

**【表紙】**

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年5月24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 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	(1)当初自己設定額 50万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したことに伴い、平成29年8月8日に提出した有価証券届出書（平成29年12月28日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に更新するため、また、指数名称の変更等に伴い、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

##### (1) ファンドの目的及び基本的性格

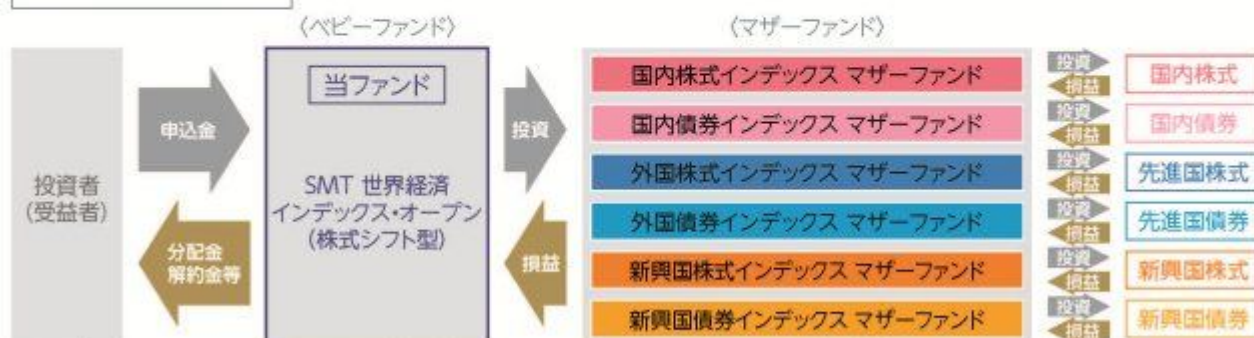
<ファンドの特色>を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

### 特色1 世界の株式及び債券に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 世界の株式及び債券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各投資対象市場の代表的な指数(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



※各マザーファンドの運用にあたっては、三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。ただし、今後変更となることがあります。

#### ? 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。

### 特色2 世界経済全体の発展を享受します。

- 基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率に基づき決定します。  
※年1回地域別構成比の見直しを行います。

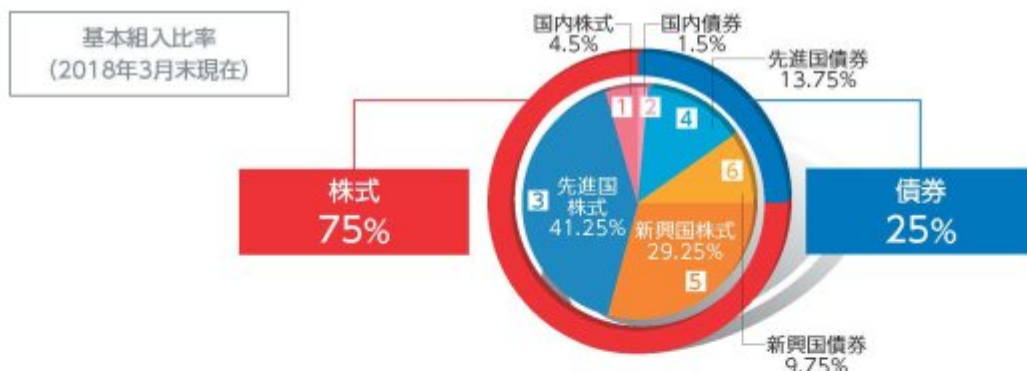


(出所) IMF[世界経済見通し2017年10月]のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※上記のファンドの地域別構成比は、2018年3月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



●組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

●基本組入比率は年1回見直しを行います。

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数) ※1
2 国内債券	NOMURA-BPI総合 ※2
3 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(円ベース) ※3
4 先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) ※4
5 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース) ※5
6 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース) ※6

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。

※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。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 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

※4 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」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。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。

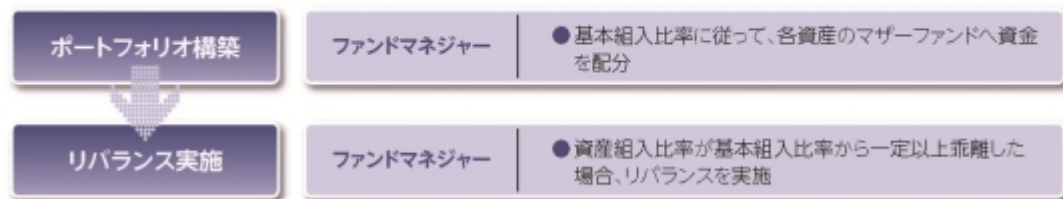
※5 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「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ものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。



## 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、各資産の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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配を行わないことがあります。  
※第1期決算日は2018年6月11日です。
- 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。

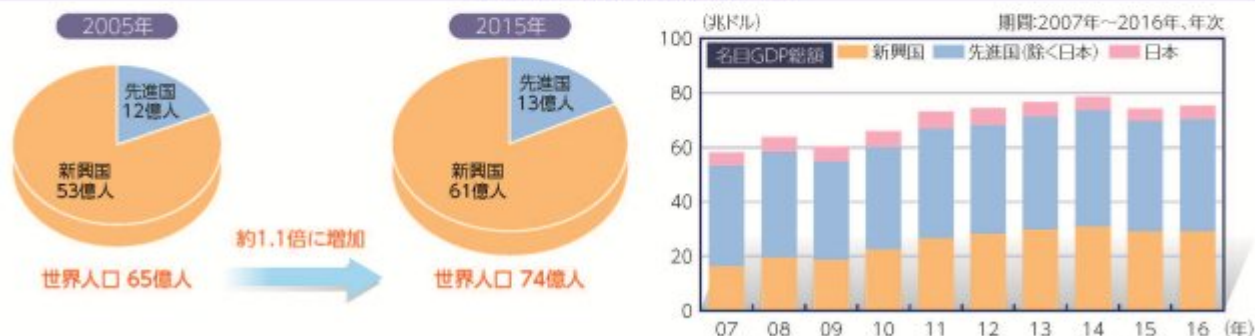
### 主な投資制限

- 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85%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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。

### 〈ご参考情報〉

#### 世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects(The 2017 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2017年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

### (3) ファンドの仕組み

<訂正前>

(前略)

委託会社の概況(平成29年5月31日現在)

(後略)

&lt;訂正後&gt;

(前略)

委託会社の概況（平成30年 3月30日現在）

(後略)

## 2 投資方針

## (1) 投資方針

&lt;訂正前&gt;

(前略)

投資態度

(中略)

ホ．各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国株式インデックス マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）
外国債券インデックス マザーファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）

(後略)

&lt;訂正後&gt;

(前略)

投資態度

(中略)

ホ．各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国株式インデックス マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）

新興国債券インデックス マザーファンド	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス -エマージング・マーケット・グローバル・ディ バーシファイド（円換算ベース）
---------------------	--

(後略)

## (2) 投資対象

&lt;訂正前&gt;

(前略)

## (参考) マザーファンドの概要

(中略)

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

## 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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

(中略)

## (2) 投資態度

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

(後略)

&lt;訂正後&gt;

(前略)

## (参考) マザーファンドの概要

(中略)

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

## 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 2. 運用方法

(中略)

## (2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

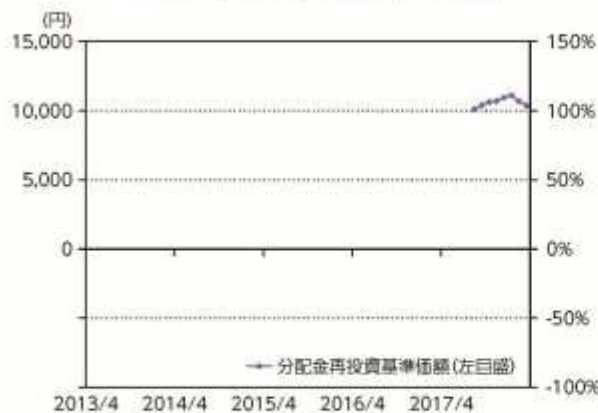
(後略)

## 3 投資リスク

[ 参考情報 ] を以下の内容に更新・訂正します。

&lt; 更新・訂正後 &gt;

## 【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

\*2013年4月～2018年3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内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

