

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年2月9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】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

SMT 日米インデックスバランス・オープン

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。  
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。  
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

**( 7 ) 【申込期間】**

平成30年 2月10日から平成30年 8月10日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ( )		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グロ ー バ ル  日本  北米	ファミリー ファンド  ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり ( )  なし	日経225  T O P I X  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	欧州  アジア  オセアニ ア				
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))		アフリカ  中近東 (中東)  エマ ー ジ ング				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

## [ 投資対象地域による区分 ]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

## [ 補足分類 ]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

## [ 決算頻度による属性区分 ]

(1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす



る旨の記載があるものをいう。

- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

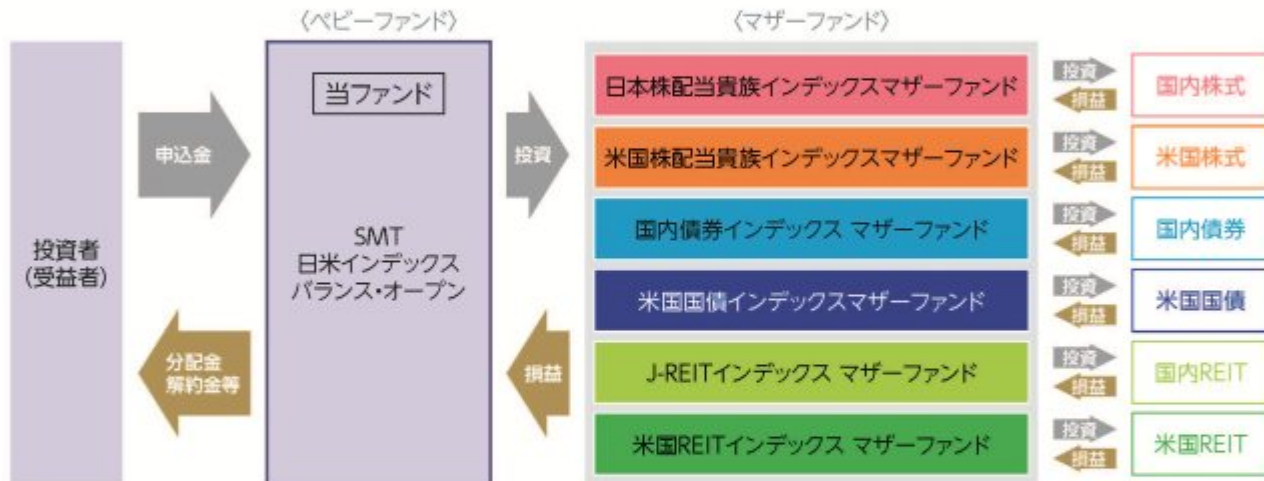
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

#### < ファンドの特色 >

## 特色1 国内及び米国の株式、債券及び不動産投資信託証券(REIT)に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 国内及び米国の株式、債券及びREITに分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
- 各マザーファンドは指数(インデックス)への連動を目指す運用を行います。
- 原則として、為替ヘッジは行いません。

### ファンドのしくみ



※各マザーファンド(J-REITインデックス マザーファンドを除く)の運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

### ? ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

### ? REITとは

REITは Real Estate Investment Trust の略称です。

REITは、投資者から集めた資金で、不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

## ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各マザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本組入比率に従って、各マザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

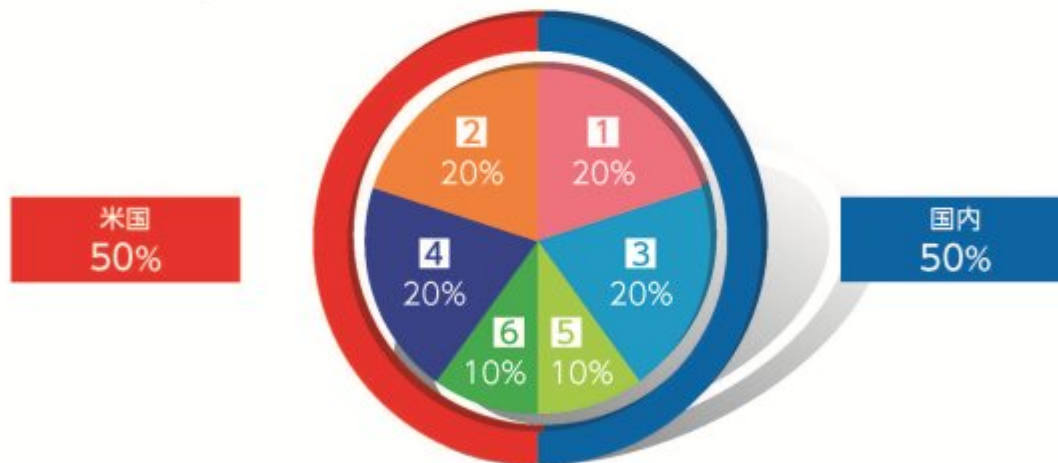
●各マザーファンドの組入比率が基本組入比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 特色2

各マザーファンドの基本組入比率は、原則として以下のとおりとします。

基本組入比率



●市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。

マザーファンド	インデックス
1 日本株配当貴族インデックスマザーファンド	S&P/JPX配当貴族指数(配当込み)
2 米国株配当貴族インデックスマザーファンド	S&P500配当貴族指数(税引後配当込み、円換算ベース)
3 国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI 総合
4 米国国債インデックスマザーファンド	FTSE米国債インデックス(円ベース)
5 J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
6 米国REITインデックス マザーファンド	S&P米国REIT指数(配当込み、円換算ベース)

各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

〔S&P/JPX配当貴族指数〕とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)、株式会社日本取引所グループ(以下「JPX」)および株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が公表する指数で、TOPIXの構成銘柄のうち、10年以上にわたり毎年増配しているか、または安定した配当を維持している銘柄を対象とし、配当利回りにより加重され算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

※リバランス時における構成銘柄数は最低40銘柄であり、10年以上にわたり毎年増配しているか、または安定した配当を維持している銘柄数が40銘柄を下回った場合には、以下の対応が行われます。

- ・7年以上にわたり毎年増配しているか、または安定した配当を維持している銘柄を配当利回りの高いものから順に40銘柄になるまで構成銘柄に追加します。

S&P/JPX配当貴族指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJ、JPXおよび東証の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。JPX®はJPXの登録商標であり、これを利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社に付与されています。TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、東証の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pもしくはそれぞれの関連会社、JPXまたは東証によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

〔S&P500配当貴族指数〕とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、S&P500指数の構成銘柄のうち、25年以上連続して増配している銘柄を対象とし、均等加重時価総額に基づいて算出されます。「税引後配当込み」指数は、税引後の配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

※年次見直し時における構成銘柄数は最低40銘柄であり、25年以上連続して増配している銘柄数が40銘柄を下回った場合には、以下の対応が行われます。

- ・20年以上連続して増配している銘柄を配当利回りの高いものから順に40銘柄になるまで構成銘柄に追加します。
- ・それでも40銘柄に満たない場合には、配当利回りの高いものから順に40銘柄になるまで構成銘柄に追加します。

S&P500配当貴族指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

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

〔FTSE米国債インデックス〕は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、米国国債の総合収益を表す債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

〔S&P米国REIT指数〕とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、米国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の時価総額修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。S&P米国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



## 分配方針

- 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 投資信託証券(REITを除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

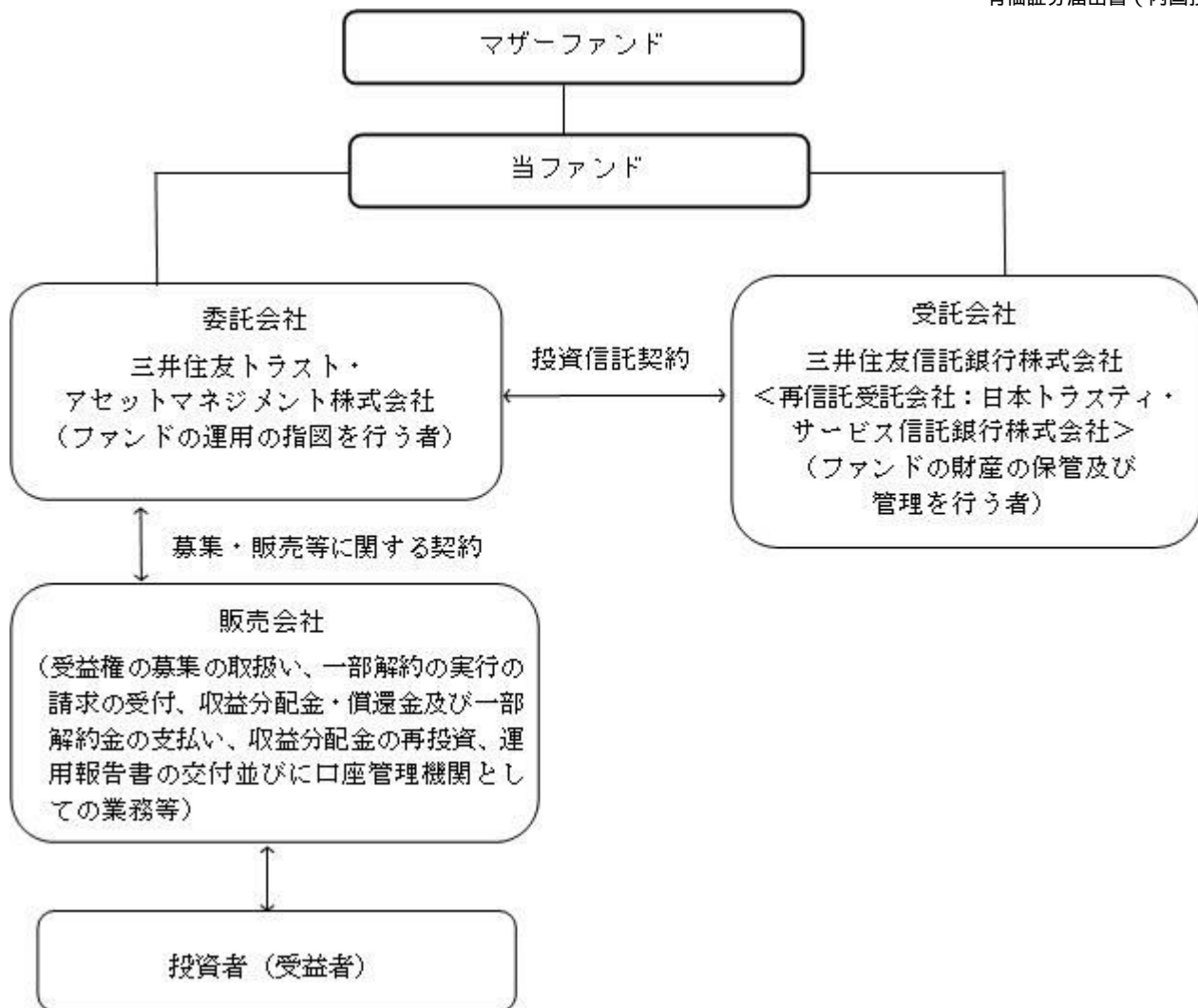
## (2) 【ファンドの沿革】

平成29年 2月27日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成29年11月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 投資対象

「日本株配当貴族インデックスマザーファンド」、「米国株配当貴族インデックスマザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「米国国債インデックスマザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「米国REITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券を主要投資対象とします。

### 投資態度

イ．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内及び米国の株式、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」ということがあります。）に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。

ロ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として以下のとおりとします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。

マザーファンド受益証券	基本組入比率
日本株配当貴族インデックスマザーファンド	20%
米国株配当貴族インデックスマザーファンド	20%
国内債券インデックス マザーファンド	20%
米国国債インデックスマザーファンド	20%
J-REITインデックス マザーファンド	10%
米国REITインデックス マザーファンド	10%

ハ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の75%以下とします。

ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

ホ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株配当貴族インデックスマザーファンド」、「米国株配当貴族インデックスマザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「米国国債インデックスマザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファン

ド」及び「米国REITインデックス マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
  2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
  12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
  13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

イ. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用



することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ．上記の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「日本株配当貴族インデックスマザーファンド」の概要

###### 1．基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

###### 2．運用方法

###### (1)投資対象

わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、S&P / JPX配当貴族指数（配当込み）に連動する投資成果を目指します。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。

株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

###### 3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

##### 「米国株配当貴族インデックスマザーファンド」の概要

###### 1．基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

###### 2．運用方法

### (1)投資対象

米国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、S&P500配当貴族指数（税引後配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。

運用の効率化を図るため、上場投資信託証券を活用することがあります。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引な

らびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「米国国債インデックスマザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

米国の国債等を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主として米国の国債等に投資し、FTSE米国債インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目指します。

債券への投資割合は、原則として高位を維持します。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### 3. 運用制限

株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「米国REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

米国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場している不動産投資信託証券（以下「米国REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

