

## 【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10月1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】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【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】	投資業務推進部長 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】	SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）
【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】

平成29年12月1日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項のうち、グループ内の資産運用部門の再編・強化を目的とした三井住友信託銀行の資産運用機能との統合及び監査役設置会社から監査等委員会設置会社への移行によるコーポレートガバナンス態勢の更なる高度化を目的とした組織体制の変更を平成30年10月1日付で行ったことに伴い、当該事項を記載するため、ファンドの特色、投資方針、運用体制及び委託会社等の概況の更新を行いました。併せて以下の内容についても更新を行ったため、本訂正届出書を提出するものです。

- ・ 指数名称変更に伴う約款変更を行った旨の記載
- ・ 委託会社の経理状況の更新
- ・ 運用状況等のデータ等の更新

## 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

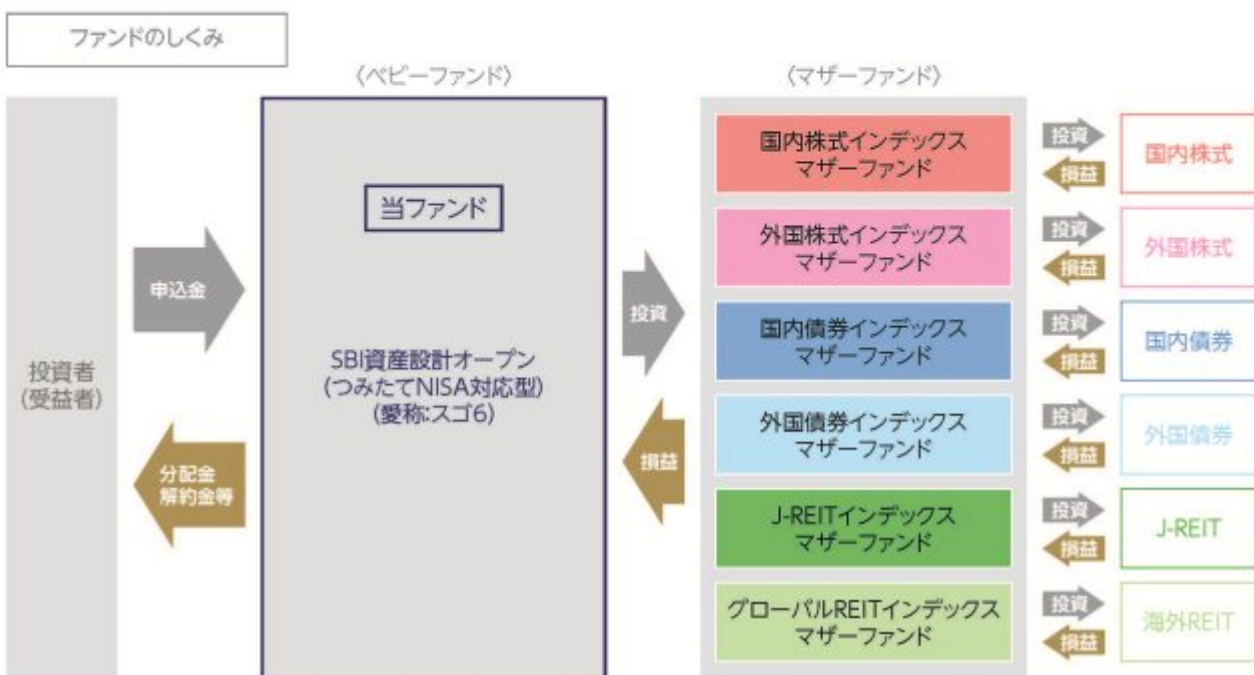
##### （1）ファンドの目的及び基本的性格

<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>

## 1. 国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券の6資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。

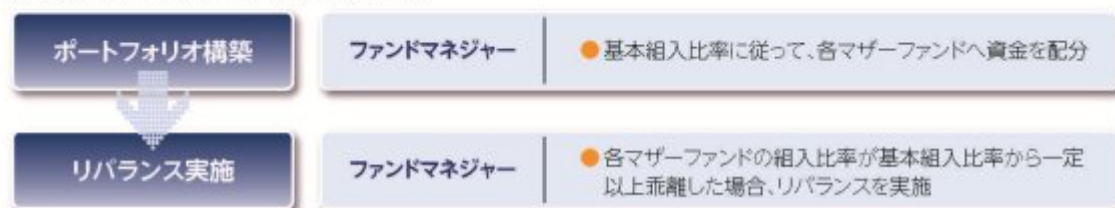


### ? ファミリーファンド方式とは

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。

### ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
国内債券	NOMURA-BPI 総合
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み)
海外 R E I T	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

\* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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。

「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。

「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。

「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。

「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。

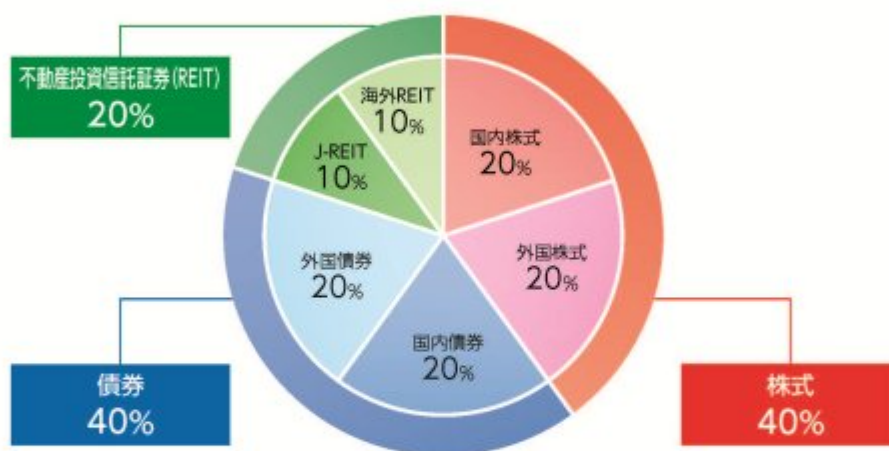
「東証REIT指数」とは、東証が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> は、S&P Globalの

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

### 3. 株式40%、債券40%、不動産投資信託証券(REIT)20%を基本組入比率として運用します。

基本組入比率



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

### 4. ノーロードファンドです。

- 購入時手数料が無料のノーロードファンドです。  