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

\*4 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により運営されている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。

\*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されています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 手数料等及び税金

## (5) 課税上の取扱い

&lt; 訂正前 &gt;



（前略）

個人の受益者に対する課税

（中略）

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）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」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。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドは平成30年1月以降、その適用対象です。

（中略）

上記は、平成29年11月 8日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

&lt;訂正後&gt;

（前略）

個人の受益者に対する課税

（中略）

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）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」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。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

（中略）

上記は、平成30年 3月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

## 5 運用状況

以下は、平成30年 3月30日現在の状況について記載してあります。

## S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）

## （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	1,336,693,109	99.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,070,923	0.82
合計(純資産総額)		1,347,764,032	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	外国株式インデックス マザーファンド	236,364,634	2.4501	579,118,848	2.3174	547,751,402	40.64
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	134,454,979	3.0502	410,118,726	2.9480	396,373,278	29.41
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	66,898,533	2.7678	185,167,952	2.6892	179,903,534	13.35
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	75,622,379	1.7372	131,374,231	1.7351	131,212,389	9.74
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	39,669,055	1.5917	63,143,392	1.5412	61,137,947	4.54
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	14,600,086	1.3842	20,210,541	1.3914	20,314,559	1.51

(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	99.18
合計	99.18

(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)
平成29年 8月末日	505,243		10,105	
9月末日	3,559,259		10,396	

10月末日	350,606,405		10,618
11月末日	754,924,783		10,697
12月末日	898,593,376		10,951
平成30年 1月末日	1,127,806,520		11,099
2月末日	1,278,461,339		10,684
3月末日	1,347,764,032		10,360

### 分配の推移

該当事項はありません。

### 収益率の推移

	期 間	収益率（％）
第1期中間計算期間	平成29年 8月25日～平成30年 2月24日	5.9

(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期中間計算期間	平成29年 8月25日～平成30年 2月24日	1,578,899,284	394,560,210	1,184,339,074

(注1)第1期中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

### ( 参考 )

### 国内株式インデックス 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	192,902,235,090	97.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,974,715,563	2.02
合計(純資産総額)		196,876,950,653	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	4,068,105,000	2.07

(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	トヨタ自動車	輸送用機器	956,200	6,120.22	5,852,162,306	6,825.00	6,526,065,000	3.31
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,430,700	707.07	3,839,929,470	697.00	3,785,197,900	1.92
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	349,400	8,799.46	3,074,533,580	7,950.00	2,777,730,000	1.41
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	553,900	5,263.22	2,915,298,477	4,900.00	2,714,110,000	1.38
日本	株式	ソニー	電気機器	525,500	4,175.38	2,194,163,582	5,146.00	2,704,223,000	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	587,200	4,114.13	2,415,819,217	4,458.00	2,617,737,600	1.33
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	707,900	3,148.79	2,229,035,447	3,660.00	2,590,914,000	1.32
日本	株式	キーエンス	電気機器	38,600	51,946.30	2,005,127,544	66,040.00	2,549,144,000	1.29
日本	株式	任天堂	その他製品	48,400	35,370.69	1,711,941,412	46,860.00	2,268,024,000	1.15
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,539,700	195.81	2,063,831,406	191.40	2,017,298,580	1.02
日本	株式	ファナック	電気機器	74,700	22,387.62	1,672,355,524	26,960.00	2,013,912,000	1.02
日本	株式	KDDI	情報・通信業	695,000	3,036.58	2,110,423,922	2,716.50	1,887,967,500	0.96
日本	株式	キヤノン	電気機器	423,400	3,854.68	1,632,072,160	3,853.00	1,631,360,200	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	543,600	2,314.52	1,258,173,117	2,862.00	1,555,783,200	0.79
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	571,400	2,719.86	1,554,133,294	2,716.50	1,552,208,100	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	94,700	11,477.41	1,086,910,834	16,390.00	1,552,133,000	0.79
日本	株式	花王	化学	193,400	6,984.83	1,350,866,932	7,981.00	1,543,525,400	0.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	579,800	2,066.92	1,198,405,905	2,644.50	1,533,281,100	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	137,200	10,104.24	1,386,302,028	11,005.00	1,509,886,000	0.77
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	289,700	5,831.73	1,689,453,544	5,183.00	1,501,515,100	0.76
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	488,400	4,106.08	2,005,409,730	3,066.00	1,497,434,400	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	324,700	4,706.85	1,528,315,430	4,564.00	1,481,930,800	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,888,000	691.98	1,306,463,400	770.80	1,455,270,400	0.74
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	70,400	18,663.73	1,313,926,621	20,130.00	1,417,152,000	0.72
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	141,300	10,690.33	1,510,544,528	9,862.00	1,393,500,600	0.71



日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	292,300	4,721.47	1,380,086,856	4,735.00	1,384,040,500	0.70
日本	株式	パナソニック	電気機器	898,500	1,411.57	1,268,299,656	1,521.00	1,366,618,500	0.69
日本	株式	小松製作所	機械	379,800	2,805.34	1,065,471,520	3,547.00	1,347,150,600	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	786,500	1,585.89	1,247,307,443	1,701.50	1,338,229,750	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	808,300	1,412.09	1,141,392,702	1,614.00	1,304,596,200	0.66

(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	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	3.12
		食料品	4.28
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.17
		医薬品	4.62
		石油・石炭製品	0.66
		ゴム製品	0.86
		ガラス・土石製品	0.95
		鉄鋼	1.04
		非鉄金属	0.89
		金属製品	0.66
		機械	5.35
		電気機器	13.61
		輸送用機器	8.59
		精密機器	1.59
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.58
		陸運業	3.90
		海運業	0.20
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	7.20
		卸売業	4.62
		小売業	4.83
銀行業	6.90		
証券、商品先物取引業	0.96		
保険業	2.13		
その他金融業	1.21		
不動産業	2.33		

	サービス業	4.35
	小計	97.98
合計		97.98

(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	TOPIX先物	買建	237円		4,026,031,140	4,068,105,000	2.07

(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。

#### 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	303,045,237,950	82.80
地方債証券	日本	20,727,078,544	5.66
特殊債券	日本	26,175,423,389	7.15
社債券	日本	13,408,103,530	3.66
	フランス	1,004,100,000	0.27
	オーストラリア	300,777,000	0.08
	オランダ	200,930,000	0.05
	スウェーデン	200,502,000	0.05
	イギリス	100,914,000	0.03
	小計	15,215,326,530	4.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		824,897,134	0.23
合計(純資産総額)		365,987,963,547	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	101.05	5,598,703,700	100.87	5,588,475,000	0.100	2022/3/20	1.53
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.98	4,786,562,500	100.96	4,785,741,000	0.100	2022/9/20	1.31
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,390,000,000	100.91	4,430,142,400	100.65	4,418,666,700	0.100	2021/3/20	1.21
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	104.33	3,975,283,000	103.59	3,946,969,500	1.200	2020/12/20	1.08
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	103.29	3,801,256,000	0.400	2025/6/20	1.04
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	100.91	3,642,851,000	0.100	2022/6/20	1.00
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	100.54	3,629,638,400	0.100	2020/9/20	0.99
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	104.36	3,579,610,800	103.96	3,565,930,900	0.600	2023/12/20	0.97
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	100.39	3,533,904,000	0.100	2019/12/20	0.97
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,500,000,000	100.61	3,521,350,000	100.80	3,528,175,000	0.100	2027/3/20	0.96
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	100.40	3,524,075,100	0.200	2019/6/20	0.96
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	100.45	3,224,737,100	100.67	3,231,763,800	0.100	2027/12/20	0.88
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,110,000,000	104.00	3,234,577,000	103.73	3,226,158,500	0.500	2024/9/20	0.88
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	100.76	3,224,480,000	0.100	2021/9/20	0.88
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	100.94	3,200,043,500	101.04	3,203,063,100	0.100	2022/12/20	0.88
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	100.44	3,153,878,800	0.100	2020/3/20	0.86
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	102.63	3,109,719,300	0.300	2025/12/20	0.85
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	103.33	3,017,323,600	0.400	2025/9/20	0.82
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	100.59	2,977,730,400	0.100	2020/12/20	0.81
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	104.24	2,908,463,400	0.600	2024/6/20	0.79
日本	国債証券	第377回利付国債(2年)	2,650,000,000	100.49	2,662,985,000	100.28	2,657,632,000	0.100	2019/6/15	0.73
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	2,626,962,000	0.100	2026/3/20	0.72
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	100.36	2,589,520,200	0.100	2019/10/15	0.71
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	100.48	2,572,390,400	0.200	2019/9/20	0.70
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	2,554,971,100	0.100	2026/6/20	0.70
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	100.78	2,549,784,600	0.100	2027/6/20	0.70
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	103.25	2,529,649,500	0.400	2025/3/20	0.69
日本	国債証券	第309回利付国債(10年)	2,450,000,000	103.57	2,537,593,800	102.73	2,516,885,000	1.100	2020/6/20	0.69
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	104.39	2,432,334,500	104.10	2,425,623,200	0.600	2024/3/20	0.66

