36	10,000.00	12,641.11
T 4.625% 02/15/40	10,000.00	12,842.93
T 4.75% 02/15/41	10,000.00	13,106.03
T 5.5% 08/15/28	10,000.00	12,973.32
T 6.25% 05/15/30	10,000.00	14,140.95
アメリカドル 小計	1,760,000.00	1,778,431.39 (202,492,198)
合計		202,492,198 (202,492,198)

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 162銘柄	100.0%	100.0%

(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

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年 5月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	687,843,903
投資証券	67,311,952,550
派生商品評価勘定	2,240,700
未収入金	188,291,818
未収配当金	610,658,929
前払金	16,835,380
差入委託証拠金	30,135,000
流動資産合計	68,847,958,280
資産合計	68,847,958,280
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,076,080
未払解約金	207,202,683
未払利息	1,069
その他未払費用	2,619
流動負債合計	226,282,451
負債合計	226,282,451
純資産の部	
元本等	
元本	43,465,073,932
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,156,601,897
元本等合計	68,621,675,829
純資産合計	68,621,675,829
負債純資産合計	68,847,958,280

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 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

平成29年 5月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,465,073,932口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5788円 (15,788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 5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 5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、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</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 5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 5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 2月27日
期首元本額	43,288,690,234円
期中追加設定元本額	1,681,873,168円
期中一部解約元本額	1,505,489,470円
期末元本額	43,465,073,932円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,672,211,057円
S B I 資産設計オープン（分配型）	11,409,931円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	9,376,871,346円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	19,287,014,476円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,249,666,481円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,605,461,974円
分散投資コア戦略ファンドA	870,741,466円
分散投資コア戦略ファンドS	1,705,204,000円
コア投資戦略ファンド（切替型）	561,197,154円
J - R E I T インデックス・オープン	314,213,855円
S M T インデックスバランス・オープン	40,500,593円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	713,936,375円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	1,423,546円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,055,221,678円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

平成29年 5月10日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	809,158,609
合計	809,158,609

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

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(平成29年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	1,317,050,380	-	1,300,215,000	16,835,380
合計		1,317,050,380	-	1,300,215,000	16,835,380

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,805	1,361,827,500	
	MCUBS MidCity投資法人	1,709	586,187,000	
	森ヒルズリート投資法人	9,291	1,354,627,800	
	産業ファンド投資法人	2,293	1,148,793,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	7,816	2,329,168,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	1,937	566,959,900	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	3,691	1,963,612,000	
	GLP投資法人	15,142	1,962,403,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,114	783,793,800	
	日本プロロジスリート投資法人	10,118	2,450,579,600	
	星野リゾート・リート投資法人	1,039	601,581,000	
	SIA不動産投資法人	959	185,182,900	

イオンリート投資法人	7,818	974,904,600	
ヒューリックリート投資法人	5,546	1,024,900,800	
日本リート投資法人	2,268	659,080,800	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,722	473,616,600	
日本ヘルスケア投資法人	414	67,978,800	
積水ハウス・リート投資法人	4,960	710,768,000	
トーセイ・リート投資法人	1,061	111,935,500	
ケネディクス商業リート投資法人	3,038	759,803,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,052	103,727,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,502	124,065,200	
ジャパン・シニアリビング投資法人	470	62,134,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	24,219	3,959,806,500	
いちごホテルリート投資法人	1,367	149,413,100	
ラサールロジポート投資法人	6,369	681,483,000	
スターアジア不動産投資法人	1,883	189,053,200	
マリモ地方創生リート投資法人	483	44,049,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,351	455,962,500	
大江戸温泉リート投資法人	1,063	95,988,900	
さくら総合リート投資法人	2,008	157,828,800	
投資法人みらい	1,063	164,446,100	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,809	272,616,300	
日本ビルファンド投資法人	8,175	5,052,150,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	7,896	4,792,872,000	
日本リートールファンド投資法人	16,071	3,556,512,300	
オリックス不動産投資法人	16,118	2,881,898,400	
日本プライムリアルティ投資法人	5,330	2,291,900,000	
プレミア投資法人	7,625	945,500,000	
東急リアル・エステート投資法人	5,660	799,192,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,341	526,342,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	18,425	3,145,147,500	
森トラスト総合リート投資法人	6,369	1,136,229,600	
インヴィンシブル投資法人	19,559	912,427,350	
フロンティア不動産投資法人	2,872	1,438,872,000	
平和不動産リート投資法人	5,386	464,811,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,307	1,262,004,600	
福岡リート投資法人	4,145	739,468,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,442	1,579,974,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	6,401	763,639,300	
いちごオフィスリート投資法人	7,023	470,541,000	
大和証券オフィス投資法人	2,042	1,170,066,000	
阪急リート投資法人	3,459	521,963,100	
スタートアップリート投資法人	1,363	199,952,100	
大和ハウスリート投資法人	8,895	2,558,202,000	