主として米国REITに投資し、S&P米国REIT指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

米国REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資は行いません。

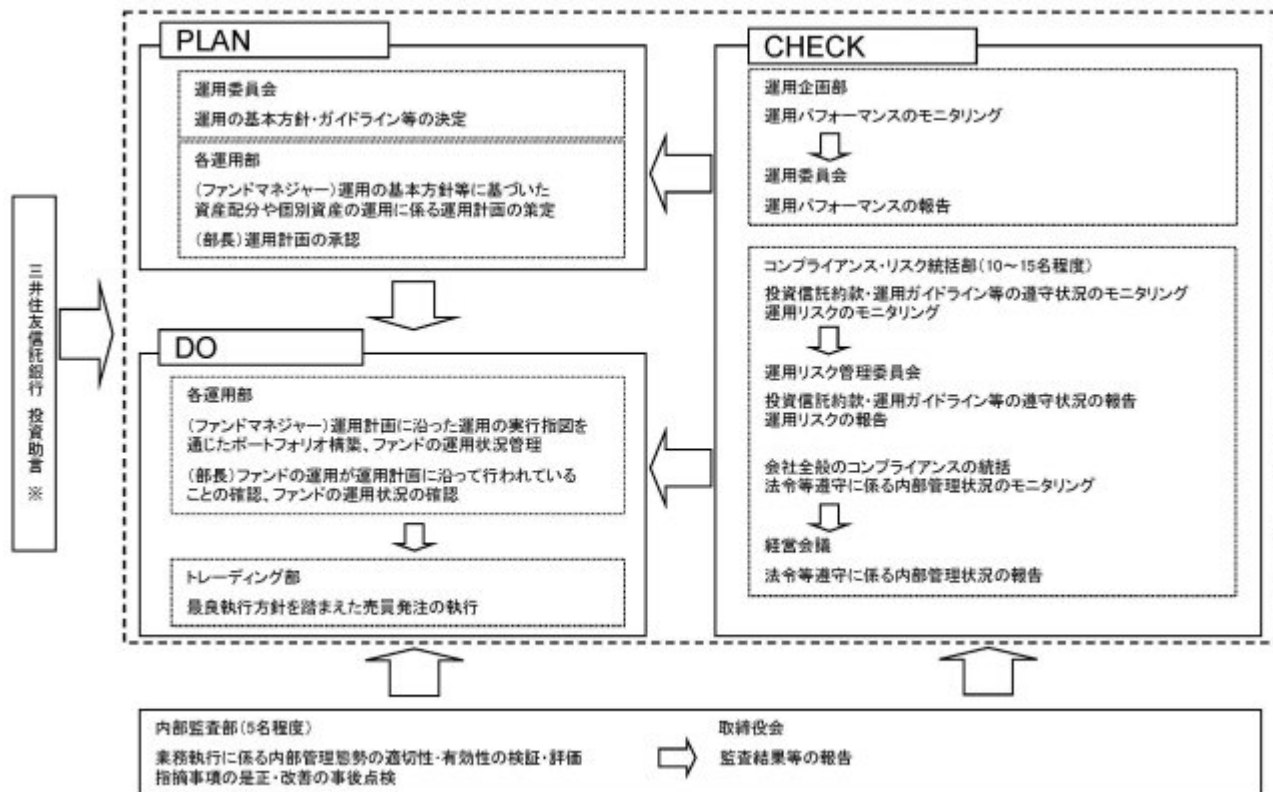
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## （3）【運用体制】

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



三井住友信託銀行は各マザーファンド（「J-REITインデックス マザーファンド」を除く）に対して投資助言を行います。

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

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

#### （４）【配分方針】

- ・年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

##### イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（REITを除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### ニ．投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### ホ．信用取引の指図範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）
- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプショ

ン取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ) a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額



に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### カ．資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくはは受益者

への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(八) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヨ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

##### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

### 金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

### 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

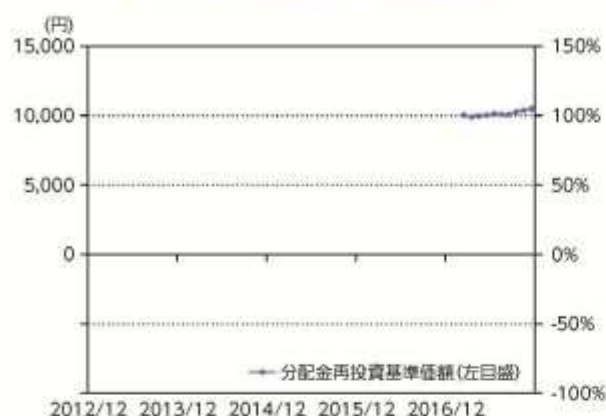
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

\*当ファンド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12月～2017年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>#1</sup>

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

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>#3</sup>

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>#4</sup>

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>#5</sup>

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

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

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している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付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率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。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※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】

## (1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

1：「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます（以下同

じ。 )。

「分配金再投資コース」( 2 )において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

2: 収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」( 税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース)と「分配金再投資コース」( 税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース)の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記 及び の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ: <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル: 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

## ( 2 ) 【換金 ( 解約 ) 手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額 ( ) の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

## ( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.54% ( 税抜 0.5% ) を乗じて得た額とします ( 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 )。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.216% ( 税抜 0.2% )	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.27% ( 税抜 0.25% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% ( 税抜 0.05% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息 ( 「諸経費」といいます。 ) は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します ( マザーファンドにおいて負担する場合があります。 )。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示していません。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま  
す（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りで  
す。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び  
譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離  
課税を選択したものに限りま。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。



## 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

## 個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

上記は、平成29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。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

以下は、平成29年11月30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	18,081,781	95.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		858,597	4.53

合計(純資産総額)	18,940,378	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	2,984,763	1.3534	4,039,716	1.3677	4,082,260	21.55
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	3,112,008	1.2216	3,801,879	1.2481	3,884,097	20.51
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	3,479,931	1.0108	3,517,673	0.9965	3,467,751	18.31
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	2,348,264	1.3853	3,253,280	1.3854	3,253,284	17.18
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	1,737,597	1.0352	1,798,821	1.0157	1,764,877	9.32
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	1,071,413	1.4569	1,560,951	1.5209	1,629,512	8.60

(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。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.47
合計	95.47

(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
第2期計算期間末	(平成29年11月10日)	22,037,960	22,037,960	10,413	10,413
	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	
	6月末日	24,624,686		10,120	
	7月末日	21,772,992		10,072	
	8月末日	20,091,908		10,059	
	9月末日	22,110,674		10,270	
	10月末日	22,853,343		10,350	
	11月末日	18,940,378		10,470	

## 【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
第2期計算期間	平成29年 5月11日～平成29年11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
第2期計算期間	平成29年 5月11日～平成29年11月10日	3.0

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 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
第2期計算期間	平成29年 5月11日～平成29年11月10日	12,992,874	15,046,358	21,163,451

(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	2,442,660,630	98.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		37,733,294	1.52
合計（純資産総額）		2,480,393,924	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	35,940,000	1.45

(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	協和エクシオ	建設業	24,900	1,892.85	47,132,010	2,698.00	67,180,200	2.71
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	17,700	4,066.50	71,977,128	3,720.00	65,844,000	2.65
日本	株式	大東建託	建設業	3,200	17,525.45	56,081,456	20,545.00	65,744,000	2.65
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	22,400	2,687.96	60,210,389	2,907.50	65,128,000	2.63
日本	株式	ローソン	小売業	8,400	7,533.55	63,281,828	7,740.00	65,016,000	2.62
日本	株式	ケースホールディングス	小売業	22,400	2,248.48	50,365,989	2,896.00	64,870,400	2.62
日本	株式	センコーグループホールディングス	陸運業	80,400	749.71	60,276,800	802.00	64,480,800	2.60
日本	株式	りそなホールディングス	銀行業	104,700	591.68	61,949,202	595.90	62,390,730	2.52
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	12,400	4,643.57	57,580,280	4,960.00	61,504,000	2.48
日本	株式	KDDI	情報・通信業	19,000	2,998.37	56,969,218	3,215.00	61,085,000	2.46
日本	株式	光通信	情報・通信業	3,700	11,474.75	42,456,595	16,180.00	59,866,000	2.41
日本	株式	イオンフィナンシャルサービス	その他金融業	23,600	2,237.08	52,795,191	2,491.00	58,787,600	2.37
日本	株式	電源開発	電気・ガス業	17,600	2,827.23	49,759,300	3,120.00	54,912,000	2.21
日本	株式	ラウンドワン	サービス業	30,700	1,181.07	36,259,024	1,728.00	53,049,600	2.14

日本	株式	ユナイテッドアローズ	小売業	12,500	3,363.23	42,040,421	4,240.00	53,000,000	2.14
日本	株式	D C Mホールディングス	小売業	46,900	961.78	45,107,646	1,085.00	50,886,500	2.05
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	35,300	1,408.66	49,726,008	1,426.00	50,337,800	2.03
日本	株式	阪和興業	卸売業	11,100	3,999.45	44,393,920	4,525.00	50,227,500	2.02
日本	株式	平和	機械	25,900	2,487.24	64,419,532	1,938.00	50,194,200	2.02
日本	株式	サトーホールディングス	機械	15,400	2,647.46	40,771,034	3,150.00	48,510,000	1.96
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	8,200	5,232.63	42,907,566	5,879.00	48,207,800	1.94
日本	株式	ダイワボウホールディングス	卸売業	10,900	4,338.76	47,292,520	4,390.00	47,851,000	1.93
日本	株式	住友倉庫	倉庫・運輸関連業	60,000	706.65	42,399,000	796.00	47,760,000	1.93
日本	株式	伊藤忠テクノソリューションズ	情報・通信業	10,000	3,850.71	38,507,167	4,725.00	47,250,000	1.90
日本	株式	東京センチュリー	その他金融業	9,200	4,293.77	39,502,712	5,090.00	46,828,000	1.89
日本	株式	芙蓉総合リース	その他金融業	6,100	5,894.29	35,955,220	7,450.00	45,445,000	1.83
日本	株式	ほくほくフィナンシャルグループ	銀行業	27,000	1,734.61	46,834,709	1,675.00	45,225,000	1.82
日本	株式	カブコン	情報・通信業	14,000	2,736.76	38,314,701	3,200.00	44,800,000	1.81
日本	株式	カネカ	化学	45,000	857.45	38,585,360	992.00	44,640,000	1.80
日本	株式	大林組	建設業	30,600	1,329.31	40,677,016	1,452.00	44,431,200	1.79

(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	8.88
		食料品	2.65
		パルプ・紙	1.66
		化学	4.84
		医薬品	6.68
		金属製品	1.70
		機械	3.98
		電気・ガス業	5.25
		陸運業	2.60
		倉庫・運輸関連業	1.93
		情報・通信業	13.16
		卸売業	5.58
		小売業	12.69
		銀行業	9.29
		保険業	2.48
		その他金融業	7.88
		不動産業	3.38
サービス業	3.86		

	小計	98.48
合計		98.48

(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	20円		34,604,078	35,940,000	1.45

(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	2,012,250,684	92.91
	アイルランド	83,209,603	3.84
	小計	2,095,460,287	96.75
投資信託受益証券	アメリカ	17,544,228	0.81
投資証券	アメリカ	43,443,297	2.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,358,958	0.43
合計(純資産総額)		2,165,806,770	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		560,100	0.03

(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	HORMEL FOODS CORP	食品・飲料・タバコ	12,110	3,715.01	44,988,835	4,032.67	48,835,749	2.25
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	4,166	8,947.44	37,275,073	10,931.59	45,541,037	2.10
アメリカ	株式	CLOROX COMPANY	家庭用品・パーソナル用品	2,882	15,174.07	43,731,683	15,599.60	44,958,050	2.08
アメリカ	株式	GRAINGER (WW) INC	資本財	1,848	19,989.94	36,941,418	24,289.07	44,886,217	2.07
アメリカ	株式	BECTON DICKINSON & CO	ヘルスケア機器・サービス	1,737	22,505.69	39,092,387	25,421.90	44,157,847	2.04
アメリカ	株式	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	食品・生活必需品小売り	5,447	8,371.26	45,598,292	8,058.63	43,895,390	2.03
アメリカ	株式	KIMBERLY-CLARK CORP	家庭用品・パーソナル用品	3,272	13,746.85	44,979,711	13,349.63	43,680,012	2.02
アメリカ	株式	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	食品・飲料・タバコ	6,556	5,844.36	38,315,661	6,633.35	43,488,308	2.01
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST		2,935	14,248.78	41,820,198	14,801.80	43,443,297	2.01
アメリカ	株式	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	素材	2,383	16,809.76	40,057,671	18,221.57	43,422,004	2.00
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,310	12,888.45	42,660,796	13,091.92	43,334,262	2.00
アメリカ	株式	SYSCO CORP	食品・生活必需品小売り	6,696	5,931.65	39,718,359	6,465.28	43,291,548	2.00
アメリカ	株式	PRICE T ROWE GROUP INC	各種金融	3,799	8,964.20	34,055,014	11,347.30	43,108,406	1.99
アメリカ	株式	ILLINOIS TOOL WORKS	資本財	2,314	16,547.09	38,289,982	18,586.85	43,009,980	1.99
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	10,515	4,081.25	42,914,440	4,087.58	42,980,946	1.98
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	3,998	8,950.55	35,784,306	10,736.63	42,925,051	1.98
アイルランド	株式	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア機器・サービス	4,660	9,439.28	43,987,052	9,200.42	42,873,983	1.98
アメリカ	株式	VF CORP	耐久消費財・アパレル	5,146	6,776.13	34,869,972	8,306.26	42,744,048	1.97
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,237	17,654.36	39,492,814	19,096.68	42,719,277	1.97
アメリカ	株式	AFLAC	保険	4,335	8,918.86	38,663,277	9,769.63	42,351,387	1.96
アメリカ	株式	CONSOLIDATED EDISON INC	公益事業	4,274	9,496.30	40,587,199	9,905.21	42,334,910	1.95
アメリカ	株式	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	食品・飲料・タバコ	3,697	11,096.44	41,023,553	11,442.54	42,303,093	1.95
アメリカ	株式	GENUINE PARTS CO	小売	4,123	9,892.47	40,786,659	10,252.57	42,271,367	1.95
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	4,214	10,008.64	42,176,433	10,015.02	42,203,332	1.95