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	103.51	2,401,571,200	0.600	2023/3/20	0.66
----	------	----------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	-------	-----------	------

(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。

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	82.80
地方債証券	5.66
特殊債券	7.15
社債券	4.16
合計	99.77

(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。

#### 外国株式インデックス 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	185,234,492,100	58.48
	イギリス	20,602,207,609	6.50
	フランス	12,235,860,121	3.86
	ドイツ	12,112,005,342	3.82
	カナダ	11,316,909,885	3.57
	スイス	10,700,712,352	3.38
	オーストラリア	7,301,616,579	2.31
	オランダ	6,168,157,154	1.95
	アイルランド	4,279,290,587	1.35
	スペイン	4,028,177,785	1.27
	スウェーデン	3,276,495,437	1.03
	香港	2,921,234,923	0.92
	イタリア	2,600,163,095	0.82
	シンガポール	2,357,790,975	0.74
	デンマーク	2,260,111,044	0.71



	バミューダ	1,494,657,329	0.47
	ジャージー	1,479,845,182	0.47
	ベルギー	1,432,607,201	0.45
	フィンランド	1,276,530,102	0.40
	ケイマン	876,925,818	0.28
	ノルウェー	871,561,314	0.28
	キュラソー	751,642,444	0.24
	イスラエル	566,153,915	0.18
	ルクセンブルク	430,039,328	0.14
	オーストリア	325,752,340	0.10
	ニュージーランド	221,437,518	0.07
	ポルトガル	196,623,171	0.06
	パナマ	189,243,608	0.06
	リベリア	173,683,266	0.05
	マン島	95,321,363	0.03
	英ヴァージン諸島	76,156,844	0.02
	パプアニューギニア	69,352,544	0.02
	モーリシャス	11,881,583	0.00
	小計	297,934,639,858	94.06
投資信託受益証券	オーストラリア	169,083,225	0.05
	香港	58,505,798	0.02
	シンガポール	14,821,064	0.00
	小計	242,410,087	0.08
投資証券	アメリカ	5,353,214,717	1.69
	オーストラリア	630,648,739	0.20
	フランス	384,657,286	0.12
	イギリス	279,517,592	0.09
	香港	162,838,810	0.05
	シンガポール	138,358,583	0.04
	カナダ	60,050,131	0.02
	小計	7,009,285,858	2.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,546,890,886	3.65
合計(純資産総額)		316,733,226,689	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	アメリカ	8,086,818,816	2.55
	買建	カナダ	626,944,752	0.20
	買建	ドイツ	2,007,097,862	0.63

買建	イギリス	999,276,038	0.32
買建	オーストラリア	515,241,936	0.16

(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。

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		2,147,942,300	0.68

(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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	409,491	16,341.86	6,691,848,300	17,824.94	7,299,155,454	2.30
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	584,648	7,480.79	4,373,633,134	9,696.52	5,669,053,831	1.79
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	32,676	106,826.67	3,490,668,484	153,765.40	5,024,438,263	1.59
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,972	9,092.07	2,518,249,302	11,683.21	3,235,922,816	1.02
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	190,361	16,195.89	3,083,067,632	16,976.08	3,231,585,392	1.02
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	214,843	13,487.37	2,897,669,025	13,614.65	2,925,013,539	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,114	103,244.84	2,592,891,006	109,617.36	2,752,930,620	0.87
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	338,335	8,624.13	2,917,847,025	7,926.56	2,681,834,843	0.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,818	105,499.93	2,512,797,383	110,185.75	2,624,404,279	0.83
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	791,346	2,476.64	1,959,879,956	3,186.13	2,521,337,245	0.80
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,464	17,744.81	1,800,460,278	21,192.75	2,150,301,714	0.68
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,716	9,203.60	2,289,084,611	8,418.77	2,093,883,943	0.66
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	373,750	5,564.36	2,079,680,236	5,568.03	2,081,054,352	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	373,935	3,878.41	1,450,276,026	5,532.97	2,068,974,577	0.65

アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	490,614	4,042.11	1,983,118,315	3,787.45	1,858,178,938	0.59
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	144,929	10,099.95	1,463,776,665	12,708.42	1,841,819,878	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	151,790	11,150.80	1,692,581,057	12,115.60	1,839,028,381	0.58
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	477,201	3,425.75	1,634,771,823	3,770.45	1,799,266,137	0.57
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	393,079	3,346.55	1,315,462,458	4,556.63	1,791,116,979	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	93,339	16,490.27	1,539,185,521	18,936.21	1,767,487,615	0.56
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	77,581	18,991.85	1,473,407,204	22,735.35	1,763,831,964	0.56
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	202,806	9,257.85	1,877,548,108	8,422.70	1,708,175,556	0.54
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	329,757	4,825.94	1,591,389,961	5,080.39	1,675,296,408	0.53
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,602,916	1,006.09	1,612,678,973	990.38	1,587,498,127	0.50
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,238	20,309.70	918,770,596	34,833.97	1,575,819,189	0.50
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	177,940	8,751.31	1,557,208,942	8,601.35	1,530,525,251	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	212,257	6,598.56	1,400,591,908	7,171.19	1,522,137,398	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	323,690	4,816.72	1,559,124,499	4,614.00	1,493,506,696	0.47
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	75,127	13,044.35	979,982,917	18,608.99	1,398,038,223	0.44
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	56,225	29,539.79	1,660,874,948	24,392.40	1,371,462,859	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別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	6.32
		素材	4.77
		資本財	7.30
		商業・専門サービス	1.02
		運輸	1.93
		自動車・自動車部品	1.53
		耐久消費財・アパレル	1.78
		消費者サービス	1.81
		メディア	2.11
		小売	4.25

	食品・生活必需品小売り	1.58
	食品・飲料・タバコ	4.93
	家庭用品・パーソナル用品	1.91
	ヘルスケア機器・サービス	4.04
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.67
	銀行	9.28
	各種金融	4.50
	保険	4.01
	不動産	0.62
	ソフトウェア・サービス	10.40
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.00
	電気通信サービス	2.35
	公益事業	2.93
	半導体・半導体製造装置	3.03
	小計	94.06
投資信託受益証券		0.08
投資証券		2.21
合計		96.35

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	576	アメリカドル	79,320,482	8,427,008,008	76,118,400	8,086,818,816	2.55
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	42	カナダドル	7,684,523	633,051,005	7,610,400	626,944,752	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	54	スイスフラン	4,661,198	518,931,173	4,642,380	516,836,165	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	348	ユーロ	11,447,386	1,494,112,820	11,417,880	1,490,261,697	0.47
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	44	オーストラリアドル	6,547,658	534,681,752	6,309,600	515,241,936	0.16
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	96	イギリスポンド	6,741,055	1,003,338,626	6,713,760	999,276,038	0.32

(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。



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	11,460,000.00	1,222,026,200	1,217,239,600	0.38
	カナダドル	買建	1,220,000.00	100,426,900	100,479,200	0.03
	ユーロ	買建	3,160,000.00	414,017,070	412,443,200	0.13
	イギリスポンド	買建	1,310,000.00	196,053,180	194,954,200	0.06
	スイスフラン	買建	860,000.00	95,906,170	95,743,800	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	1,750,000.00	22,204,350	22,207,500	0.01
	オーストラリアドル	買建	920,000.00	75,205,292	75,108,800	0.02
	香港ドル	買建	2,200,000.00	29,963,120	29,766,000	0.01