(運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して年率0.54%(税抜0.5%)です。)

## 分配方針

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

●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

※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

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

●外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

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

## (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9月29日現在)

イ. 資本金の額: 3億円

ロ. 委託会社の沿革

(中略)

平成24年4月1日: 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

(後略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況(平成30年10月1日現在)

イ. 資本金の額: 20億円

ロ. 委託会社の沿革

(中略)

平成24年4月1日: 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

平成30年10月1日: 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

(後略)

## 2 投資方針

## (1) 投資方針

<訂正前>



(前略)

投資態度

(中略)

ロ．各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。また、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。

マザーファンド受益証券	インデックス	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	NOMURA-BPI総合	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	TOPIX（東証株価指数）	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	<u>シティ世界国債インデックス</u> (除く日本、円ベース)	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	MSCI コクサイ・インデックス (円ベース)	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	東証REIT指数（配当込み）	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	10%

(後略)

&lt;訂正後&gt;

(前略)

投資態度

(中略)

ロ．各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。また、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。

マザーファンド受益証券	インデックス	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	NOMURA-BPI総合	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	TOPIX（東証株価指数）	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	<u>FTSE世界国債インデックス</u> (除く日本、円ベース)	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	MSCI コクサイ・インデックス (円ベース)	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	東証REIT指数（配当込み）	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	10%