アメリカ	株式	BARD C R INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	1,117	35,921.16	40,123,943	37,739.56	42,155,089	1.95
アメリカ	株式	LOWES COMPANIES	小売	4,516	8,785.39	39,674,827	9,333.76	42,151,283	1.95
アメリカ	株式	ECOLAB INC	素材	2,771	14,649.20	40,592,942	15,126.74	41,916,224	1.94
アメリカ	株式	CINTAS CORP	商業・専門 サービス	2,430	15,070.31	36,620,867	17,225.44	41,857,835	1.93
アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	2,264	16,814.83	38,068,791	18,457.99	41,788,904	1.93
アメリカ	株式	3 M COMPANY	資本財	1,562	24,036.14	37,544,453	26,669.02	41,657,010	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	3.73
		素材	9.57
		資本財	15.30
		商業・専門サービス	1.93
		耐久消費財・アパレル	3.85
		消費者サービス	1.97
		小売	5.76
		食品・生活必需品小売り	6.13
		食品・飲料・タバコ	11.81
		家庭用品・パーソナル用品	7.94
		ヘルスケア機器・サービス	9.56
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.85
		各種金融	5.75
		保険	3.82
		ソフトウェア・サービス	1.85
		電気通信サービス	1.98
	公益事業	1.95	
	小計	96.75	
投資信託受益証券			0.81
投資証券			2.01
合計			99.57

(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	5,000.00	560,168	560,100	0.03

(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	279,111,422,850	82.36
地方債証券	日本	19,446,123,409	5.74
特殊債券	日本	24,496,108,203	7.23
社債券	日本	12,613,110,970	3.72
	フランス	801,794,000	0.24
	オーストラリア	401,235,000	0.12
	オランダ	201,082,000	0.06
	スウェーデン	200,562,000	0.06
	イギリス	100,846,000	0.03
	小計		14,318,629,970
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,512,942,269	0.45
合計(純資産総額)		338,885,226,701	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	301,860,000	0.09

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	101.05	5,598,703,700	100.97	5,593,738,000	0.100	2022/3/20	1.65
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,360,000,000	100.97	4,402,608,100	101.06	4,406,216,000	0.100	2022/9/20	1.30
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	4,060,000,000	100.61	4,084,766,000	100.78	4,091,992,800	0.100	2027/3/20	1.21
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	100.77	3,819,410,400	0.100	2021/3/20	1.13
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,680,000,000	103.40	3,805,431,900	103.40	3,805,340,800	0.400	2025/6/20	1.12
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.89	3,642,318,700	101.00	3,646,244,400	0.100	2022/6/20	1.08
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	100.68	3,634,800,700	0.100	2020/9/20	1.07
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	100.50	3,537,670,400	0.100	2019/12/20	1.04
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	100.54	3,528,989,100	0.200	2019/6/20	1.04
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	100.45	3,314,916,000	0.200	2019/3/20	0.98
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	100.87	3,228,064,000	0.100	2021/9/20	0.95
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	100.56	3,157,678,200	0.100	2020/3/20	0.93
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,030,000,000	102.61	3,109,220,800	102.66	3,110,598,000	0.300	2025/12/20	0.92
日本	国債証券	第377回利付国債(2年)	3,050,000,000	100.49	3,065,027,300	100.40	3,062,383,000	0.100	2019/6/15	0.90
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,920,000,000	103.44	3,020,581,600	103.44	3,020,448,000	0.400	2025/9/20	0.89
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	100.71	2,981,252,800	0.100	2020/12/20	0.88
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	104.75	2,922,757,000	104.43	2,913,792,300	0.600	2024/6/20	0.86
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	101.03	2,626,988,000	0.100	2026/3/20	0.78
日本	国債証券	第379回利付国債(2年)	2,600,000,000	100.50	2,613,131,700	100.45	2,611,700,000	0.100	2019/8/15	0.77
日本	国債証券	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	100.47	2,592,204,000	100.49	2,592,771,000	0.100	2019/10/15	0.77
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	100.62	2,576,102,400	0.200	2019/9/20	0.76
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	100.98	2,554,869,900	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,450,000,000	104.57	2,562,045,400	104.06	2,549,568,000	1.200	2020/12/20	0.75
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	2,530,000,000	100.46	2,541,827,700	100.76	2,549,253,300	0.100	2027/6/20	0.75
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	103.33	2,531,708,200	103.40	2,533,447,000	0.400	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,400,000,000	104.09	2,498,160,000	103.92	2,494,224,000	0.500	2024/9/20	0.74
日本	国債証券	第309回利付国債(10年)	2,340,000,000	103.60	2,424,414,800	103.15	2,413,710,000	1.100	2020/6/20	0.71
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,320,000,000	103.99	2,412,756,000	103.72	2,406,350,400	0.600	2023/3/20	0.71
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	104.38	2,390,439,400	0.800	2022/9/20	0.71
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	104.98	2,362,185,000	0.800	2023/6/20	0.70



(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	5.74
特殊債券	7.23
社債券	4.23
合計	99.55

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	2円		302,080,648	301,860,000	0.09

(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	194,931,730	98.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,370,083	1.70
合計(純資産総額)		198,301,813	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% 08/15/25	40,000	11,006.76	4,402,704	10,956.44	4,382,578	2.000	2025/8/15	2.21
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	30,000	11,239.46	3,371,840	11,190.62	3,357,188	2.250	2024/11/15	1.69
アメリカ	国債証券	T 3.125% 02/15/43	20,000	11,945.52	2,389,105	11,879.02	2,375,805	3.125	2043/2/15	1.20
アメリカ	国債証券	T 3% 05/15/45	20,000	11,664.28	2,332,856	11,608.26	2,321,652	3.000	2045/5/15	1.17
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	20,000	11,602.89	2,320,578	11,543.37	2,308,675	2.750	2024/2/15	1.16
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	20,000	11,464.30	2,292,861	11,433.76	2,286,752	3.125	2019/5/15	1.15
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	20,000	11,432.84	2,286,568	11,374.75	2,274,951	2.500	2024/5/15	1.15
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	20,000	11,339.32	2,267,865	11,283.79	2,256,759	2.375	2024/8/15	1.14
アメリカ	国債証券	T 2% 02/28/21	20,000	11,275.31	2,255,062	11,235.35	2,247,070	2.000	2021/2/28	1.13
アメリカ	国債証券	T 2% 05/31/21	20,000	11,265.11	2,253,022	11,224.17	2,244,834	2.000	2021/5/31	1.13
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	20,000	11,195.80	2,239,161	11,181.36	2,236,273	1.500	2019/1/31	1.13
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	20,000	11,192.52	2,238,504	11,142.82	2,228,565	2.250	2025/11/15	1.12
アメリカ	国債証券	T 1% 03/15/19	20,000	11,120.18	2,224,037	11,103.97	2,220,795	1.000	2019/3/15	1.12
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	20,000	11,119.66	2,223,932	11,070.74	2,214,148	2.125	2025/5/15	1.12
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	20,000	11,069.27	2,213,854	11,028.60	2,205,720	1.750	2022/9/30	1.11
アメリカ	国債証券	T 1.375% 05/31/21	20,000	11,021.92	2,204,385	10,984.81	2,196,963	1.375	2021/5/31	1.11
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	20,000	10,948.27	2,189,655	10,903.92	2,180,785	1.625	2023/4/30	1.10
アメリカ	国債証券	T 1.125% 07/31/21	20,000	10,906.03	2,181,207	10,868.55	2,173,711	1.125	2021/7/31	1.10
アメリカ	国債証券	T 1.375% 06/30/23	20,000	10,784.48	2,156,898	10,738.69	2,147,738	1.375	2023/6/30	1.08
アメリカ	国債証券	T 1.25% 07/31/23	20,000	10,698.71	2,139,744	10,653.37	2,130,674	1.250	2023/7/31	1.07
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	20,000	10,623.09	2,124,619	10,582.95	2,116,591	1.625	2026/5/15	1.07
アメリカ	国債証券	T 6.25% 05/15/30	10,000	15,895.12	1,589,512	15,784.81	1,578,481	6.250	2030/5/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 4.75% 02/15/41	10,000	15,169.07	1,516,907	15,080.46	1,508,046	4.750	2041/2/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/40	10,000	14,859.91	1,485,991	14,774.64	1,477,464	4.625	2040/2/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 4.5% 02/15/36	10,000	14,474.44	1,447,444	14,391.12	1,439,112	4.500	2036/2/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 4.375% 05/15/41	10,000	14,449.88	1,444,988	14,370.07	1,437,007	4.375	2041/5/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/15/39	10,000	14,373.54	1,437,354	14,295.13	1,429,513	4.375	2039/11/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 4.375% 02/15/38	10,000	14,326.44	1,432,644	14,247.14	1,424,714	4.375	2038/2/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 3.75% 11/15/43	10,000	13,261.48	1,326,148	13,186.94	1,318,694	3.750	2043/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	10,000	13,005.19	1,300,519	12,932.31	1,293,231	3.625	2044/2/15	0.65

(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	98.30
合計	98.30

(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 - R E I T 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	84,156,330,400	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,995,521,749	2.32
合計(純資産総額)		86,151,852,149	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	1,985,742,000	2.30

(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	10,732	536,083.26	5,753,245,631	563,000	6,042,116,000	7.01
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,476	519,091.34	5,438,000,893	546,000	5,719,896,000	6.64
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,796	137,710.45	4,378,641,563	141,700	4,505,493,200	5.23
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,321	199,106.22	4,245,143,921	199,300	4,249,275,300	4.93
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,444	160,008.08	3,911,237,699	159,300	3,893,929,200	4.52
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,383	153,312.04	3,278,271,460	157,700	3,372,099,100	3.91
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	13,940	232,822.2	3,245,541,603	241,100	3,360,934,000	3.90
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	11,399	258,135.25	2,942,483,745	269,400	3,070,890,600	3.56
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,261	263,033.25	2,698,984,261	273,700	2,808,435,700	3.26
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,997	359,542.23	2,515,717,004	377,500	2,641,367,500	3.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,988	75,108.92	2,402,584,273	78,200	2,501,461,600	2.90
日本	投資証券	G L P 投資法人	19,403	111,523.15	2,163,883,698	121,500	2,357,464,500	2.74

日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,790	444,063.05	2,127,062,046	465,500	2,229,745,000	2.59
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,239	590,075.32	1,911,253,985	632,000	2,047,048,000	2.38
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,770	439,556.19	1,657,126,843	457,000	1,722,890,000	2.00
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,683	437,052.41	1,609,664,031	454,000	1,672,082,000	1.94
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,906	131,210.34	1,562,190,339	137,600	1,638,265,600	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	7,383	203,410.49	1,501,779,711	207,500	1,531,972,500	1.78
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,011	464,055.78	1,397,271,960	491,500	1,479,906,500	1.72
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	30,396	46,605.86	1,416,631,770	48,150	1,463,567,400	1.70
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	9,925	130,611.53	1,296,319,494	135,000	1,339,875,000	1.56
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,390	548,025.19	1,309,780,214	556,000	1,328,840,000	1.54
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	7,921	159,511.51	1,263,490,695	164,000	1,299,044,000	1.51
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,527	157,912.93	1,188,610,691	165,300	1,244,213,100	1.44
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,525	113,509.86	1,194,691,356	116,900	1,230,372,500	1.43
日本	投資証券	プレミアム投資法人	10,010	99,411.82	995,112,374	105,600	1,057,056,000	1.23
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	12,466	78,310.84	976,223,036	83,000	1,034,678,000	1.20
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,431	131,618.3	978,055,602	138,900	1,032,165,900	1.20
日本	投資証券	日本リート投資法人	2,978	326,023.25	970,897,265	337,000	1,003,586,000	1.16
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,042	230,023.04	929,753,141	240,900	973,717,800	1.13

(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	97.68
合計	97.68

(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	1,188	円	1,910,506,290	1,985,742,000	2.30

(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	2,832,399	2.95
投資証券	アメリカ	91,305,902	95.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,894,523	1.97
合計(純資産総額)		96,032,824	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	304	18,546.51	5,638,141	17,785.69	5,406,852	5.63
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	517	7,232.82	3,739,372	7,409.86	3,830,901	3.99
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	146	24,114.27	3,520,684	23,559.63	3,439,706	3.58
アメリカ	投資信託受益証券	VANGUARD REIT ETF	300	9,426.76	2,828,029	9,441.33	2,832,399	2.95
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	134	20,236.23	2,711,655	20,397.58	2,733,276	2.85
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	357	7,639.56	2,727,326	7,538.72	2,691,324	2.80
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	355	7,402.02	2,627,718	7,478.21	2,654,767	2.76
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	198	13,880.75	2,748,389	13,108.72	2,595,528	2.70
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	344	7,061.38	2,429,118	7,179.04	2,469,591	2.57
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	148	13,852.74	2,050,206	14,011.85	2,073,754	2.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	63	29,126.26	1,834,955	27,752.53	1,748,410	1.82
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	262	6,298.32	1,650,162	6,215.41	1,628,438	1.70
アメリカ	投資証券	GGP INC	595	2,382.18	1,417,399	2,621.96	1,560,072	1.62
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	703	2,221.95	1,562,032	2,204.02	1,549,429	1.61
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	163	8,386.94	1,367,072	8,620.00	1,405,061	1.46
アメリカ	投資証券	HCP INC	446	2,953.63	1,317,323	3,014.14	1,344,309	1.40
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	480	2,551.14	1,224,548	2,634.29	1,264,462	1.32
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	88	13,822.48	1,216,379	14,226.98	1,251,975	1.30
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	107	11,775.33	1,259,961	11,457.11	1,225,911	1.28
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	248	4,589.56	1,138,213	4,540.26	1,125,986	1.17
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	118	9,154.48	1,080,229	9,530.97	1,124,655	1.17
アメリカ	投資証券	JDR INC	251	4,316.16	1,083,357	4,410.28	1,106,982	1.15
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	334	3,236.00	1,080,826	3,210.23	1,072,218	1.12
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	92	11,054.84	1,017,046	11,454.86	1,053,848	1.10
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	138	7,213.77	995,501	7,619.39	1,051,477	1.09
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	67	14,256.11	955,160	14,801.80	991,721	1.03
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	130	6,938.13	901,957	6,721.87	873,844	0.91

アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	85	10,372.47	881,660	10,262.65	872,326	0.91
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	395	2,136.79	844,034	2,069.56	817,478	0.85
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	80	9,834.62	786,770	10,044.16	803,533	0.84