(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。

## 外国債券インデックス 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	アメリカ	98,423,602,200	40.95
	フランス	24,839,486,885	10.34
	イタリア	23,541,902,425	9.80
	イギリス	16,911,428,145	7.04
	ドイツ	16,857,966,289	7.01
	スペイン	14,597,138,173	6.07
	ベルギー	6,059,651,366	2.52
	オランダ	5,127,423,986	2.13
	オーストラリア	4,953,739,481	2.06
	カナダ	4,857,908,546	2.02
	オーストリア	3,721,838,945	1.55
	アイルランド	1,982,869,818	0.83
	メキシコ	1,949,130,698	0.81
	ポーランド	1,609,599,773	0.67
	南アフリカ	1,585,810,740	0.66
	フィンランド	1,515,122,822	0.63
	デンマーク	1,408,125,236	0.59
	マレーシア	1,147,420,960	0.48
	シンガポール	935,949,651	0.39
	スウェーデン	917,136,789	0.38
ノルウェー	711,282,821	0.30	
スイス	406,474,814	0.17	

	小計	234,061,010,563	97.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,265,275,622	2.61
合計(純資産総額)		240,326,286,185	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	アメリカ	1,147,360,486	0.48
	買建	ドイツ	1,653,286,398	0.69

(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。

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		3,932,297,500	1.64

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	17,150,000	10,637.13	1,824,269,117	10,472.30	1,795,999,670	2.875	2043/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,522.50	1,841,438,297	10,203.38	1,785,591,799	1.750	2023/5/15	0.74
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	14,508.95	1,595,985,573	14,136.68	1,555,035,510	3.500	2020/4/25	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,522.62	1,541,564,209	10,323.70	1,512,423,123	1.875	2022/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	14,500,000	9,741.14	1,412,466,112	9,666.05	1,401,577,999	2.500	2046/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.875% 12/15/20	12,500,000	10,586.70	1,323,338,720	10,490.06	1,311,257,877	1.875	2020/12/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,750.17	1,343,772,344	10,446.36	1,305,795,587	2.375	2024/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	9,975.36	1,316,748,048	9,649.05	1,273,675,044	1.500	2026/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,482.41	1,289,337,072	10,127.28	1,245,656,339	2.000	2025/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	12,150,000	10,561.10	1,283,173,844	10,191.81	1,238,305,489	2.250	2027/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,950,000	10,677.82	1,275,999,610	10,313.15	1,232,422,432	2.375	2027/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,190.78	1,242,177,023	10,991.02	1,220,003,950	3.625	2021/2/15	0.51

アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/19	11,500,000	10,600.83	1,219,096,563	10,502.61	1,207,801,221	1.250	2019/6/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	10,998.62	1,209,848,397	10,691.97	1,176,116,889	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,585.13	1,185,534,667	10,313.77	1,155,143,008	1.750	2022/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,541.15	1,148,985,964	10,429.72	1,136,839,535	2.875	2045/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,309.44	1,107,824,533	9,147.08	1,088,502,671	2.250	2046/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,507.20	1,103,256,186	10,224.04	1,073,524,342	2.000	2024/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 06/30/19	10,000,000	10,670.00	1,067,000,192	10,552.28	1,055,228,821	1.625	2019/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,725.41	1,088,629,968	10,349.75	1,050,500,535	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,508.19	1,066,581,772	10,271.07	1,042,513,710	1.750	2022/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	10,616.56	1,061,656,320	10,422.61	1,042,261,294	1.500	2020/8/15	0.43
フランス	国債証券	FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000	14,612.79	1,037,508,113	14,457.56	1,026,487,461	2.250	2022/10/25	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,423.20	1,042,320,640	10,183.63	1,018,363,913	1.250	2021/10/31	0.42
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000	15,043.40	1,030,473,542	14,692.57	1,006,441,123	3.250	2021/10/25	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,388.72	1,018,095,117	10,193.94	999,006,469	1.125	2021/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,601.96	1,012,488,040	10,326.15	986,147,385	1.750	2022/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,597.97	1,012,106,249	10,304.90	984,118,526	1.750	2022/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/21	9,500,000	10,510.91	998,537,395	10,301.24	978,618,406	1.375	2021/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	8,750,000	11,140.81	974,821,042	10,814.68	946,284,915	3.375	2019/11/15	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.39
合計	97.39

(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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	44	アメリカ ドル	5,021,965.17	533,533,580	5,036,281.36	535,054,532	0.22
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	27	アメリカ ドル	3,250,342.42	345,316,379	3,270,797.01	347,489,474	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	17	アメリカ ドル	2,445,318	259,790,584	2,492,625	264,816,480	0.11
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	20	ユーロ	2,237,260	292,007,175	2,239,500	292,299,540	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	26	ユーロ	3,396,374	443,294,734	3,412,500	445,399,500	0.19

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	44	ユーロ	6,941,706	906,031,467	7,014,920	915,587,358	0.38
-----	-------------------	-----------	----	----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

(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。

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	16,300,000.00	1,727,654,368	1,729,919,000	0.72
	カナダドル	買建	2,010,000.00	165,650,594	165,443,100	0.07
	ユーロ	買建	12,800,000.00	1,679,760,612	1,670,912,000	0.70
	イギリスポンド	買建	2,460,000.00	364,745,550	366,023,400	0.15

(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。

## 新興国株式インデックス 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	ケイマン	7,830,643,724	15.75
	韓国	7,310,113,463	14.71
	台湾	5,587,223,565	11.24
	中国	4,654,848,188	9.37
	インド	3,993,011,599	8.03
	ブラジル	3,553,474,921	7.15
	南アフリカ	3,079,064,830	6.19
	ロシア	1,732,321,225	3.49
	香港	1,593,311,329	3.21
	メキシコ	1,348,458,577	2.71
	マレーシア	1,210,018,809	2.43
	タイ	1,166,026,006	2.35
	インドネシア	999,886,257	2.01
	チリ	586,878,023	1.18
	ポーランド	569,978,341	1.15
	フィリピン	484,563,116	0.97
	トルコ	466,690,901	0.94
	バミューダ	438,232,183	0.88
	アラブ首長国連邦	298,491,034	0.60
	カタール	254,837,060	0.51



	コロンビア	194,959,119	0.39
	アメリカ	177,939,183	0.36
	ハンガリー	176,577,533	0.36
	ギリシャ	141,460,557	0.28
	チェコ	90,899,068	0.18
	エジプト	50,509,369	0.10
	マン島	31,924,888	0.06
	ペルー	27,393,336	0.06
	ルクセンブルク	19,511,378	0.04
	マルタ共和国	6,603,830	0.01
	小計	48,075,851,412	96.73
投資信託受益証券	ブラジル	98,544,345	0.20
投資証券	南アフリカ	145,252,404	0.29
	メキシコ	49,361,270	0.10
	トルコ	9,247,728	0.02
	小計	203,861,402	0.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,324,572,705	2.66
合計(純資産総額)		49,702,829,864	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	アメリカ	1,381,800,998	2.78

(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。

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		127,151,440	0.26
	売建		1,825,107	0.00