ジャパン・ホテル・リート投資法人	22,688	1,756,051,200	
日本賃貸住宅投資法人	9,496	776,772,800	
ジャパンエクセレント投資法人	7,560	1,031,184,000	
合計	336,028	67,311,952,550	

(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

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。

米国REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年 5月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	821,912
コール・ローン	1,226,268
投資信託受益証券	4,632,963
投資証券	189,484,811
派生商品評価勘定	3,463
未収入金	95,472
未収配当金	309,436
流動資産合計	196,574,325
資産合計	196,574,325
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,635
未払利息	1
流動負債合計	1,636
負債合計	1,636
純資産の部	
元本等	
元本	199,206,329
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,633,640
元本等合計	196,572,689
純資産合計	196,572,689
負債純資産合計	196,574,325

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 5月10日現在	
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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>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> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)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 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	199,206,329口

	平成29年 5月10日現在	
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	2,633,640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)	0.9868円 (9,868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 5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、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 5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。

	平成29年 5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>(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> <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 5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 2月27日
期首元本額	190,717,535円
期中追加設定元本額	17,722,972円
期中一部解約元本額	9,234,178円
期末元本額	199,206,329円
期末元本額の内訳	
SMT 米国REITインデックス・オープン	196,931,227円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	2,275,102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 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		39,282
投資証券		6,360,579
合計		6,399,861

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成29年 5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 買建	679,637	-	683,100	3,463
	アメリカドル	679,637	-	683,100	3,463
	合計	679,637	-	683,100	3,463

(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
投資信託受益証券	アメリカドル	VANGUARD REIT ETF	500	40,690.00	
			500	40,690.00	

		アメリカドル 小計		(4,632,963)
投資信託受益証券合計			500	4,632,963
				(4,632,963)
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	136	3,869.20
		AGREE REALTY CORP	19	870.96
		ALEXANDER'S INC	4	1,652.64
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	174	19,752.48
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	42	1,680.84
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	311	14,125.62
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	560	12,443.20
		APARTMENT INVEST & MGMT	374	16,044.60
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	288	5,356.80
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	27	352.35
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	27	277.02
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	93	556.14
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	308	59,176.04
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	19	240.92
		BOSTON PROPERTIES	332	40,875.84
		BRANDYWINE REALTY TRUST	347	5,777.55
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	658	12,580.96
		CAMDEN PROPERTY TRUST	205	16,715.70
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	161	4,287.43
		CARETRUST REIT INC	52	889.20
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	222	1,789.32
		CEDAR REALTY TRUST INC	81	424.44
		CHATHAM LODGING TRUST	41	776.95
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	64	1,489.28
		CITY OFFICE REIT INC	17	205.53
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	1,123	14,756.22
		COLONY STARWOOD HOMES	174	5,801.16
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	205	4,516.15
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	115	2,824.40
		CORECIVIC INC	202	6,819.52
		CORESITE REALTY CORP	65	6,391.45
		CORPORATE OFFICE PPTYS	191	6,245.70
		COUSINS PROPERTIES INC	724	6,023.68
		CUBESMART	385	9,571.10
		CYRUSONE INC	130	7,000.50
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	238	12,161.80
		DDR CORPORATION	683	6,529.48
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	593	6,392.54
		DIGITAL REALTY TRUST INC	363	41,382.00