(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	2.95
投資証券	95.08
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

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11月30日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額 10,470円

純資産総額 0.19億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

### 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2017年5月	2017年11月	-	-	-
分配金	0円	0円	-	-	-

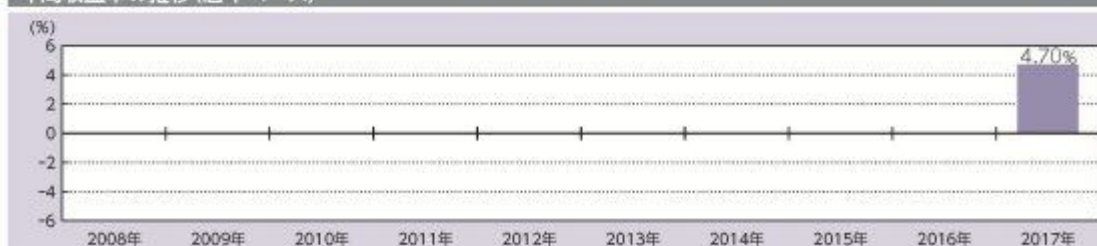
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

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
日本株連当資産インデックス マザーファンド	21.6%	協和エクシオ	日本	株式	建設業	-	-	0.6%
		日本たばこ産業	日本	株式	食料品	-	-	0.6%
米国株連当資産インデックス マザーファンド	20.5%	HORMEL FOODS CORP	アメリカ	株式	食品・飲料・タ/イコ	-	-	0.5%
		WAL-MART STORES	アメリカ	株式	食品・生活必需品小売り	-	-	0.4%
米国国債インデックス マザーファンド	18.3%	T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.4%
		T 2.25% 11/15/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/11/15	0.3%
国内債券インデックス マザーファンド	17.2%	第131回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.3%
		第133回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/09/20	0.2%
米国REITインデックス マザーファンド	9.3%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
		PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%
J-REITインデックス マザーファンド	8.6%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%

※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2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### < 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替



機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

#### < 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

#### < 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事

情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記〈解約価額〉の規定に準じて計算された価額とします。

#### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### <その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

## マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

## (イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

## (ロ) 外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

## (ハ) 公社債等

計算日（ ）における次のa. からc. までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

## 外貨建資産等の円換算

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

## &lt; 基準価額の照会方法 &gt;

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

## (照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限とします。（平成29年 2月27日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4) 【計算期間】

原則として、毎年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日までとします。

ただし、第1計算期間は平成29年2月27日から平成29年5月10日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## （５）【その他】

### <投資信託契約の終了（償還）と手続き>

#### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

#### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（１）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

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

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

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

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

### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

#### (1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当するものを除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

### < 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同

じ。)から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

### (3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を

有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年 5月11日から平成29年11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)	第2期 (平成29年11月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	938,977	1,019,245
親投資信託受益証券	22,658,539	21,142,923
未収入金	16,186	996,395
流動資産合計	23,613,702	23,158,563
資産合計	23,613,702	23,158,563
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	132,870	1,060,103
未払受託者報酬	1,602	6,002
未払委託者報酬	14,382	53,962
未払利息	1	1
その他未払費用	136	535
流動負債合計	148,991	1,120,603
負債合計	148,991	1,120,603
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	23,216,935	21,163,451
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	247,776	874,509
(分配準備積立金)	348,980	834,071
元本等合計	23,464,711	22,037,960
純資産合計	23,464,711	22,037,960
負債純資産合計	23,613,702	23,158,563

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成29年 2月27日 至 平成29年 5月10日	自	平成29年 5月11日 至 平成29年11月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		353,302		754,581
営業収益合計		353,302		754,581
営業費用				
支払利息		57		259
受託者報酬		1,602		6,002
委託者報酬		14,382		53,962
その他費用		136		535
営業費用合計		16,177		60,758
営業利益又は営業損失（ ）		337,125		693,823
経常利益又は経常損失（ ）		337,125		693,823
当期純利益又は当期純損失（ ）		337,125		693,823
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		34,584
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		247,776
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,001		114,783
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		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		114,783
剰余金減少額又は欠損金増加額		104,205		147,289
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		147,289
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		874,509

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成29年 5月10日現在)	第2期 (平成29年11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	21,163,451口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0107円 (10,107円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0413円 (10,413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			第2期 自 平成29年 5月11日 至 平成29年11月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	96,682円	費用控除後の配当等収益額	A	213,359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	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	445,880円
収益調整金額	C	73,125円	収益調整金額	C	235,556円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	174,832円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	422,105円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,069,627円
当ファンドの期末残存口数	F	23,216,935口	当ファンドの期末残存口数	F	21,163,451口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	181円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	505円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 平成29年 5月11日 至 平成29年11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に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第2期 (平成29年11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	第2期
	自 平成29年 2月27日 至 平成29年 5月10日	自 平成29年 5月11日 至 平成29年11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	23,216,935円
期中追加設定元本額	23,819,189円	12,992,874円
期中一部解約元本額	1,102,254円	15,046,358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)	第2期 (平成29年11月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	360,589	735,636
合計	360,589	735,636

## （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	1,270,688	1,851,011	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,788,072	3,862,873	
	米国REITインデックス マザーファンド	2,051,703	2,124,333	
	日本株配当貴族インデックスマザーファンド	3,468,376	4,694,793	
	米国株配当貴族インデックスマザーファンド	3,637,883	4,444,765	
	米国国債インデックスマザーファンド	4,119,830	4,165,148	
合計		17,336,552	21,142,923	

(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11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,331,020
株式	2,417,296,250
派生商品評価勘定	1,627,518
未収配当金	25,004,350
差入委託証拠金	406,500
流動資産合計	2,457,665,638
資産合計	2,457,665,638
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,094
前受金	1,581,800
未払解約金	959,566
未払利息	23
流動負債合計	2,588,483
負債合計	2,588,483
純資産の部	
元本等	
元本	1,813,740,900
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	641,336,255

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	2,455,077,155
純資産合計	2,455,077,155
負債純資産合計	2,457,665,638

## 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11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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。  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。
3. 収益及び費用の計上基準	(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。  (2) 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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,813,740,900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 1.3536円 (1万口当たり純資産額) (13,536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11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。
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11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (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。



	平成29年11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>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11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 5月11日
期首元本額	264,610,583円
期中追加設定元本額	1,696,554,725円
期中一部解約元本額	147,424,408円
期末元本額	1,813,740,900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	1,810,272,524円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	3,468,376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11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	162,325,615

合計	162,325,615
----	-------------

(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11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	36,030,576	-	37,611,000	1,580,424
	合計	36,030,576	-	37,611,000	1,580,424

(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ではありません。

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)	
大林組	30,600	1,525.00	46,665,000	
大東建託	3,200	20,380.00	65,216,000	
住友林業	22,200	1,876.00	41,647,200	
協和エクシオ	24,900	2,393.00	59,585,700	
日本たばこ産業	17,700	3,799.00	67,242,300	
レンゴー	56,400	745.00	42,018,000	
カネカ	45,000	965.00	43,425,000	
ダイセル	28,800	1,304.00	37,555,200	
アース製薬	6,400	5,410.00	34,624,000	
アステラス製薬	35,300	1,495.00	52,773,500	
田辺三菱製薬	14,500	2,423.00	35,133,500	
科研製薬	7,900	5,800.00	45,820,000	
沢井製薬	6,500	6,450.00	41,925,000	
LIXILグループ	14,300	2,960.00	42,328,000	
サトーホールディングス	15,400	3,175.00	48,895,000	
平和	25,900	2,173.00	56,280,700	
電源開発	17,600	3,240.00	57,024,000	

東京瓦斯	12,800	2,826.00	36,172,800
大阪瓦斯	19,300	2,231.00	43,058,300
センコーグループホールディングス	80,400	780.00	62,712,000
住友倉庫	60,000	798.00	47,880,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,000	4,710.00	47,100,000
日本電信電話	8,200	5,752.00	47,166,400
KDDI	19,000	3,090.00	58,710,000
光通信	3,700	15,130.00	55,981,000
NTTドコモ	22,400	2,835.00	63,504,000
カブコン	14,000	3,210.00	44,940,000
ダイワボウホールディングス	10,900	4,445.00	48,450,500
第一興商	7,500	5,290.00	39,675,000
阪和興業	11,100	4,285.00	47,563,500
ローソン	8,400	7,530.00	63,252,000
DCMホールディングス	46,900	1,062.00	49,807,800
セブン&アイ・ホールディングス	8,600	4,667.00	40,136,200
ユナイテッドアローズ	12,500	3,910.00	48,875,000
ケーズホールディングス	22,400	2,668.00	59,763,200
アークス	16,000	2,624.00	41,984,000
りそなホールディングス	104,700	604.50	63,291,150
千葉銀行	45,000	839.00	37,755,000
静岡銀行	39,000	1,059.00	41,301,000
南都銀行	13,500	3,100.00	41,850,000
ほくほくフィナンシャルグループ	27,000	1,766.00	47,682,000
東京海上ホールディングス	12,400	4,804.00	59,569,600
芙蓉総合リース	6,100	7,290.00	44,469,000
東京センチュリー	9,200	4,855.00	44,666,000
イオンフィナンシャルサービス	23,600	2,403.00	56,710,800
三菱UFJリース	69,400	596.00	41,362,400
パーク24	15,900	2,629.00	41,801,100
スターツコーポレーション	14,500	2,899.00	42,035,500
ラウンドワン	30,700	1,487.00	45,650,900
ユー・エス・エス	18,000	2,459.00	44,262,000
合計	1,195,700		2,417,296,250

## (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11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,101,778
コール・ローン	7,803,800
株式	1,579,339,924
投資証券	33,653,190
未収配当金	2,201,537
流動資産合計	1,626,100,229
資産合計	1,626,100,229
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32
未払解約金	7,222,922
未払利息	13
流動負債合計	7,222,967
負債合計	7,222,967
純資産の部	
元本等	
元本	1,325,013,972
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	293,863,290
元本等合計	1,618,877,262
純資産合計	1,618,877,262
負債純資産合計	1,626,100,229

## 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11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</p> <p>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) 投資証券</p>

平成29年11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>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>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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,325,013,972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 1.2218円 (1万口当たり純資産額) (12,218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11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11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (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。

	平成29年11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>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11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 5月11日
期首元本額	667,755,856円
期中追加設定元本額	3,643,398,507円
期中一部解約元本額	2,986,140,391円
期末元本額	1,325,013,972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	487,288,131円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	3,637,883円
米国株配当貴族インデックス（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	834,087,958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11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	58,692,275
投資証券	1,452,276
合計	60,144,551

(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11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	1,133,732	-	1,133,700	32
	アメリカドル	1,133,732	-	1,133,700	32
合計		1,133,732	-	1,133,700	32

(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	2,365	117.24	277,272.60	
	EXXON MOBIL	3,378	83.97	283,650.66	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	1,833	160.55	294,288.15	
	ECOLAB INC	2,132	130.25	277,693.00	
	NUCOR CORP	4,717	56.52	266,604.84	
	PPG INDUSTRIES INC	2,399	115.13	276,196.87	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	719	387.03	278,274.57	
	3 M COMPANY	1,204	228.39	274,981.56	
	DOVER CORP	2,941	94.01	276,483.41	
	EMERSON ELECTRIC CO	4,212	61.48	258,953.76	
	GENERAL DYNAMICS CORP	1,330	198.87	264,497.10	



GRAINGER (WWW) INC	1,422	206.07	293,031.54
ILLINOIS TOOL WORKS	1,781	156.35	278,459.35
PENTAIR PLC	3,995	68.17	272,339.15
STANLEY BLACK&DECKER	1,701	162.85	277,007.85
CINTAS CORP	1,869	145.43	271,808.67
LEGGETT & PLATT INC	5,808	45.88	266,471.04
VF CORP	3,959	69.36	274,596.24
MCDONALD'S CORP	1,721	167.00	287,407.00
GENUINE PARTS CO	3,172	85.56	271,396.32
LOWES COMPANIES	3,475	78.08	271,328.00
TARGET (DAYTON HUDSON)	4,481	59.90	268,411.90
SYSCO CORP	5,152	54.02	278,311.04
WAL-MART STORES	3,205	90.30	289,411.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	4,191	69.54	291,442.14
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,449	39.60	255,380.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,044	56.77	286,347.88
COCA-COLA CO	6,107	46.23	282,326.61
HORMEL FOODS CORP	9,316	31.95	297,646.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,844	95.51	271,630.44
PEPSICO INC	2,546	111.48	283,828.08
CLOROX COMPANY	2,217	130.68	289,717.56
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,925	72.91	286,171.75
KIMBERLY-CLARK CORP	2,517	113.29	285,150.93
PROCTER & GAMBLE CO	3,242	87.78	284,582.76
ABBOTT LABORATORIES	5,092	55.45	282,351.40
BARD C R INC	859	335.28	288,005.52
BECTON DICKINSON & CO	1,337	224.48	300,129.76
CARDINAL HEALTH	4,244	60.56	257,016.64
MEDTRONIC PLC	3,585	80.81	289,703.85
ABBVIE INC	3,076	95.89	294,957.64
JOHNSON & JOHNSON	1,991	140.35	279,436.85
FRANKLIN RESOURCES INC	6,295	41.33	260,172.35
PRICE T ROWE GROUP INC	2,923	92.72	271,020.56
S&P GLOBAL INC	1,742	157.91	275,079.22
AFLAC	3,335	84.08	280,406.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,698	73.10	270,323.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	2,442	111.97	273,430.74
AT&T INC	8,089	34.00	275,026.00
CONSOLIDATED EDISON INC	3,288	87.66	288,226.08
アメリカドル 小計	169,365		13,928,388.08 (1,579,339,924)
	169,365		1,579,339,924