(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(%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	472,000	5,329.05	2,515,312,710	5,545.98	2,617,704,448	5.27
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,028	279,208.60	2,241,486,688	244,954.79	1,966,497,134	3.96
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	95,518	19,783.40	1,889,670,841	19,499.28	1,862,533,144	3.75
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,039,389	880.40	1,795,491,960	888.15	1,811,303,734	3.64
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	36,460	31,978.51	1,165,936,732	25,968.72	946,819,648	1.90
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	7,069,620	95.14	672,619,745	109.13	771,524,598	1.55
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	23,402	25,707.48	601,606,594	23,711.70	554,901,335	1.12
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,034,515	85.68	517,046,873	91.12	549,890,352	1.11
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	503,000	1,079.62	543,051,960	974.20	490,024,109	0.99
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	424,500	1,007.01	427,476,055	1,080.49	458,668,854	0.92
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	271,721	1,354.01	367,914,269	1,648.59	447,956,605	0.90
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	217,842	1,718.47	374,355,467	1,979.25	431,164,040	0.87
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,287,311	388.93	500,678,997	327.60	421,723,084	0.85
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	49,668	8,248.19	409,671,141	8,021.97	398,435,206	0.80
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	129,894	2,862.72	371,850,384	3,012.24	391,271,903	0.79
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	6,588,200	52.93	348,778,752	57.13	376,441,842	0.76
ブラジル	株式	VALE SA	素材	260,778	1,094.73	285,481,776	1,356.20	353,669,027	0.71
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	237,229	1,490.10	353,496,655	1,456.45	345,513,363	0.70
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	248,510	1,076.79	267,594,596	1,269.13	315,392,739	0.63
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	406,600	661.12	268,813,570	773.36	314,451,876	0.63
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,433	227,871.90	326,540,433	202,297.50	289,892,318	0.58
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	148,301	1,605.23	238,057,371	1,867.46	276,947,668	0.56
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	37,814	6,128.32	231,736,619	7,319.93	276,796,060	0.56
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,721,740	97.34	264,945,059	100.91	274,657,588	0.55
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	469,919	476.11	223,734,535	516.96	242,931,130	0.49
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,538,000	151.96	233,725,892	156.52	240,731,451	0.48
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	54,669	4,317.10	236,011,987	4,301.65	235,167,319	0.47
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	337,840	558.95	188,837,541	687.90	232,401,251	0.47
南アフリカ	株式	STANDARD BANK GROUP LTD	銀行	112,744	1,573.08	177,356,265	1,963.74	221,400,624	0.45

韓国	株式	CELLTRION INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,864	18,632.98	127,896,843	31,668.29	217,371,211	0.44
----	----	---------------	------------------------	-------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

(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	7.10
		素材	7.02
		資本財	3.43
		商業・専門サービス	0.11
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	2.84
		耐久消費財・アパレル	0.97
		消費者サービス	1.19
		メディア	2.28
		小売	2.02
		食品・生活必需品小売り	1.59
		食品・飲料・タバコ	3.50
		家庭用品・パーソナル用品	1.11
		ヘルスケア機器・サービス	0.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.18
		銀行	17.51
		各種金融	2.63
		保険	3.29
		不動産	2.28
		ソフトウェア・サービス	13.44
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.98		
電気通信サービス	4.50		
公益事業	2.20		
半導体・半導体製造装置	5.57		
	小計	96.73	
投資信託受益証券			0.20
投資証券			0.41
合計			97.34

(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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	219	アメリカドル	13,159,333	1,398,047,538	13,006,410	1,381,800,998	2.78

(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。

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	1,182,281.62	125,938,893	125,575,653	0.25
	フィリピンペソ	買建	776,250.00	1,562,110	1,575,787	0.00
	アメリカドル	売建	14,877.24	1,562,110	1,580,111	0.00
	ブラジルリアル	売建	7,625.16	241,793	244,996	0.00

(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。

## 新興国債券インデックス 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	メキシコ	3,578,789,626	10.07
	ブラジル	3,500,488,977	9.85
	インドネシア	3,310,232,975	9.31
	ポーランド	3,174,538,027	8.93
	南アフリカ	3,088,358,013	8.69
	タイ	2,778,245,643	7.82
	ロシア	2,723,896,807	7.66
	コロンビア	2,358,932,555	6.64
	トルコ	2,236,198,968	6.29
	マレーシア	2,031,107,910	5.71
	ハンガリー	1,604,845,081	4.52
	チェコ	1,391,404,050	3.91
	ペルー	936,249,260	2.63
	チリ	852,659,098	2.40
	フィリピン	95,910,293	0.27

	ウルグアイ	84,680,565	0.24
	小計	33,746,537,848	94.94
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,796,720,947	5.06
合計（純資産総額）		35,543,258,795	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		9,367,757	0.03
	売建		9,435,888	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	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 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	23,100,000,000	4.75	1,098,542,239	4.78	1,104,268,011	9.850	2027/6/28	3.11
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	4,650,000,000	18.54	862,254,945	18.33	852,659,098	5.500	2020/8/5	2.40
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000	4.03	790,880,776	4.01	786,106,608	7.750	2021/4/14	2.21
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	50,250,000	965.06	484,946,125	1,038.43	521,815,206	10.500	2026/12/21	1.47
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/20	17,850,000	2,701.98	482,303,785	2,853.02	509,264,410	0.000	2020/1/1	1.43
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000	3,292.86	487,344,651	3,373.62	499,296,013	10.000	2021/1/1	1.40
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000	3.59	465,632,402	3.61	468,557,936	4.375	2023/3/21	1.32
メキシコ	国債証券	MBONO 5% 12/11/19	78,200,000	562.56	439,928,313	563.88	440,957,620	5.000	2019/12/11	1.24
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	76,850,000	574.12	441,214,030	573.17	440,486,639	6.500	2021/6/10	1.24
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	16,800,000	2,380.43	399,913,525	2,486.04	417,655,711	0.000	2021/7/1	1.18
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	12,000,000	3,263.04	391,565,673	3,357.75	402,930,324	10.000	2023/1/1	1.13
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	59,850,000	678.95	406,353,097	671.32	401,788,327	10.000	2024/12/5	1.13
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	43,150,000	788.13	340,079,246	888.19	383,257,579	8.750	2048/2/28	1.08
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	40,500,000,000	0.85	347,496,474	0.85	347,717,448	8.375	2024/3/15	0.98
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	12,400,000	2,574.24	319,205,883	2,731.19	338,668,129	0.000	2020/7/1	0.95

メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	58,500,000	570.51	333,751,979	570.13	333,529,063	6.500	2022/6/9	0.94
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	91,000,000	366.36	333,389,329	365.20	332,332,728	3.650	2021/12/17	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	10,900,000	2,912.86	317,502,412	2,992.78	326,213,598	2.500	2026/7/25	0.92
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000	3,063.98	315,590,244	3,121.08	321,471,642	2.250	2022/4/25	0.90
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	71,500,000	420.01	300,308,927	412.86	295,201,192	4.875	2029/6/22	0.83
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	33,800,000,000	0.87	295,540,440	0.86	293,694,960	8.375	2026/9/15	0.83
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 10/01/19	9,750,000	2,825.52	275,488,302	2,913.23	284,039,956	0.000	2019/10/1	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	47,200,000	597.17	281,867,708	594.52	280,613,853	8.000	2020/6/11	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	79,700,000	353.05	281,385,632	350.68	279,499,611	3.875	2019/6/13	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	46,600,000	594.59	277,079,056	594.43	277,008,562	7.750	2042/11/13	0.78
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	74,500,000	370.73	276,199,587	369.27	275,111,663	3.625	2023/6/16	0.77
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	31,300,000	771.33	241,427,107	874.35	273,673,322	8.500	2037/1/31	0.77
タイ	国債証券	THAIGB 1.875% 06/17/22	79,000,000	341.26	269,601,878	342.42	270,515,118	1.875	2022/6/17	0.76
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	71,000,000	380.65	270,266,380	377.57	268,077,113	3.850	2025/12/12	0.75
タイ	国債証券	THAIGB 2.55% 06/26/20	76,750,000	349.14	267,969,555	348.75	267,668,158	2.550	2020/6/26	0.75

(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	94.94
合計	94.94

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの


種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	88,192.03	9,435,888	9,367,757	0.03
	ロシアルーブル	売建	5,100,480.00	9,435,888	9,435,888	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。

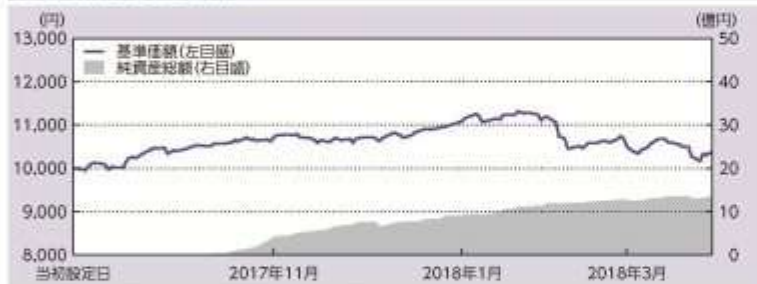
## 参考情報

## 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8月25日  
作成基準日：2018年3月30日

## 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,360円
純資産総額	13.48億円

※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	-	-	-	-	-
分配金	-	-	-	-	-

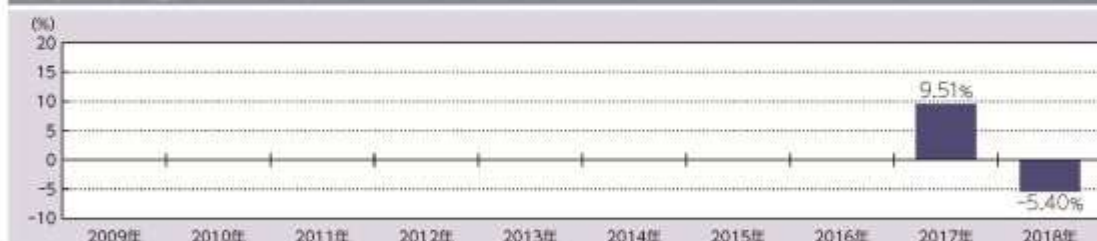
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払のされない場合があります。