DOUGLAS EMMETT INC-W/I	339	12,983.70	
DUKE REALTY CORP	804	22,415.52	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	151	7,778.01	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14	272.58	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	44	3,416.60	
EDUCATION REALTY TRUST INC	112	4,198.88	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	236	4,908.80	
EPR PROPERTIES	149	10,456.82	
EQUITY COMMONWEALTH	217	6,794.27	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	177	14,429.04	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	824	53,428.16	
ESSEX PROPERTY TRUST	143	35,811.49	
EXTRA SPACE STORAGE INC	280	20,479.20	
FARMLAND PARTNERS INC	100	1,059.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	161	21,018.55	
FELCOR LODGING TRUST INC	142	1,022.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	216	5,991.84	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	63	685.44	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	566	12,650.10	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	146	3,210.54	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	96	1,054.08	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	412	14,564.20	
GEO GROUP INC/THE	301	9,523.64	
GETTY REALTY CORP	28	707.56	
GGP INC	1,274	28,410.20	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	23	467.13	
GLOBAL NET LEASE INC	60	1,329.60	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	77	1,605.45	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	300	8,175.00	
HCP INC	1,019	30,457.91	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	308	9,846.76	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	364	10,832.64	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	52	952.12	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	222	11,146.62	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	288	8,951.04	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	1,677	29,900.91	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	307	10,250.73	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	33	297.66	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	135	785.70	
INVITATION HOMES INC	200	4,290.00	
IRON MOUNTAIN INC	551	19,174.80	

ISTAR INC	160	1,968.00
KILROY REALTY CORPORATION	207	14,502.42
KIMCO REALTY CORP	922	17,997.44
KITE REALTY GROUP TRUST	167	3,238.13
LASALLE HOTEL PROPERTIES	187	5,322.02
LEXINGTON CORP PROPERTIES	277	2,664.74
LIBERTY PROPERTY TRUST	336	13,651.68
LIFE STORAGE INC	91	6,670.30
LTC PROPERTIES INC	48	2,211.36
MACERICH CO/THE	293	17,474.52
MACK-CALI REALTY CORP	256	6,853.12
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	45	538.65
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	855	11,132.10
MID-AMERICA APARTMENT COMM	240	23,702.40
MONMOUTH REIT -CL A	66	935.88
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	525	5,192.25
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	341	13,138.73
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25	587.75
NATL HEALTH INVESTORS INC	94	6,807.48
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	93	891.87
NEXPOINT RESIDENTIAL	23	565.11
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	65	783.25
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	424	13,584.96
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	15	357.75
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	250	6,415.00
PARKWAY INC	90	1,791.90
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	206	6,344.80
PENN REAL ESTATE INVEST TST	75	888.75
PHYSICIANS REALTY TRUST	265	5,053.55
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	278	5,943.64
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	24	348.00
PROLOGIS INC	1,184	64,172.80
PS BUSINESS PARKS INC	57	6,998.46
PUBLIC STORAGE	331	68,871.17
QTS REALTY TRUST INC	113	5,604.80
QUALITY CARE PROPERTIES	203	3,511.90
RAMCO-GERSHENSON PRYS	85	1,116.90
REALTY INCOME CORP	548	30,118.08
REGENCY CENTERS CORP	321	19,751.13
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	291	5,910.21
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	647	8,313.95
	60	1,511.40

REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC			
RLJ LODGING TRUST	213	4,340.94	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	97	6,013.03	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70	1,677.20	
SAUL CENTERS INC	12	702.72	
SELECT INCOME REIT	67	1,592.59	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	414	8,474.58	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	40	1,598.80	
SIMON PROPERTY GROUP	693	112,584.78	
SL GREEN REALTY CORP	231	23,908.50	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1,040	7,633.60	
STAG INDUSTRIAL INC	248	6,346.32	
STORE CAPITAL CORP	352	7,166.72	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	93	1,596.81	
SUN COMMUNITIES INC	152	12,743.68	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	406	6,293.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	261	7,154.01	
TAUBMAN CENTERS INC	160	9,526.40	
TERRENO REALTY CORP	46	1,477.98	
TIER REIT INC	100	1,651.00	
UDR INC	618	23,205.90	
UMH PROPERTIES INC	26	425.36	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	13	898.04	
URBAN EDGE PROPERTIES	186	4,696.50	
URSTADT BIDDLE - CL A	29	559.70	
VENTAS INC	798	49,978.74	
VEREIT INC	2,102	16,143.36	
VORNADO REALTY TRUST	391	36,898.67	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	247	2,047.63	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	200	6,138.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	305	9,854.55	
WELLTOWER INC	814	56,190.42	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	18	213.66	
WHITESTONE REIT	29	349.45	
WP CAREY INC	232	14,228.56	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	117	2,080.26	
アメリカドル 小計	43,967	1,664,191.21 (189,484,811)	
投資証券合計	43,967	189,484,811 (189,484,811)	
合計		194,117,774 (194,117,774)	

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	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益 1銘柄 証券	2.4%		2.4%
	投資証券 157銘柄		97.6%	97.6%

(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。

2 ファンドの現況

SMT 日米インデックスバランス・オープン

純資産額計算書

(平成29年 5月31日現在)

資産総額	21,963,192円
負債総額	6,922円
純資産総額(-)	21,956,270円
発行済口数	21,933,155口
1口当たり純資産額(/)	1.0011円
(1万口当たり純資産額)	(10,011円)

(参考)

日本株配当貴族インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（平成29年 5月31日現在）

資産総額	330,736,089円
負債総額	6,810,161円
純資産総額（ - ）	323,925,928円
発行済口数	263,265,243口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2304円
（1万口当たり純資産額）	（12,304円）

米国株配当貴族インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（平成29年 5月31日現在）

資産総額	809,407,383円
負債総額	35,449,244円
純資産総額（ - ）	773,958,139円
発行済口数	689,743,521口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1221円
（1万口当たり純資産額）	（11,221円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成29年 5月31日現在）

資産総額	310,620,835,485円
負債総額	7,941,521,590円
純資産総額（ - ）	302,679,313,895円
発行済口数	218,868,699,842口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3829円
（1万口当たり純資産額）	（13,829円）

米国内債インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（平成29年 5月31日現在）

資産総額	204,927,059円
負債総額	4,608円
純資産総額（ - ）	204,922,451円

発行済口数	207,875,766口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9858円
（1万口当たり純資産額）	（9,858円）

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成29年 5月31日現在）

資産総額	69,881,516,981円
負債総額	935,982,169円
純資産総額（ - ）	68,945,534,812円
発行済口数	44,210,813,794口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5595円
（1万口当たり純資産額）	（15,595円）

米国REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成29年 5月31日現在）

資産総額	193,515,633円
負債総額	3,165円
純資産総額（ - ）	193,512,468円
発行済口数	199,599,981口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9695円
（1万口当たり純資産額）	（9,695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 2月 8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)資本金の額（平成29年 5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 8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5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	479	9,061,021
追加型公社債投資信託	0	0

単位型株式投資信託	52	206,711
単位型公社債投資信託	0	0
合計	531	9,267,732

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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	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 (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. その他有価証券

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「その他有価証券」には含めておりません。

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成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いません。

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いません。

（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 (平成28年3月31日)	当事業年度 (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 2月 8日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

< 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 8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
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

株式会社SBI証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
-----------	--------	-------------------------------

株式会社SBI証券は、平成29年3月3日より募集・販売等の取扱いを行います。

<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
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	8,157	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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7月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

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SMT 日米インデックスバランス・オープンの平成29年2月27日から平成29年5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、SMT 日米インデックスバランス・オープンの平成29年5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

- 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。
- 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。