合 計			(1,579,339,924)
-----	--	--	-----------------

## (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
投資証券	アメリカドル	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,258	296,791.52	
		アメリカドル 小計	2,258	296,791.52 (33,653,190)	
		合計	2,258	33,653,190 (33,653,190)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 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	組入株式 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	97.9%		97.9%
	投資証券 1銘柄		2.1%	2.1%

(注) 時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 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11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,149,907,793
国債証券	276,404,191,350
地方債証券	18,844,527,193

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
特殊債券	23,705,857,967
社債券	14,122,793,790
未収利息	686,518,306
前払費用	31,149,970
差入委託証拠金	80,000
流動資産合計	334,945,026,369
資産合計	334,945,026,369
負債の部	
流動負債	
未払金	579,806,444
未払解約金	175,707,328
未払利息	2,062
流動負債合計	755,515,834
負債合計	755,515,834
純資産の部	
元本等	
元本	241,201,108,612
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,988,401,923
元本等合計	334,189,510,535
純資産合計	334,189,510,535
負債純資産合計	334,945,026,369

## 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11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、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	241,201,108,612口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 104,154,000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 1.3855円 (1万口当たり純資産額) (13,855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11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11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11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</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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11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 5月11日
期首元本額	216,063,047,401円
期中追加設定元本額	31,680,258,253円
期中一部解約元本額	6,542,197,042円
期末元本額	241,201,108,612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）	3,172,600,946円
S B I 資産設計オープン（分配型）	21,267,309円
S M T 国内債券インデックス・オープン	10,438,301,009円
世界経済インデックスファンド	1,407,263,009円
D C マイセレクション 2 5	16,959,719,961円
D C マイセレクション 5 0	20,645,282,027円
D C マイセレクション 7 5	5,654,928,917円

区分	平成29年11月10日現在
D C日本債券インデックス・オープン	452,512,478円
D C日本債券インデックス・オープンS	71,984,877,788円
D C日本債券インデックス・オープンP	32,497,922,699円
D CマイセレクションS 2 5	6,889,733,850円
D CマイセレクションS 5 0	8,201,931,232円
D CマイセレクションS 7 5	1,616,111,565円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	1,259,397,191円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	988,502,337円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	290,938,529円
D C世界経済インデックスファンド	991,207,638円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	136,829,955円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	10,080,112円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	102,851,752円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	18,223,345円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	973,098円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	362,795,670円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	557,595,544円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	97,688,915円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	234,033,529円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	5,900,144,786円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,237,797,604円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,439,295,073円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	993,432,913円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	290,623,715円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,643,950,684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）	1,624,564,266円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,770,875,117円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,562,414,455円
国内バランス2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	190,025,974円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,818,192,393円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,744,191,809円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	36,773,712円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	468,090,027円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	62,832,116円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,271,579円
S M T インデックスバランス・オープン	82,106,201円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	2,788,072円
S M T 世界経済インデックス・オープン	49,707円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	5,397,935円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	5,710,683円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	269,218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）	19,290,512,928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11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		480,779,450
地方債証券		47,920,793
特殊債券		60,052,563
社債券		12,924,470
合計		601,677,276

(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371回利付国債(2年)	760,000,000	762,432,000	
	第372回利付国債(2年)	920,000,000	923,174,000	
	第373回利付国債(2年)	140,000,000	140,519,400	
	第374回利付国債(2年)	620,000,000	622,399,400	
	第375回利付国債(2年)	1,340,000,000	1,345,507,400	
	第376回利付国債(2年)	1,840,000,000	1,848,004,000	
	第377回利付国債(2年)	3,050,000,000	3,064,030,000	
	第378回利付国債(2年)	1,680,000,000	1,688,131,200	
	第379回利付国債(2年)	2,600,000,000	2,613,234,000	
	第380回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,789,505,200	
	第381回利付国債(2年)	2,080,000,000	2,091,398,400	
	第382回利付国債(2年)	80,000,000	80,449,600	
	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	3,786,173,300	

第117回利付国債（5年）	3,300,000,000	3,317,127,000	
第118回利付国債（5年）	3,510,000,000	3,531,621,600	
第119回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,004,560,000	
第120回利付国債（5年）	2,560,000,000	2,578,278,400	
第121回利付国債（5年）	630,000,000	633,326,400	
第122回利付国債（5年）	3,520,000,000	3,539,641,600	
第123回利付国債（5年）	3,140,000,000	3,159,216,800	
第124回利付国債（5年）	1,950,000,000	1,962,948,000	
第125回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,635,811,500	
第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	2,982,081,600	
第127回利付国債（5年）	3,790,000,000	3,819,903,100	
第128回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,623,379,100	
第129回利付国債（5年）	3,200,000,000	3,227,840,000	
第130回利付国債（5年）	1,360,000,000	1,372,321,600	
第131回利付国債（5年）	5,540,000,000	5,593,184,000	
第132回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,646,713,700	
第133回利付国債（5年）	3,520,000,000	3,556,889,600	
第1回利付国債（40年）	150,000,000	214,090,500	
第2回利付国債（40年）	420,000,000	578,961,600	
第3回利付国債（40年）	420,000,000	581,553,000	
第4回利付国債（40年）	630,000,000	876,002,400	
第5回利付国債（40年）	490,000,000	654,591,000	
第6回利付国債（40年）	390,000,000	510,315,000	
第7回利付国債（40年）	690,000,000	861,216,600	
第8回利付国債（40年）	720,000,000	828,727,200	
第9回利付国債（40年）	970,000,000	803,121,200	
第10回利付国債（40年）	1,100,000,000	1,081,146,000	
第297回利付国債（10年）	560,000,000	569,800,000	
第298回利付国債（10年）	550,000,000	559,020,000	
第299回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,264,824,800	
第300回利付国債（10年）	830,000,000	848,857,600	
第301回利付国債（10年）	340,000,000	349,176,600	
第302回利付国債（10年）	200,000,000	205,078,000	
第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,430,879,900	
第304回利付国債（10年）	480,000,000	493,224,000	
第305回利付国債（10年）	1,910,000,000	1,969,133,600	
第306回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,213,102,800	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	724,143,000	
第308回利付国債（10年）	990,000,000	1,027,689,300	
第309回利付国債（10年）	1,610,000,000	1,662,904,600	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,456,389,000	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,109,354,400	



第3 1 2 回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,135,157,000	代用有価証券 100,000,000円
第3 1 3 回利付国債(10年)	240,000,000	251,529,600	
第3 1 4 回利付国債(10年)	310,000,000	322,809,200	
第3 1 5 回利付国債(10年)	2,070,000,000	2,169,090,900	
第3 1 6 回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,138,243,400	
第3 1 7 回利付国債(10年)	710,000,000	743,490,700	
第3 1 8 回利付国債(10年)	950,000,000	991,144,500	
第3 1 9 回利付国債(10年)	680,000,000	714,020,400	
第3 2 0 回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,171,419,200	
第3 2 1 回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,541,574,300	
第3 2 2 回利付国債(10年)	750,000,000	783,240,000	
第3 2 3 回利付国債(10年)	970,000,000	1,015,027,400	
第3 2 4 回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,333,504,000	
第3 2 5 回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,390,416,500	
第3 2 6 回利付国債(10年)	860,000,000	895,027,800	
第3 2 7 回利付国債(10年)	740,000,000	773,929,000	
第3 2 8 回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,784,207,600	
第3 2 9 回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,362,635,000	
第3 3 0 回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,514,908,800	
第3 3 1 回利付国債(10年)	580,000,000	603,350,800	
第3 3 2 回利付国債(10年)	2,230,000,000	2,322,924,100	
第3 3 3 回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,178,623,900	
第3 3 4 回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,913,876,000	
第3 3 5 回利付国債(10年)	2,400,000,000	2,493,288,000	
第3 3 6 回利付国債(10年)	610,000,000	634,802,600	
第3 3 7 回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,385,626,500	
第3 3 8 回利付国債(10年)	2,350,000,000	2,429,735,500	
第3 3 9 回利付国債(10年)	3,680,000,000	3,806,260,800	
第3 4 0 回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,021,148,800	
第3 4 1 回利付国債(10年)	2,900,000,000	2,977,691,000	
第3 4 2 回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,626,078,000	
第3 4 3 回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,553,933,800	
第3 4 4 回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,513,260,000	
第3 4 5 回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,026,441,800	
第3 4 6 回利付国債(10年)	4,160,000,000	4,191,033,600	
第3 4 7 回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,546,925,700	
第3 4 8 回利付国債(10年)	870,000,000	875,550,600	
第1 回利付国債(30年)	40,000,000	52,493,600	
第2 回利付国債(30年)	160,000,000	203,612,800	
第3 回利付国債(30年)	120,000,000	151,593,600	
第4 回利付国債(30年)	110,000,000	148,241,500	
第5 回利付国債(30年)	50,000,000	63,198,000	

第6回利付国債（30年）	190,000,000	246,317,900	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	231,674,400	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	60,955,500	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	278,534,400	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	178,515,200	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	108,612,000	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	241,015,000	
第13回利付国債（30年）	290,000,000	363,752,800	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	395,694,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	454,665,000	
第16回利付国債（30年）	370,000,000	495,781,500	
第17回利付国債（30年）	330,000,000	437,375,400	
第18回利付国債（30年）	345,000,000	452,419,200	
第19回利付国債（30年）	280,000,000	367,460,800	
第20回利付国債（30年）	420,000,000	566,466,600	
第21回利付国債（30年）	270,000,000	355,079,700	
第22回利付国債（30年）	400,000,000	540,792,000	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	581,772,800	
第24回利付国債（30年）	260,000,000	352,305,200	
第25回利付国債（30年）	290,000,000	382,669,500	
第26回利付国債（30年）	410,000,000	548,858,800	
第27回利付国債（30年）	600,000,000	816,684,000	
第28回利付国債（30年）	930,000,000	1,269,961,500	
第29回利付国債（30年）	920,000,000	1,241,825,200	
第30回利付国債（30年）	640,000,000	853,945,600	
第31回利付国債（30年）	900,000,000	1,186,182,000	
第32回利付国債（30年）	880,000,000	1,180,572,800	
第33回利付国債（30年）	1,110,000,000	1,422,265,200	
第34回利付国債（30年）	875,000,000	1,160,486,250	
第35回利付国債（30年）	1,160,000,000	1,492,595,200	
第36回利付国債（30年）	1,140,000,000	1,469,653,800	
第37回利付国債（30年）	1,060,000,000	1,344,896,200	
第38回利付国債（30年）	700,000,000	874,216,000	
第39回利付国債（30年）	840,000,000	1,070,428,800	
第40回利付国債（30年）	600,000,000	751,038,000	
第41回利付国債（30年）	590,000,000	724,992,000	
第42回利付国債（30年）	750,000,000	921,945,000	
第43回利付国債（30年）	750,000,000	922,305,000	
第44回利付国債（30年）	810,000,000	996,445,800	
第45回利付国債（30年）	690,000,000	815,731,800	
第46回利付国債（30年）	840,000,000	993,090,000	
第47回利付国債（30年）	900,000,000	1,087,344,000	

第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,274,988,000
第49回利付国債(30年)	740,000,000	857,593,400
第50回利付国債(30年)	520,000,000	523,629,600
第51回利付国債(30年)	790,000,000	693,225,000
第52回利付国債(30年)	770,000,000	714,175,000
第53回利付国債(30年)	930,000,000	885,043,800
第54回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,283,046,400
第55回利付国債(30年)	970,000,000	971,154,300
第56回利付国債(30年)	920,000,000	920,000,000
第41回利付国債(20年)	330,000,000	337,520,700
第42回利付国債(20年)	80,000,000	83,004,000
第43回利付国債(20年)	140,000,000	148,013,600
第44回利付国債(20年)	170,000,000	180,643,700
第45回利付国債(20年)	290,000,000	307,475,400
第46回利付国債(20年)	170,000,000	180,461,800
第47回利付国債(20年)	90,000,000	96,057,900
第48回利付国債(20年)	130,000,000	140,667,800
第49回利付国債(20年)	140,000,000	150,480,400
第50回利付国債(20年)	220,000,000	235,028,200
第51回利付国債(20年)	100,000,000	107,684,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	119,450,100
第53回利付国債(20年)	80,000,000	87,296,800
第54回利付国債(20年)	200,000,000	219,066,000
第55回利付国債(20年)	140,000,000	152,971,000
第56回利付国債(20年)	150,000,000	164,586,000
第57回利付国債(20年)	240,000,000	262,228,800
第58回利付国債(20年)	300,000,000	329,316,000
第59回利付国債(20年)	200,000,000	218,392,000
第60回利付国債(20年)	350,000,000	376,806,500
第61回利付国債(20年)	240,000,000	254,049,600
第62回利付国債(20年)	320,000,000	336,019,200
第63回利付国債(20年)	200,000,000	221,264,000
第64回利付国債(20年)	320,000,000	357,235,200
第65回利付国債(20年)	220,000,000	246,620,000
第66回利付国債(20年)	330,000,000	367,907,100
第67回利付国債(20年)	130,000,000	146,368,300
第68回利付国債(20年)	190,000,000	217,557,600
第69回利付国債(20年)	390,000,000	444,077,400
第70回利付国債(20年)	400,000,000	465,328,000
第71回利付国債(20年)	200,000,000	230,014,000
第72回利付国債(20年)	630,000,000	723,586,500
第73回利付国債(20年)	360,000,000	412,866,000
第74回利付国債(20年)	200,000,000	230,796,000