## 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
外国株式 インデックス マザーファンド	40.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア	-	-	0.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
新興国株式 インデックス マザーファンド	29.4%	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.5%
		SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	テクノロジー・ハードウェア	-	-	1.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	13.3%	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	国債	-	2.875%	2043/05/15	0.1%
		T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.1%
新興国債券 インデックス マザーファンド	9.7%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
		CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	国債	-	5.500%	2020/08/05	0.2%
国内株式 インデックス マザーファンド	4.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	1.5%	第131回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.0%
		第133回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/09/20	0.0%

※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年末までの収益率です。また、2018年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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



## 第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間(平成29年 8月25日から平成30年 2月24日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 1 財務諸表

## 中間財務諸表

## SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）

## (1) 中間貸借対照表

(単位：円)

第1期中間計算期間 (平成30年 2月24日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	11,508,594
親投資信託受益証券	1,243,080,517
未収入金	1,413,137
流動資産合計	1,256,002,248
<b>資産合計</b>	<b>1,256,002,248</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	196
未払受託者報酬	151,790
未払委託者報酬	1,517,793
未払利息	44
その他未払費用	15,122
流動負債合計	1,684,945
<b>負債合計</b>	<b>1,684,945</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,184,339,074
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	69,978,229
元本等合計	1,254,317,303
<b>純資産合計</b>	<b>1,254,317,303</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,256,002,248</b>

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

第1期中間計算期間	
自 平成29年 8月25日	
至 平成30年 2月24日	
<b>営業収益</b>	
受取利息	3
有価証券売買等損益	23,920,128
営業収益合計	23,920,125
<b>営業費用</b>	
支払利息	3,745
受託者報酬	151,790
委託者報酬	1,517,793
その他費用	15,122
営業費用合計	1,688,450
営業利益又は営業損失（ ）	25,608,575
経常利益又は経常損失（ ）	25,608,575
中間純利益又は中間純損失（ ）	25,608,575
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	8,226,296
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	132,682,669
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	132,682,669
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,869,569
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,869,569
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	69,978,229

## ( 3 ) 中間注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は設定日(平成29年 8月25日)から平成30年 6月11日までとなっております。第1期中間計算期間は設定日(平成29年 8月25日)から平成30年 2月24日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

		第1期中間計算期間 (平成30年 2月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数		1,184,339,074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)	1.0591円 (10,591円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	第1期中間計算期間 (平成30年 2月24日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(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。

## （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期中間計算期間 自 平成29年 8月25日 至 平成30年 2月24日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	1,578,399,284円
期中一部解約元本額	394,560,210円

## （デリバティブ取引に関する注記）

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、中間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。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成30年 2月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,505,929,270
株式	193,795,355,770
新株予約権証券	2,841,600
派生商品評価勘定	10,731,600
未収配当金	265,432,256
前払金	74,808,800
差入委託証拠金	113,647,600
流動資産合計	196,768,746,896
資産合計	196,768,746,896
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	85,571,180
未払金	1,213,680
未払解約金	308,645,096
未払利息	4,866
流動負債合計	395,434,822
負債合計	395,434,822
純資産の部	
元本等	
元本	125,397,781,389
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,975,530,685
元本等合計	196,373,312,074
純資産合計	196,373,312,074
負債純資産合計	196,768,746,896

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成30年 2月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)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 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成30年 2月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	125,397,781,389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 1.5660円 (1万口当たり純資産額) (15,660円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30年 2月24日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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30年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	119,170,463,069円
期中追加設定元本額	18,985,650,479円
期中一部解約元本額	12,758,332,159円
期末元本額	125,397,781,389円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	691,378,183円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,634,645,680円

区分	平成30年 2月24日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,122,259円
S M T T O P I X インデックス・オープン	8,894,433,275円
世界経済インデックスファンド	1,804,281,124円
日本株式インデックス・オープン	6,135,894,203円
D C マイセレクション 2 5	5,552,451,467円
D C マイセレクション 5 0	16,228,441,836円
D C マイセレクション 7 5	15,397,257,075円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,044,074,253円
D C マイセレクション S 2 5	2,113,755,578円
D C マイセレクション S 5 0	6,318,967,192円
D C マイセレクション S 7 5	4,267,245,912円
D C 日本株式インデックス・オープン S	4,910,322,989円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	420,799,599円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	586,984,538円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	353,827,782円
D C 世界経済インデックスファンド	1,379,926,280円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	358,776,603円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	23,175,777円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	79,992,212円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	46,806,616円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	388,346,185円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,532,327円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	141,638,154円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	534,621,463円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	80,487,828円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	659,760,094円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	2,128,669,007円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	806,084,475円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	4,542,423,759円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	683,979,043円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	83,980,767円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	906,107,151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）	1,900,434,295円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	478,471,335円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	654,519,151円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	56,606,322円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,025,838,394円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	4,942,670,260円
日本株式ファンド・シリーズ 2	1,348,821,380円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	139,272,035円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	174,542,204円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	221,563,640円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	12,194,327円

区分	平成30年 2月24日現在
SMT インデックスバランス・オープン	91,531,983円
SMT 世界経済インデックス・オープン	776,610円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	36,051,387円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	3,980,993円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	535,360円
グローバル経済コア	285,514,853円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,875,723円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	27,924,543円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	18,775,465,908円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（平成30年 2月24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	2,592,354,580	-	2,517,515,000	74,839,580
合計		2,592,354,580	-	2,517,515,000	74,839,580

（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。

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	平成30年 2月24日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,333,135,469
国債証券	297,728,854,000
地方債証券	20,246,572,397
特殊債券	25,810,312,221
社債券	15,215,500,710
未収利息	902,825,014
前払費用	35,480,611
流動資産合計	361,272,680,422
資産合計	361,272,680,422
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	324
未払金	604,439,044



	平成30年 2月24日現在
項目	金額（円）
未払解約金	179,882,955
未払利息	2,589
流動負債合計	784,324,912
負債合計	784,324,912
純資産の部	
元本等	
元本	259,587,649,991
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,900,705,519
元本等合計	360,488,355,510
純資産合計	360,488,355,510
負債純資産合計	361,272,680,422

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 2月24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> <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>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30年 2月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	259,587,649,991口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 103,737,000円</p>
3.	1口当たり純資産額 1.3887円

平成30年 2月24日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (13,887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）

金融商品の時価等に関する事項

平成30年 2月24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。
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。 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。

（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30年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	平成30年 2月24日現在
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	227,377,666,493円
期中追加設定元本額	39,936,361,270円
期中一部解約元本額	7,726,377,772円
期末元本額	259,587,649,991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）	3,205,363,179円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,980,228円
S M T 国内債券インデックス・オープン	11,356,343,329円
世界経済インデックスファンド	1,426,109,897円
D C マイセレクション 2 5	18,738,488,737円
D C マイセレクション 5 0	21,542,453,328円
D C マイセレクション 7 5	5,926,714,347円
D C 日本債券インデックス・オープン	445,852,065円
D C 日本債券インデックス・オープン S	73,600,949,410円
D C 日本債券インデックス・オープン P	33,156,934,255円
D C マイセレクション S 2 5	7,145,155,322円
D C マイセレクション S 5 0	8,322,722,534円
D C マイセレクション S 7 5	1,665,257,021円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,282,615,234円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,029,104,198円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	315,848,392円
D C 世界経済インデックスファンド	1,071,757,513円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	103,866,752円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	9,487,526円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	102,519,910円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	18,021,345円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,038,137円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	344,461,750円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	499,841,299円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	92,404,312円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	220,902,358円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	5,720,231,225円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,188,697,240円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,566,575,311円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	981,060,611円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	221,696,783円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,587,926,551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）	1,506,604,305円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,791,268,095円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,259,909,530円