第75回利付国債(20年)	130,000,000	150,549,100	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	308,699,100	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	333,703,000	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	195,131,100	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	311,971,500	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	255,875,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	452,466,300	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	700,824,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	340,007,600	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	547,230,400	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	341,248,800	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	250,620,300	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	651,788,500	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	503,479,200	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	416,556,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	752,648,400	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	541,588,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,047,182,400	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	485,718,800	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	728,346,100	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	742,864,100	
第96回利付国債(20年)	320,000,000	383,571,200	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	485,000,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	529,179,200	
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,387,567,000	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	585,907,200	
第101回利付国債(20年)	415,000,000	515,106,300	
第102回利付国債(20年)	320,000,000	398,640,000	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	494,088,000	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	437,101,200	
第105回利付国債(20年)	680,000,000	828,185,600	
第106回利付国債(20年)	380,000,000	466,898,400	
第107回利付国債(20年)	150,000,000	183,231,000	
第108回利付国債(20年)	610,000,000	731,725,500	
第109回利付国債(20年)	180,000,000	216,466,200	
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,163,788,000	
第111回利付国債(20年)	460,000,000	570,087,200	
第112回利付国債(20年)	630,000,000	773,558,100	
第113回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,514,523,600	
第114回利付国債(20年)	710,000,000	876,601,500	
第115回利付国債(20年)	510,000,000	635,745,600	
第116回利付国債(20年)	720,000,000	899,992,800	

第117回利付国債(20年)	720,000,000	891,252,000	
第118回利付国債(20年)	690,000,000	847,292,400	
第119回利付国債(20年)	270,000,000	324,877,500	
第120回利付国債(20年)	680,000,000	800,910,800	
第121回利付国債(20年)	1,220,000,000	1,485,398,800	
第122回利付国債(20年)	200,000,000	240,992,000	
第123回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,245,700,000	
第124回利付国債(20年)	390,000,000	480,831,000	
第125回利付国債(20年)	310,000,000	391,096,000	
第126回利付国債(20年)	570,000,000	704,274,900	
第127回利付国債(20年)	580,000,000	708,620,800	
第128回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,248,704,400	
第129回利付国債(20年)	100,000,000	121,099,000	
第130回利付国債(20年)	750,000,000	909,255,000	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	455,582,000	
第132回利付国債(20年)	780,000,000	935,937,600	
第133回利付国債(20年)	660,000,000	800,949,600	
第134回利付国債(20年)	560,000,000	680,674,400	
第135回利付国債(20年)	490,000,000	588,798,700	
第136回利付国債(20年)	530,000,000	629,518,100	
第137回利付国債(20年)	380,000,000	457,276,800	
第138回利付国債(20年)	310,000,000	364,057,800	
第139回利付国債(20年)	510,000,000	606,109,500	
第140回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,818,266,500	
第141回利付国債(20年)	800,000,000	963,864,000	
第142回利付国債(20年)	460,000,000	560,878,000	
第143回利付国債(20年)	890,000,000	1,059,723,000	
第144回利付国債(20年)	740,000,000	870,262,200	
第145回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,894,676,000	
第146回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,714,295,000	
第147回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,645,387,800	
第148回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,494,637,600	
第149回利付国債(20年)	1,580,000,000	1,860,623,800	
第150回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,556,436,800	
第151回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,500,279,900	
第152回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,533,971,200	
第153回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,899,355,400	
第154回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,531,047,200	
第155回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,700,743,200	
第156回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,170,983,800	
第157回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,513,168,000	
第158回利付国債(20年)	1,440,000,000	1,435,046,400	
第159回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,619,424,000	

	第160回利付国債（20年）	1,800,000,000	1,850,436,000	
	第161回利付国債（20年）	1,110,000,000	1,117,836,600	
	第162回利付国債（20年）	560,000,000	562,990,400	
	国債証券合計	254,455,000,000	276,404,191,350	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,109,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,241,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	130,535,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	127,603,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,946,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	121,001,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	236,270,000	
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	234,802,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	103,903,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	104,157,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	103,790,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	208,250,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,747,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	103,182,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	104,669,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	103,782,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	104,145,000	
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	208,172,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,993,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,655,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,494,000	
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	134,565,000	
	第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	117,506,000	
	第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	113,084,000	
	第172回神奈川県公募公債	200,000,000	206,144,000	
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	205,464,000	
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,601,000	
	第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	237,064,000	
	第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,822,000	
	第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,649,000	
	第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,087,000	
	第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,883,000	
	第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,500,000	
	第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,155,000	
	第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,160,000	
	第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,891,000	
	第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	197,346,000	
	平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	103,226,000	

平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	118,339,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,408,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,537,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	106,793,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	103,464,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,875,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	103,460,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,416,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,714,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	114,130,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	107,515,593	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,912,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,442,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	122,622,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,653,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,165,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,932,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,242,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,932,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,073,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,704,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,733,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	122,225,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,391,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,904,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,780,270	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,999,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,936,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	200,905,280	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,517,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,219,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,811,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,808,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,393,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,722,000	
	100,000,000	119,384,000	

平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）			
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	121,067,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	208,304,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	126,971,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,768,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,582,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	103,220,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	123,517,200	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,579,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,562,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,509,000	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,549,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,791,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,862,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,096,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	372,500,600	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,045,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,770,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,255,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,514,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,870,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,777,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,496,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,080,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,463,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,771,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,672,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,790,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,523,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,680,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,384,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,084,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,822,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,078,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,056,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,360,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,666,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,021,000	
第171回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,046,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	207,568,000	



	平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,956,000	
	第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	242,460,000	
	平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,318,000	
	第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	132,756,000	
	第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	120,120,000	
	第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	118,775,000	
	第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,614,000	
	平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	105,060,000	
	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,241,000	
	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,778,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,271,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	115,810,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,820,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	204,722,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,082,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,110,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	112,164,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,900,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,583,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	118,440,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,736,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	199,076,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	145,063,800	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	206,574,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	104,171,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,781,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,772,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,998,950	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	208,274,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,730,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	120,052,000	
	地方債証券合計	17,749,520,000	18,844,527,193	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,150,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,680,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,391,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,353,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,134,000	
	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	106,333,000	

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	212,960,000	
第14回道路債券	100,000,000	109,340,000	
第17回道路債券	100,000,000	107,456,000	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	476,548,000	
第21回道路債券	100,000,000	133,349,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,706,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	145,054,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,426,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,608,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,520,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,956,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,083,000	
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	137,622,000	
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	242,844,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,582,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,442,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,167,000	
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	142,642,320	
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	128,841,000	
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	103,481,000	
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	102,862,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,836,000	
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	205,892,000	
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	205,624,000	
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	207,646,000	
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	122,511,000	
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	103,930,000	
	100,000,000	104,582,000	

第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	104,167,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,654,000	
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	312,150,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,322,000	
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	312,708,900	
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	208,390,000	
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	104,241,000	
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	103,945,000	
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	311,616,000	
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	117,557,000	
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	104,466,000	
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	313,293,000	
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	207,368,000	
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	206,076,000	
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	310,239,000	
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	210,058,000	
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	155,064,040	
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	104,108,000	
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	229,708,000	
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	106,380,900	
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	104,236,000	
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	103,935,000	
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	103,651,000	
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	103,212,000	
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	306,483,000	
	316,000,000	315,424,880	

第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,278,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	300,699,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,998,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	323,502,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,641,900	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,669,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,386,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	134,141,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,480,800	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,164,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,321,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,545,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,970,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,806,790	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,776,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	119,731,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,448,040	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,576,310	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,748,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,545,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,875,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	517,825,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,649,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,406,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,028,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,418,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,853,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,260,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,116,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,027,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,568,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,585,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,132,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,687,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,382,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	103,608,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,081,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	108,205,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,106,800	

第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,464,000	19,497,060
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,082,000	19,219,719
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,460,000	19,748,323
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	102,812,000
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,415,000	20,665,520
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,825,000	21,107,479
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,884,000	16,569,553
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,318,000	35,432,360
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,271,000	20,404,905
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,505,000	18,575,955
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,358,000	21,620,603
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,560,000	18,670,143
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,152,000	21,300,865
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,485,000	23,224,306
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,867,000	23,590,511
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,391,000	29,691,296
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,475,000	30,967,986
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,550,000	33,259,174
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,115,000	36,685,224
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,187,000	38,850,725
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,323,000	39,948,673
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,323,000
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,778,000	84,284,582
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,338,000	19,215,106
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,003,000	43,600,540
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,438,000	19,310,117
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,110,000
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,077,000	19,236,278
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,735,000	47,705,404
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,846,000	17,866,530
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,979,000	48,082,551
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,356,000	45,378,524
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,644,000	19,897,622
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,856,000	89,004,758
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,785,000	48,627,790
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,012,000	20,173,252
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,240,000	60,381,331
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,973,000	57,994,316

第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,622,000	57,669,907
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,894,000
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,024,000	123,023,820
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,984,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,070,000
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,570,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,554,000	130,761,979
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,481,000	66,010,717
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,541,000	66,665,310
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,009,000	68,295,855
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,216,000	61,077,316
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,521,000	61,949,456
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,527,000	67,987,583
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,386,500
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,619,000	61,077,480
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,044,000	68,657,361
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,371,000	70,083,356
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,523,000	68,985,681
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,028,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,776,000	146,960,748
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,953,000	74,251,178
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,212,000	151,777,980
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,991,000	83,231,211
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,673,000	86,702,611
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,791,000	86,282,944
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,130,000	176,753,331
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,958,000	87,579,803
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,771,000	92,585,320
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,671,000	95,621,251
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,927,000	95,620,033
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,249,000
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,298,000	96,442,447
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,739,000	97,439,390
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,101,000	97,620,490
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,707,000	99,062,345
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,136,000	99,616,809
	99,457,000	99,601,212

	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,834,000	99,964,782	
	第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,180,000	
	第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	126,576,000	
	第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,759,000	
	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	118,956,000	
	第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	114,523,000	
	い第779号商工債	100,000,000	100,208,000	
	い第786号商工債	300,000,000	300,771,000	
	い第795号商工債	200,000,000	198,906,000	
	い第768号農林債	100,000,000	100,361,000	
	い第780号農林債	100,000,000	100,507,000	
	い第795号農林債	100,000,000	99,754,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,342,000	
	第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,228,000	
	第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,879,000	
	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,390,000	
	第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,473,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,758,000	
	第201号商工債（3年）	300,000,000	299,250,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,865,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	207,832,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,834,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,785,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,376,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,526,000	
	特殊債券合計	22,374,924,000	23,705,857,967	
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	99,925,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,138,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,206,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,972,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,533,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,190,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	100,000,000	100,355,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	100,000,000	100,264,000	

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	100,897,000	
第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,459,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,354,000	
第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,210,000	
第11回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,301,000	
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	100,396,000	
第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,148,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,014,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,502,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,764,000	
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
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	103,147,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,031,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,388,000	
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	103,252,000	
第11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	99,932,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,568,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,530,000	
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	102,173,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,864,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,935,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,973,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,248,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,046,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,570,000	
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	101,079,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,640,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,955,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,864,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,760,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,350,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,260,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,616,000	
第24回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	102,952,000	



第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,863,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,020,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,034,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,116,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,320,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,092,000	
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	100,490,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,703,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,577,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,885,000	
第2回ユニバーファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,466,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,263,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,687,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,019,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,461,000	
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	126,075,000	
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	103,223,000	
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	104,636,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	119,339,000	
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	102,443,000	
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	104,268,000	
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	103,907,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,317,000	
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	103,075,000	
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	103,412,000	
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	103,469,000	
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	104,960,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,317,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,654,000	
	100,000,000	100,754,000	

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			
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,726,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,238,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,937,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,469,000	
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	100,637,000	
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	102,624,000	
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	100,499,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,158,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,238,000	
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	103,676,000	
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	104,254,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,104,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,277,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,876,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,469,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,781,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	245,066,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,563,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,825,140	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	121,956,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,747,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,145,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,899,400	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,506,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,805,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,990,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	205,412,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,925,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	103,100,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	122,262,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,316,300	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,790,000	

第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,360,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,694,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,194,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,259,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,342,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,225,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,407,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,185,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,759,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,179,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,379,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,169,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,027,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	132,816,600	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,533,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,410,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,812,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,651,350	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,406,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,029,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,417,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,413,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,848,000	
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	101,341,000	
社債券合計	13,696,000,000	14,122,793,790	
合計		333,077,370,300	

(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11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,915,857
コール・ローン	2,784,574
国債証券	197,970,778
未収利息	1,245,919
前払費用	35,341
流動資産合計	203,952,469
資産合計	203,952,469
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,104,044
未払利息	4
流動負債合計	2,104,048
負債合計	2,104,048
純資産の部	
元本等	
元本	199,659,489
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,188,932
元本等合計	201,848,421
純資産合計	201,848,421
負債純資産合計	203,952,469

## 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11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>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	平成29年11月10日現在

## (貸借対照表に関する注記)

	平成29年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	199,659,489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) 1.0110円 (10,110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11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11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。

平成29年11月10日現在	
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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11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 5月11日
期首元本額	208,076,840円
期中追加設定元本額	6,281,138円
期中一部解約元本額	14,698,489円
期末元本額	199,659,489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	4,119,830円
米回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）	195,539,659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11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		886,928
合計		886,928

(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 0.75% 08/15/19	10,000.00	9,850.31	
		T 0.75% 10/31/18	10,000.00	9,925.66	
		T 0.875% 04/15/19	10,000.00	9,901.65	
		T 0.875% 07/31/19	10,000.00	9,876.26	
		T 0.875% 09/15/19	10,000.00	9,863.73	
		T 1.125% 01/15/19	10,000.00	9,948.53	
		T 1.125% 01/31/19	10,000.00	9,946.47	
		T 1.125% 02/28/21	10,000.00	9,780.05	
		T 1.125% 04/30/20	10,000.00	9,862.92	
		T 1.125% 06/30/21	10,000.00	9,743.62	
		T 1.125% 07/31/21	20,000.00	19,466.37	
		T 1.125% 08/31/21	10,000.00	9,721.31	
		T 1.125% 09/30/21	10,000.00	9,713.14	
		T 1.25% 01/31/20	10,000.00	9,908.25	
		T 1.25% 03/31/21	10,000.00	9,811.51	
		T 1.25% 04/30/19	10,000.00	9,952.33	
		T 1.25% 07/31/23	20,000.00	19,096.32	
		T 1.25% 11/15/18	10,000.00	9,970.82	