区分	平成30年 2月24日現在
国内バランス 25VA1（適格機関投資家専用）	192,163,197円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,954,142,747円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,446,797,045円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	42,002,605円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	531,646,687円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	65,127,456円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,766,945円
SMT インデックスバランス・オープン	86,430,755円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	1,923,280円
SMT 世界経済インデックス・オープン	594,359円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	13,318,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	13,438,996円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	556,423円
グローバル経済コア	248,171,360円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,994,090円
FOFs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）	29,486,186,339円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（平成30年 2月24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	債券先物取引				
	買建	150,890,324	-	150,890,000	324
合計		150,890,324	-	150,890,000	324

(注)1.時価の算定方法

債券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.債券先物取引の残高は、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。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	平成30年 2月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,991,676,904
コール・ローン	357,687,650
株式	302,929,278,159
投資信託受益証券	249,652,071

	平成30年 2月24日現在
項目	金額（円）
投資証券	6,830,658,112
派生商品評価勘定	55,419,500
未収入金	1,251,685
未収配当金	509,784,354
前払金	142,165,252
差入委託証拠金	1,625,975,124
流動資産合計	320,693,548,811
資産合計	320,693,548,811
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	198,470,392
未払解約金	102,978,088
未払利息	694
流動負債合計	301,449,174
負債合計	301,449,174
純資産の部	
元本等	
元本	134,164,283,606
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	186,227,816,031
元本等合計	320,392,099,637
純資産合計	320,392,099,637
負債純資産合計	320,693,548,811

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 2月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

平成30年 2月24日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)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、当該先物取引及び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。 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)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> <p>(3)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30年 2月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	134,164,283,606口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2,3881円 (1万口当たり純資産額) (23,881円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 2月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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30年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	137,154,212,826円
期中追加設定元本額	11,025,763,068円
期中一部解約元本額	14,015,692,288円
期末元本額	134,164,283,606円
期末元本額の内訳	

区分	平成30年 2月24日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,367,253,970円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,319,236円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,640,813,495円
世界経済インデックスファンド	6,677,264,358円
外国株式インデックス・オープン	801,227,366円
D C マイセレクション 2 5	988,028,145円
D C マイセレクション 5 0	4,580,141,449円
D C マイセレクション 7 5	5,050,203,951円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,324,995,717円
D C マイセレクション S 2 5	376,795,967円
D C マイセレクション S 5 0	1,772,500,825円
D C マイセレクション S 7 5	1,406,405,853円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	133,003,223円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	187,250,243円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	112,885,795円
D C 世界経済インデックスファンド	5,195,439,240円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,659,747,256円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	21,791,616円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,113,767円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	63,199,408円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	95,282,679円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	347,671,662円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	51,897,399円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	425,427,509円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	954,298,480円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	458,137,035円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,987,801,316円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,198,080,174円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	161,925,973円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	444,709,817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）	487,911,571円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	134,388,902円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,161,705,290円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,574,013,483円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,446,839,545円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,232,388,840円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,430,177,721円
分散投資コア戦略ファンド A	1,851,970,524円
分散投資コア戦略ファンド S	3,641,085,478円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	528,707,079円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	670,102,567円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,073,187,852円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	844,079,081円



区分	平成30年 2月24日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	44,541,370円
SMT インデックスバランス・オープン	343,544,744円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,994,915,032円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,900,778,953円
SMT 世界経済インデックス・オープン	4,632,862円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	214,899,695円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	23,603,205円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	343,243円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	14,871,317円
グローバル経済コア	1,105,469,263円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	1,879,094円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,712,961,995円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,215,671,976円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（平成30年 2月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	10,409,001,148	-	10,266,835,896	142,165,252
	合計	10,409,001,148	-	10,266,835,896	142,165,252

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場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。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

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。

#### 通貨関連

（平成30年 2月24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	222,260,040	-	221,374,400	885,640
	アメリカドル	161,250,000	-	160,485,000	765,000
	カナダドル	9,308,200	-	9,254,300	53,900
	ユーロ	32,975,750	-	32,967,500	8,250
	スイスフラン	4,586,040	-	4,586,400	360

	スウェーデンク ローナ	14,140,050	-	14,081,200	58,850
	合計	222,260,040	-	221,374,400	885,640

## (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はありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成30年 2月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	460,247,631
コール・ローン	2,999,280,728
国債証券	249,642,900,184
派生商品評価勘定	3,891,826
未収利息	1,915,018,355
前払金	4,262,153
前払費用	121,253,232
差入委託証拠金	82,803,245
流動資産合計	255,229,657,354
資産合計	255,229,657,354
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,471,081
未払解約金	133,350,704
未払利息	5,825
流動負債合計	168,827,610
負債合計	168,827,610
純資産の部	
元本等	
元本	95,577,125,201
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	159,483,704,543
元本等合計	255,060,829,744
純資産合計	255,060,829,744
負債純資産合計	255,229,657,354

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 2月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

平成30年 2月24日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び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)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</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30年 2月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	95,577,125,201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 2.6686円 (1万口当たり純資産額) (26,686円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 2月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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30年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	83,845,600,457円
期中追加設定元本額	17,565,132,997円
期中一部解約元本額	5,833,608,253円
期末元本額	95,577,125,201円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,149,037,789円

区分	平成30年 2月24日現在
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	919,207,221円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	572,553,708円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,941,300,477円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,418,789円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,818,257,346円
世界経済インデックスファンド	5,716,161,435円
DCマイセレクション25	1,522,446,505円
DCマイセレクション50	1,335,976,609円
DCマイセレクション75	883,760,338円
DC外国債券インデックス・オープン	1,689,371,371円
DCマイセレクションS25	574,305,867円
DCマイセレクションS50	514,651,542円
DCマイセレクションS75	245,397,748円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	54,838,194円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	54,846,314円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	24,456,872円
DC世界経済インデックスファンド	4,425,010,948円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	618,885,254円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	50,006,945円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	6,331,141円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,626,376円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	65,331,364円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	197,327,980円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	300,427,860円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	232,687,464円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	635,808,983円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,792,498,329円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	736,245,617円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,692,486,756円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,029,458,354円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	177,518,917円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	766,600,685円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,924,259,701円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	291,782,395円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	365,883,868円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,238,343,077円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	979,660,298円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	933,184,912円
外国債券ファンド・シリーズ1	630,936,493円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,806,769,020円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,940,983,520円
分散投資コア戦略ファンドA	1,015,995,470円
分散投資コア戦略ファンドS	2,429,986,153円

区分	平成30年 2月24日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	154,156,084円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,667,434,079円
コア投資戦略ファンド(切替型)	559,533,315円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	221,637,088円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	113,147,890円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	834,622,536円
S M T インデックスバランス・オープン	270,851,680円
外国債券S M T Bセレクション(S M A専用)	22,363,725,172円
S M T 世界経済インデックス・オープン	4,126,225円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	60,793,950円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	61,312,957円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	301,290円
グローバル経済コア	1,024,542,707円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	1,700,946円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,044,492,721円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	4,309,264,545円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	7,572,456,011円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(平成30年 2月24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	債券先物取引 買建	2,166,387,961	-	2,162,125,808	4,262,153
合計		2,166,387,961	-	2,162,125,808	4,262,153

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

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。

#### 通貨関連

(平成30年 2月24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)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,065,652,102	-	3,038,335,000	27,317,102

	アメリカドル	1,441,809,983	-	1,430,054,400	11,755,583
	カナダドル	134,451,652	-	131,989,900	2,461,752
	ユーロ	1,279,253,064	-	1,267,270,700	11,982,364
	イギリスポンド	210,137,403	-	209,020,000	1,117,403
	合計	3,065,652,102	-	3,038,335,000	27,317,102

## (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はありません。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成30年 2月24日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	895,090,815
コール・ローン	67,142,794
株式	48,703,810,423
投資信託受益証券	91,765,360
投資証券	215,522,336
派生商品評価勘定	6,139,164
未収入金	1,236,620
未収配当金	107,803,029
前払金	24,679,181
差入委託証拠金	172,379,523
流動資産合計	50,285,569,245
資産合計	50,285,569,245
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,022,345
未払金	3,986
未払株式払込金	1,102,273
未払解約金	19,651,395
未払利息	130
流動負債合計	51,780,129
負債合計	51,780,129
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	16,504,534,204
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,729,254,912
元本等合計	50,233,789,116
純資産合計	50,233,789,116
負債純資産合計	50,285,569,245

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 2月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び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>



	平成30年 2月24日現在
	<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)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)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30年 2月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	16,504,534,204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 3.0436円 (1万口当たり純資産額) (30,436円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 2月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

平成30年 2月24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>

## （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30年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	15,460,216,475円
期中追加設定元本額	2,177,249,837円
期中一部解約元本額	1,132,932,108円
期末元本額	16,504,534,204円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	6,522,603,795円
世界経済インデックスファンド	2,742,543,474円
DC 新興国株式インデックス・オープン	3,416,566,910円
DC 世界経済インデックスファンド	2,192,639,779円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	37,133,960円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	217,308,412円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	282,727,574円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	355,708,454円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,939,738円
SMT インデックスバランス・オープン	140,489,937円
SMT 世界経済インデックス・オープン	2,619,297円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	122,527,891円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	13,469,164円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	277,081円
グローバル経済コア	434,068,951円

区分	平成30年 2月24日現在
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	5,909,787円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(平成30年 2月24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	1,299,136,178	-	1,274,456,997	24,679,181
合計		1,299,136,178	-	1,274,456,997	24,679,181

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場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。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

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。

## 通貨関連

(平成30年 2月24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	101,839,000	-	101,635,000	204,000
	アメリカドル	101,839,000	-	101,635,000	204,000
合計		101,839,000	-	101,635,000	204,000

(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。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成30年 2月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	360,404,433
コール・ローン	604,688,587
国債証券	33,227,936,325
派生商品評価勘定	65,889
未収利息	516,091,533
前払費用	39,406,767
流動資産合計	34,748,593,534
資産合計	34,748,593,534
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,522
未払解約金	2,998,824
未払利息	1,174
流動負債合計	3,053,520
負債合計	3,053,520
純資産の部	
元本等	
元本	19,993,711,373
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,751,828,641
元本等合計	34,745,540,014
純資産合計	34,745,540,014
負債純資産合計	34,748,593,534

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 2月24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> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

平成30年 2月24日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成30年 2月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	19,993,711,373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 1.7378円 (1万口当たり純資産額) (17,378円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30年 2月24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30年 2月24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	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。 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。

## （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30年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	17,944,275,245円
期中追加設定元本額	3,110,278,641円
期中一部解約元本額	1,060,842,513円
期末元本額	19,993,711,373円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,600,806,861円
世界経済インデックスファンド	4,525,318,892円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,457,782,573円
DC世界経済インデックスファンド	3,534,320,705円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,910,155,274円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	55,835,949円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	116,218,653円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,355,552,871円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	180,783,861円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	91,349,586円
SMT インデックスバランス・オープン	227,520,816円
SMT 世界経済インデックス・オープン	4,589,698円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	68,918,257円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	69,840,732円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	474,855円

区分	平成30年 2月24日現在
グローバル経済コア	794,241,790円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（平成30年 2月24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	12,452,907	-	12,399,385	53,522
	アメリカドル	12,452,907	-	12,399,385	53,522
	売建	12,452,907	-	12,387,018	65,889
	ロシアルーブル	12,452,907	-	12,387,018	65,889
合計		24,905,814	-	24,786,403	12,367

(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。

#### 2 ファンドの現況

##### SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）

#### 純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	1,353,407,301円
負債総額	5,643,269円
純資産総額（ - ）	1,347,764,032円
発行済口数	1,300,959,418口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0360円
（1万口当たり純資産額）	（10,360円）

（参考）

#### 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	198,097,467,882円
負債総額	1,220,517,229円
純資産総額（ - ）	196,876,950,653円
発行済口数	127,745,536,119口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5412円
（1万口当たり純資産額）	（15,412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30年 3月30日現在）

資産総額	370,333,391,896円
負債総額	4,345,428,349円
純資産総額（ - ）	365,987,963,547円
発行済口数	263,037,706,348口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3914円
（1万口当たり純資産額）	（13,914円）

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	322,310,913,842円
負債総額	5,577,687,153円
純資産総額（ - ）	316,733,226,689円
発行済口数	136,675,205,075口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3174円
（1万口当たり純資産額）	（23,174円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	243,521,615,774円
------	------------------



負債総額	3,195,329,589円
純資産総額（ - ）	240,326,286,185円
発行済口数	89,365,934,207口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6892円
（1万口当たり純資産額）	（26,892円）

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	49,727,322,223円
負債総額	24,492,359円
純資産総額（ - ）	49,702,829,864円
発行済口数	16,859,573,299口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9480円
（1万口当たり純資産額）	（29,480円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成30年 3月30日現在）

資産総額	35,544,486,485円
負債総額	1,227,690円
純資産総額（ - ）	35,543,258,795円
発行済口数	20,484,423,410口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7351円
（1万口当たり純資産額）	（17,351円）

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1 委託会社等の概況

<訂正前>

(1)資本金の額（平成29年5月31日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成29年 8月 8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)資本金の額（平成30年 3月30日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成30年 5月24日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### 2 事業の内容及び営業の概況

<訂正前>

（前略）

平成29年5月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	479	9,061,021
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	52	206,711
単位型公社債投資信託	0	0
合計	531	9,267,732

<訂正後>

（前略）

平成30年3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	506	9,835,881
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	65	231,485
単位型公社債投資信託	0	0
合計	571	10,067,366

### 3 委託会社等の経理状況

#### <更新・訂正後>

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

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。

(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)
負債の部		
流動負債		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
固定負債		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		

その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	68,500	71,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

## ( 2 ) 損益計算書

( 単位：千円 )

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

賞与		274,792		258,946
退職給付費用		73,742		76,106
福利費		222,276		221,018
交際費		6,004		5,612
旅費交通費		67,392		61,961
租税公課		73,989		106,691
不動産賃借料		125,339		113,697
減価償却費		126,985		134,710
業務委託費	1	209,510	1	486,690
諸経費		217,580		223,685
一般管理費合計		3,246,214		3,304,885
営業利益		6,525,812		6,261,346

(単位：千円)

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

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(単位：千円)

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

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

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本
--	------

	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づ



き、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

#### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

##### 会計方針の変更

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

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

##### 追加情報

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

##### 注記事項

###### （貸借対照表関係）

###### 1有形固定資産の減価償却累計額

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

###### （損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

###### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

###### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

###### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

###### 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------------	-----	-------

平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日
----------------------	------	--------	--------	------------	------------

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

(リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いもの

と考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

### （注1）金融商品の時価の算定方法

#### （1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

#### （3）投資有価証券

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

#### （4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額（単位：千円）

区分	平成28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	3

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日）（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日現在）（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日現在）（単位：千円）

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

小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

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

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

当事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 退職給付債務に関する事項

(単位:千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

### 3. 退職給付費用に関する事項

(単位:千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	86,931	千円	28,688	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,993	"	6,074	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,437	"	30,265	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	119,400	"	133,869	"
その他	7,674	"	6,972	"
繰延税金資産 合計	251,436	"	205,870	"
繰延税金負債				

投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	244,602	"	199,037	"

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

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

### （持分法損益等）

該当事項はありません。

### （セグメント情報等）

#### （セグメント情報）

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

### （関連情報）

#### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2. 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

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

##### （2）有形固定資産

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

#### 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

### （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

### （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

### （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

### （関連当事者情報）

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

（1株当たり情報）

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

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 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)

## 資産の部

## 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

220,928

## 投資その他の資産

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

## 負債の部

## 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

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．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

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。）

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、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）

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おりません。	

（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。

## 5 その他

&lt; 訂正前 &gt;

（前略）

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成29年 8月 8日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

&lt; 訂正後 &gt;

（前略）

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成30年 5月24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。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成30年4月24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 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の平成29年8月25日から平成30年2月24日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の平成30年2月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年8月25日から平成30年2月24日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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、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。

[次へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成29年 6月 2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以 上

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

**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。