T 1.25% 11/30/18	10,000.00	9,968.64	
T 1.25% 12/15/18	10,000.00	9,966.64	
T 1.25% 12/31/18	10,000.00	9,965.60	
T 1.375% 01/15/20	10,000.00	9,937.08	
T 1.375% 01/31/20	10,000.00	9,937.09	
T 1.375% 02/15/20	10,000.00	9,932.43	
T 1.375% 02/28/19	10,000.00	9,974.34	
T 1.375% 02/29/20	10,000.00	9,929.69	
T 1.375% 03/31/20	10,000.00	9,925.32	
T 1.375% 04/30/20	10,000.00	9,919.98	
T 1.375% 04/30/21	10,000.00	9,845.83	
T 1.375% 05/31/20	10,000.00	9,917.99	
T 1.375% 05/31/21	20,000.00	19,673.23	
T 1.375% 06/30/23	20,000.00	19,249.42	
T 1.375% 08/31/23	10,000.00	9,606.95	
T 1.375% 12/15/19	10,000.00	9,942.33	
T 1.5% 01/31/19	20,000.00	19,983.58	
T 1.5% 01/31/22	10,000.00	9,825.84	
T 1.5% 02/28/19	10,000.00	9,989.49	
T 1.5% 02/28/23	10,000.00	9,722.77	
T 1.5% 03/31/23	10,000.00	9,715.25	
T 1.5% 05/31/19	10,000.00	9,985.96	
T 1.5% 05/31/20	10,000.00	9,947.70	
T 1.5% 08/15/26	10,000.00	9,361.19	
T 1.5% 10/31/19	10,000.00	9,974.24	
T 1.5% 11/30/19	10,000.00	9,969.60	
T 1.625% 03/15/20	10,000.00	9,983.96	
T 1.625% 03/31/19	10,000.00	10,007.37	
T 1.625% 04/30/19	10,000.00	10,005.38	
T 1.625% 04/30/23	20,000.00	19,541.77	
T 1.625% 05/15/26	20,000.00	18,961.35	
T 1.625% 06/30/19	10,000.00	10,003.71	
T 1.625% 06/30/20	10,000.00	9,976.54	
T 1.625% 07/31/20	10,000.00	9,973.84	
T 1.625% 08/31/19	10,000.00	9,999.37	
T 1.625% 10/31/23	10,000.00	9,732.35	
T 1.625% 11/15/22	10,000.00	9,816.78	
T 1.625% 11/30/20	10,000.00	9,956.99	
T 1.625% 12/31/19	10,000.00	9,992.77	
T 1.75% 02/28/22	10,000.00	9,924.93	
T 1.75% 05/15/22	10,000.00	9,916.14	
T 1.75% 05/15/23	10,000.00	9,832.41	



T 1.75% 09/30/19	10,000.00	10,021.57
T 1.75% 09/30/22	20,000.00	19,757.73
T 1.75% 10/31/18	10,000.00	10,021.00
T 1.75% 10/31/20	10,000.00	9,999.57
T 1.75% 12/31/20	10,000.00	9,989.62
T 1.875% 03/31/22	10,000.00	9,965.64
T 1.875% 05/31/22	10,000.00	9,962.50
T 1.875% 08/31/22	10,000.00	9,941.63
T 1.875% 10/31/22	10,000.00	9,933.16
T 1.875% 11/30/21	10,000.00	9,994.22
T 1% 03/15/19	20,000.00	19,848.61
T 1% 10/15/19	10,000.00	9,879.96
T 1% 11/15/19	10,000.00	9,872.80
T 1% 11/30/18	10,000.00	9,943.06
T 2.125% 01/31/21	10,000.00	10,102.63
T 2.125% 05/15/25	20,000.00	19,847.68
T 2.125% 06/30/21	10,000.00	10,093.83
T 2.125% 06/30/22	10,000.00	10,063.74
T 2.125% 07/31/24	10,000.00	9,964.57
T 2.125% 08/15/21	10,000.00	10,091.70
T 2.125% 08/31/20	10,000.00	10,106.90
T 2.125% 09/30/21	10,000.00	10,085.56
T 2.125% 11/30/23	10,000.00	10,008.09
T 2.125% 12/31/21	10,000.00	10,081.32
T 2.25% 02/15/27	10,000.00	9,934.49
T 2.25% 03/31/21	10,000.00	10,138.85
T 2.25% 04/30/21	10,000.00	10,139.08
T 2.25% 07/31/21	10,000.00	10,135.39
T 2.25% 08/15/46	10,000.00	8,899.13
T 2.25% 11/15/24	30,000.00	30,092.28
T 2.25% 11/15/25	20,000.00	19,977.72
T 2.25% 12/31/23	10,000.00	10,069.82
T 2.375% 08/15/24	20,000.00	20,239.76
T 2.375% 12/31/20	10,000.00	10,180.52
T 2.5% 02/15/45	10,000.00	9,437.68
T 2.5% 02/15/46	10,000.00	9,406.26
T 2.5% 05/15/24	20,000.00	20,406.68
T 2.5% 05/15/46	10,000.00	9,399.88
T 2.5% 08/15/23	10,000.00	10,224.93
T 2.625% 08/15/20	10,000.00	10,242.75
T 2.625% 11/15/20	10,000.00	10,253.30
T 2.75% 02/15/19	10,000.00	10,147.35
T 2.75% 02/15/24	20,000.00	20,710.20

T 2.75% 08/15/42	10,000.00	9,990.11
T 2.75% 11/15/23	10,000.00	10,364.08
T 2.75% 11/15/42	10,000.00	9,978.73
T 2.875% 05/15/43	10,000.00	10,192.55
T 2.875% 08/15/45	10,000.00	10,157.94
T 2.875% 11/15/46	10,000.00	10,142.73
T 2% 02/15/22	10,000.00	10,034.89
T 2% 02/15/23	10,000.00	9,975.70
T 2% 02/15/25	10,000.00	9,849.95
T 2% 02/28/21	20,000.00	20,125.50
T 2% 05/31/21	20,000.00	20,107.30
T 2% 06/30/24	10,000.00	9,891.58
T 2% 07/31/22	10,000.00	10,005.42
T 2% 08/15/25	40,000.00	39,292.32
T 2% 09/30/20	10,000.00	10,074.10
T 2% 10/31/21	10,000.00	10,038.42
T 2% 11/15/21	10,000.00	10,043.52
T 2% 11/15/26	10,000.00	9,742.19
T 2% 11/30/22	10,000.00	9,989.81
T 2% 12/31/21	10,000.00	10,028.78
T 3.125% 02/15/43	20,000.00	21,321.78
T 3.125% 05/15/19	20,000.00	20,462.84
T 3.125% 05/15/21	10,000.00	10,440.11
T 3.125% 08/15/44	10,000.00	10,658.07
T 3.125% 11/15/41	10,000.00	10,685.34
T 3.375% 05/15/44	10,000.00	11,135.95
T 3.375% 11/15/19	10,000.00	10,342.39
T 3.5% 05/15/20	10,000.00	10,445.22
T 3.625% 02/15/20	10,000.00	10,433.43
T 3.625% 02/15/21	10,000.00	10,579.79
T 3.625% 02/15/44	10,000.00	11,606.59
T 3.625% 08/15/19	10,000.00	10,348.98
T 3.625% 08/15/43	10,000.00	11,588.55
T 3.75% 11/15/18	10,000.00	10,220.74
T 3.75% 11/15/43	10,000.00	11,835.32
T 3% 05/15/45	20,000.00	20,819.78
T 3% 11/15/44	10,000.00	10,416.35
T 3% 11/15/45	10,000.00	10,402.25
T 4.375% 02/15/38	10,000.00	12,785.75
T 4.375% 05/15/41	10,000.00	12,895.92
T 4.375% 11/15/39	10,000.00	12,827.79
T 4.5% 02/15/36	10,000.00	12,917.84

	T 4.625% 02/15/40	10,000.00	13,261.86	
	T 4.75% 02/15/41	10,000.00	13,537.77	
	T 6.25% 05/15/30	10,000.00	14,185.74	
	アメリカドル 小計	1,720,000.00	1,745,928.02	(197,970,778)
	合計		197,970,778	(197,970,778)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 148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 - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成29年11月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,006,411,886
投資証券	80,907,207,600
未収入金	49,985,271
未収配当金	679,984,637
前払金	53,016,640
差入委託証拠金	11,971,500
流動資産合計	82,708,577,534
資産合計	82,708,577,534
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,016,640
未払解約金	64,880,278

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
未払利息	1,805
流動負債合計	117,898,723
負債合計	117,898,723
純資産の部	
元本等	
元本	56,695,653,318
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,895,025,493
元本等合計	82,590,678,811
純資産合計	82,590,678,811
負債純資産合計	82,708,577,534

## 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11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,695,653,318口

		平成29年11月10日現在	
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)	1.4567円 (14,567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11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。		
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11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務		

	平成29年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <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11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 5月11日
期首元本額	43,465,073,932円
期中追加設定元本額	15,137,392,687円
期中一部解約元本額	1,906,813,301円
期末元本額	56,695,653,318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）	1,726,972,021円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,313,683円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	11,477,197,180円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	26,444,127,075円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,375,371,698円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,036,994,367円
分散投資コア戦略ファンド A	1,641,732,611円
分散投資コア戦略ファンド S	2,516,874,727円

区分	平成29年11月10日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,046,331,822円
SMT インデックスバランス・オープン	44,144,210円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	917,836,196円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	1,270,688円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	270,349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）	1,456,216,691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11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	6,077,010,144
合計	6,077,010,144

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「J - R E I T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11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	1,718,096,140	-	1,665,079,500	53,016,640
	合計	1,718,096,140	-	1,665,079,500	53,016,640

## (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	3,685	1,610,345,000	
	MCUBS MidCity投資法人	2,245	817,180,000	
	森ヒルズリート投資法人	11,914	1,563,116,800	
	産業ファンド投資法人	3,013	1,398,032,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,269	2,700,747,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	2,516	725,866,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,794	2,128,536,000	
	GLP投資法人	19,417	2,164,995,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,045	930,350,000	
	日本プロロジスリート投資法人	13,950	3,247,560,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,684	914,412,000	
	Oneリート投資法人	1,213	275,351,000	
	イオンリート投資法人	10,532	1,195,382,000	
	ヒューリックリート投資法人	7,533	1,189,460,700	
	日本リート投資法人	2,980	971,480,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6,145	658,129,500	
	日本ヘルスケア投資法人	538	87,156,000	
	積水ハウス・リート投資法人	6,957	860,580,900	
	トーセイ・リート投資法人	1,783	187,393,300	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,033	912,264,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,367	139,707,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,926	168,717,600	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	611	84,318,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	31,819	4,381,476,300	
	いちごホテルリート投資法人	1,753	197,387,800	
	ラサールロジポート投資法人	8,367	909,492,900	
	スターアジア不動産投資法人	2,303	241,584,700	
	マリモ地方創生リート投資法人	619	66,294,900	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,794	580,359,000	
	大江戸温泉リート投資法人	1,411	128,401,000	
	さくら総合リート投資法人	2,666	240,206,600	
	投資法人みらい	1,411	234,084,900	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	2,402	324,029,800	
	三菱地所物流リート投資法人	1,028	281,980,400	
日本ビルファンド投資法人	10,740	5,756,640,000		
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,483	5,440,677,000		
日本リテールファンド投資法人	21,336	4,247,997,600		
オリックス不動産投資法人	21,398	3,280,313,400		
日本プライムリアルティ投資法人	7,002	2,517,219,000		
プレミア投資法人	10,018	995,789,200		
東急リアル・エステート投資法人	7,436	978,577,600		



グローバル・ワン不動産投資法人	1,781	653,627,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	24,461	3,913,760,000	
森トラスト総合リート投資法人	7,927	1,264,356,500	
インヴィンシブル投資法人	30,418	1,417,478,800	
フロンティア不動産投資法人	3,773	1,658,233,500	
平和不動産リート投資法人	6,907	629,227,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,389	1,502,922,600	
福岡リート投資法人	5,383	853,205,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,242	1,912,780,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	8,409	910,694,700	
いちごオフィスリート投資法人	8,588	644,958,800	
大和証券オフィス投資法人	2,393	1,311,364,000	
阪急リート投資法人	4,545	595,395,000	
スターツプロシード投資法人	1,748	283,525,600	
大和ハウスリート投資法人	11,407	2,944,146,700	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,011	2,404,026,100	
日本賃貸住宅投資法人	12,475	976,792,500	
ジャパンエクセレント投資法人	9,932	1,297,119,200	
合計	449,925	80,907,207,600	

(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11月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	996,570
コール・ローン	917,271
投資信託受益証券	2,886,002
投資証券	93,069,700
未収配当金	135,112
流動資産合計	98,004,655
資産合計	98,004,655
負債の部	
流動負債	

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
未払解約金	100,646
未払利息	1
流動負債合計	100,647
負債合計	100,647
純資産の部	
元本等	
元本	94,556,662
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,347,346
元本等合計	97,904,008
純資産合計	97,904,008
負債純資産合計	98,004,655

## 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11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>
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>

	平成29年11月10日現在
	<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 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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,556,662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 1.0354円 (1万口当たり純資産額) (10,354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11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、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11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11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 5月11日
期首元本額	199,206,329円
期中追加設定元本額	19,507,054円
期中一部解約元本額	124,156,721円
期末元本額	94,556,662円

区分	平成29年11月10日現在
期末元本額の内訳	
SMT 米国REITインデックス・オープン	92,504,959円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	2,051,703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11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	24,152
投資証券	404,236
合計	428,388

(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）

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
投資信託受益証券	アメリカドル	VANGUARD REIT ETF	300	25,452.00	
		アメリカドル 小計	300	25,452.00 (2,886,002)	
投資信託受益証券合計			300	2,886,002 (2,886,002)	
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	136	3,979.36	
		AGREE REALTY CORP	19	929.10	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	50	2,146.00	
		ALEXANDER'S INC	4	1,619.24	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	88	11,096.80	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	42	1,655.64	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	124	5,253.88	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	203	4,445.70	
APARTMENT INVEST & MGMT	144	6,510.24	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	288	5,538.24	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	27	402.57	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	27	247.05	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	93	591.48	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	134	25,120.98	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	19	220.40	
BOSTON PROPERTIES	148	18,649.48	
BRANDYWINE REALTY TRUST	144	2,554.56	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	275	4,925.25	
CAMDEN PROPERTY TRUST	85	7,982.35	
CARETRUST REIT INC	52	976.04	
CBL & ASSOCIATES PRTYS	222	1,294.26	
CEDAR REALTY TRUST INC	81	473.85	
CHATHAM LODGING TRUST	41	940.13	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	64	1,795.20	
CITY OFFICE REIT INC	17	219.13	
CLIPPER REALTY INC	20	221.00	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	506	6,431.26	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	205	4,587.90	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	115	3,123.40	
CORECIVIC INC	202	5,215.64	
CORESITE REALTY CORP	29	3,375.31	
CORPORATE OFFICE PPTYS	83	2,683.39	
COUSINS PROPERTIES INC	361	3,285.10	
CUBESMART	159	4,601.46	
CYRUSONE INC	130	8,096.40	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	83	4,961.74	
DDR CORPORATION	251	1,992.94	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	152	1,717.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	198	24,203.52	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	138	5,531.04	
DUKE REALTY CORP	334	9,662.62	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14	289.10	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	44	4,059.88	
EDUCATION REALTY TRUST INC	112	4,084.64	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	236	4,826.20	
EPR PROPERTIES	56	3,817.52	

EQUITY COMMONWEALTH	106	3,212.86
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	80	7,184.00
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	355	24,807.40
ESSEX PROPERTY TRUST	63	16,187.85
EXTRA SPACE STORAGE INC	118	10,083.10
FARMLAND PARTNERS INC	100	895.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	67	8,806.48
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	102	3,220.14
FOREST CITY REALTY TRUST-A	243	6,014.25
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	146	3,809.14
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	96	1,017.60
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	184	6,774.88
GEO GROUP INC/THE	104	2,800.72
GETTY REALTY CORP	28	787.36
GGP INC	595	13,090.00
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	23	518.88
GLADSTONE LAND CORP	20	275.20
GLOBAL MEDICAL REIT INC	20	183.00
GLOBAL NET LEASE INC	60	1,282.80
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	77	1,444.52
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	133	3,859.66
HCP INC	446	12,050.92
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	107	3,475.36
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	182	5,551.00
HERSHA HOSPITALITY TRUST	52	920.92
HIGHWOODS PROPERTIES INC	92	4,754.56
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	144	4,266.72
HOST HOTELS AND RESORTS INC	703	14,060.00
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	137	4,834.73
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	33	343.20
INFRAREIT INC	40	854.80
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	135	799.20
INVITATION HOMES INC	200	4,660.00
IRON MOUNTAIN INC	248	10,076.24
ISTAR INC	160	1,819.20
JBG SMITH PROPERTIES	76	2,474.56
KILROY REALTY CORPORATION	89	6,605.58
KIMCO REALTY CORP	395	7,532.65
KITE REALTY GROUP TRUST	167	3,204.73
LASALLE HOTEL PROPERTIES	187	5,346.33
LEXINGTON CORP PROPERTIES	277	2,866.95

LIBERTY PROPERTY TRUST	133	5,950.42
LIFE STORAGE INC	39	3,452.67
LTC PROPERTIES INC	48	2,260.32
MACERICH CO/THE	98	6,116.18
MACK-CALI REALTY CORP	67	1,493.43
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	45	495.90
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	321	4,368.81
MID-AMERICA APARTMENT COMM	107	11,300.27
MONMOUTH REIT -CL A	66	1,137.84
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	135	5,665.95
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25	646.50
NATL HEALTH INVESTORS INC	34	2,598.62
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	93	758.88
NEXPOINT RESIDENTIAL	23	624.68
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	65	910.65
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	179	5,022.74
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	15	371.85
PARAMOUNT GROUP INC	200	3,198.00
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	123	3,581.76
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	53	1,946.16
PENN REAL ESTATE INVEST TST	75	820.50
PHYSICIANS REALTY TRUST	265	4,793.85
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	278	5,562.78
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	24	505.68
PROLOGIS INC	517	34,370.16
PS BUSINESS PARKS INC	16	2,145.28
PUBLIC STORAGE	146	30,860.02
QTS REALTY TRUST INC	38	2,285.70
QUALITY CARE PROPERTIES	203	3,319.05
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	85	1,167.90
REALTY INCOME CORP	262	14,740.12
REGENCY CENTERS CORP	138	9,152.16
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	83	1,567.04
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	191	2,452.44
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	60	1,816.80
RLJ LODGING TRUST	264	5,588.88
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	42	2,777.04
SABRA HEALTH CARE REIT INC	250	4,800.00
SAUL CENTERS INC	12	736.44
SELECT INCOME REIT	67	1,701.13
SENIOR HOUSING PROP TRUST	209	3,939.65



SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	40	1,612.00	
SIMON PROPERTY GROUP	304	49,023.04	
SL GREEN REALTY CORP	92	9,085.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	395	3,404.90	
STAG INDUSTRIAL INC	73	2,072.47	
STARWOOD WAYPOINT HOMES	174	6,540.66	
STORE CAPITAL CORP	144	3,735.36	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	93	1,440.57	
SUN COMMUNITIES INC	72	6,670.08	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	191	3,159.14	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	73	1,733.75	
TAUBMAN CENTERS INC	50	2,509.50	
TERRENO REALTY CORP	46	1,702.00	
TIER REIT INC	100	1,912.00	
UDR INC	251	9,997.33	
UMH PROPERTIES INC	26	399.10	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	13	976.30	
URBAN EDGE PROPERTIES	186	4,566.30	
URSTADT BIDDLE - CL A	29	645.54	
VENTAS INC	344	22,294.64	
VEREIT INC	904	7,385.68	
VORNADO REALTY TRUST	163	12,267.38	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	247	1,788.28	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	60	1,974.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	102	3,318.06	
WELLTOWER INC	357	24,375.96	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	18	175.50	
WHITESTONE REIT	29	415.57	
WP CAREY INC	98	6,982.50	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	117	2,538.90	
アメリカドル 小計	22,430	820,792.84 (93,069,700)	
投資証券合計	22,430	93,069,700 (93,069,700)	
合計		95,955,702 (95,955,702)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 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	3.0%		3.0%
	投資証券 158銘柄		97.0%	97.0%

(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。

## 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11月30日現在）

資産総額	18,946,543円
負債総額	6,165円
純資産総額（ - ）	18,940,378円
発行済口数	18,089,304口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0470円
（1万口当たり純資産額）	（10,470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11月30日現在）

資産総額	2,481,760,440円
負債総額	1,366,516円
純資産総額（ - ）	2,480,393,924円
発行済口数	1,813,602,852口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3677円
（1万口当たり純資産額）	（13,677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11月30日現在）

資産総額	2,165,839,341円
負債総額	32,571円
純資産総額（ - ）	2,165,806,770円
発行済口数	1,735,214,356口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2481円
（1万口当たり純資産額）	（12,481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11月30日現在）

資産総額	346,266,672,999円
負債総額	7,381,446,298円
純資産総額（ - ）	338,885,226,701円
発行済口数	244,614,850,813口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3854円
（1万口当たり純資産額）	（13,854円）

## 米国国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11月30日現在）

資産総額	198,304,541円
負債総額	2,728円
純資産総額（ - ）	198,301,813円
発行済口数	199,001,478口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9965円
（1万口当たり純資産額）	（9,965円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

資産総額	86,359,853,597円
負債総額	208,001,448円
純資産総額（ - ）	86,151,852,149円
発行済口数	56,645,330,864口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5209円
（1万口当たり純資産額）	（15,209円）

## 米国R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

資産総額	96,032,825円
負債総額	1円
純資産総額（ - ）	96,032,824円
発行済口数	94,546,401口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0157円
（1万口当たり純資産額）	（10,157円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

###### 受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

###### 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

###### 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

###### 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（平成29年11月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

###### [ DO（実行） ]

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

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

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成30年 2月 9日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成29年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	494	9,669,496
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	69	244,603
単位型公社債投資信託	0	0
合計	563	9,914,099

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。



す。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度（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。

また、第32期事業年度の中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		16,534,066		20,260,630
前払費用		102,445		143,622
未収委託者報酬		5,528,610		5,252,944
繰延税金資産		121,367		61,677
その他		5,566		5,474
流動資産合計		22,292,056		25,724,348
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	55,487	1	47,993
器具備品	1	90,924	1	73,765
その他	1	3,748	1	2,830
有形固定資産合計		150,160		124,589
無形固定資産				
ソフトウェア		215,175		221,499
その他		5,886		6,656
無形固定資産合計		221,062		228,156
投資その他の資産				
投資有価証券		63,797		71,153
長期前払費用		8,021		9,828
長期貸付金		22,838		19,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		123,235		137,359
その他		235		145
貸倒引当金		22,838		19,838
投資その他の資産合計		220,289		243,485
固定資産合計		591,512		596,231
資産合計		22,883,569		26,320,580

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日現在）	当事業年度 （平成29年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	68,500	71,500
<b>その他利益剰余金</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

	前事業年度 ( 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日 )	当事業年度 ( 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612
旅費交通費	67,392	61,961
租税公課	73,989	106,691
不動産賃借料	125,339	113,697
減価償却費	126,985	134,710
業務委託費	1 209,510	1 486,690
諸経費	217,580	223,685
一般管理費合計	3,246,214	3,304,885
営業利益	6,525,812	6,261,346

( 単位：千円 )

前事業年度

当事業年度

（自 平成27年4月 1日  
至 平成28年3月31日）

（自 平成28年4月 1日  
至 平成29年3月31日）

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

### （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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				株主資本合計
	利益準備金	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	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
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
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
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おります。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## （ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

## （イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (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いません。

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
--------------	--------	--------

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金及び預金		22,430,598
未収委託者報酬		5,219,968
繰延税金資産		79,306
その他流動資産		138,600
流動資産合計		27,868,472
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	39,695
器具備品	1	74,492
その他有形固定資産	1	2,371
有形固定資産合計		116,559
無形固定資産		
投資その他の資産		220,928
投資有価証券		72,823
長期貸付金		18,588
会員権		25,000
その他の投資		6,424
繰延税金資産		144,499
貸倒引当金		18,588
投資その他の資産合計		248,747
固定資産合計		586,236
資産合計		28,454,709
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金		2,893,700
未払費用		97,854
未払法人税等		958,933
賞与引当金		101,223
その他流動負債	2	126,412
流動負債合計		4,178,123
固定負債		
退職給付引当金		464,737
資産除去債務		13,260
その他固定負債		1,569
固定負債合計		479,568
負債合計		4,657,692

(単位：千円)

第32期中間会計期間末  
（平成29年9月30日）

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		74,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		20,972,132
利益剰余金合計		23,146,632
株主資本合計		23,796,632
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		384
評価・換算差額等合計		384
純資産合計		23,797,016
負債・純資産合計		28,454,709

中間損益計算書

（単位：千円）

第32期中間会計期間  
（自 平成29年4月1日  
至 平成29年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		14,889,835
営業収益合計		14,889,835
営業費用		10,297,526
一般管理費	1	1,725,338
営業利益		2,866,970
営業外収益	2	6,124
営業外費用		8,308
経常利益		2,864,786
税引前中間純利益		2,864,786
法人税、住民税及び事業税		912,037
法人税等調整額		25,439
法人税等合計		886,598
中間純利益		1,978,187

中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000

当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,978,187	1,978,187	1,978,187
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,945,187	1,948,187	1,948,187
当中間期末残高	74,500	2,100,000	20,972,132	23,146,632	23,796,632

	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	1,134	1,134	21,847,309
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,978,187
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	1,519	1,519	1,519
当中間期変動額合計	1,519	1,519	1,949,707
当中間期末残高	384	384	23,797,016

## 重要な会計方針

<p>第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）</p>
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>  その他有価証券</p> <p>    時価のあるもの</p> <p>      中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。       （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p>    時価のないもの</p> <p>      移動平均法による原価法によっております。</p>



## 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、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

## 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中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 60,917千円
	器具備品 309,829千円
	その他有形固定資産 2,218千円
	計 372,965千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

第32期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 16,811千円
	無形固定資産 41,202千円

2 営業外収益の主要項目	
受取利息	1,314千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

平成29年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	22,430,598	22,430,598	-
(2)未収委託者報酬	5,219,968	5,219,968	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	72,820	72,820	-
(4)未払金	(2,893,700)	(2,893,700)	-
(5)未払法人税等	(958,933)	(958,933)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)投資有価証券

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

(4)未払金、並びに(5)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見

積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末(平成29年9月30日)

其他有価証券

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	20,229	18,356	1,872
小計	20,229	18,356	1,872
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	52,590	53,909	1,318
小計	52,590	53,909	1,318
合計	72,820	72,266	554

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

(デリバティブ取引関係)

第32期中間会計期間(自平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第32期中間会計期間(自平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

(関連情報)

第32期中間会計期間(自平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	1,564,703千円

（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）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	7,932,338円90銭
1株当たり中間純利益	659,395円97銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	1,978,187千円
普通株式に係る中間純利益	1,978,187千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

##### (1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣

府令で定めるものを除きます。 )。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社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30年 2月 9日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（平成29年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成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。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成29年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

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

## 独立監査人の監査報告書

平成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。



# 独立監査人の監査報告書

平成30年1月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 日米インデックスバランス・オープンの平成29年5月11日から平成29年11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11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成29年12月4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	藤澤 孝 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29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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