（後略）

## （２）投資対象

<訂正前>

（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）

<訂正後>

（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。

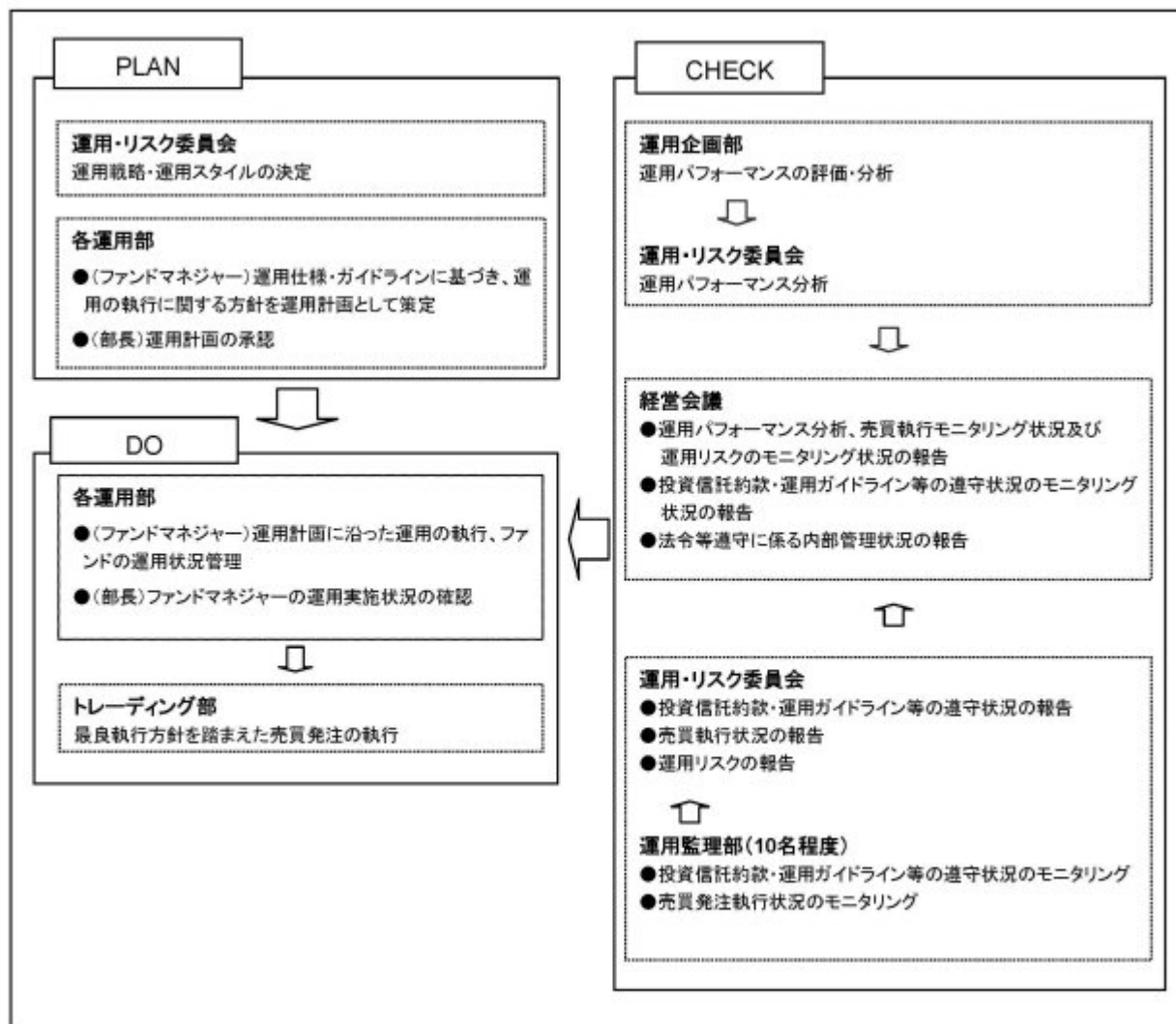
（後略）

## （３）運用体制

<更新・訂正後>

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





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

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

### 3 投資リスク

(2) リスクの管理体制及び〔参考情報〕を以下の内容に更新・訂正します。

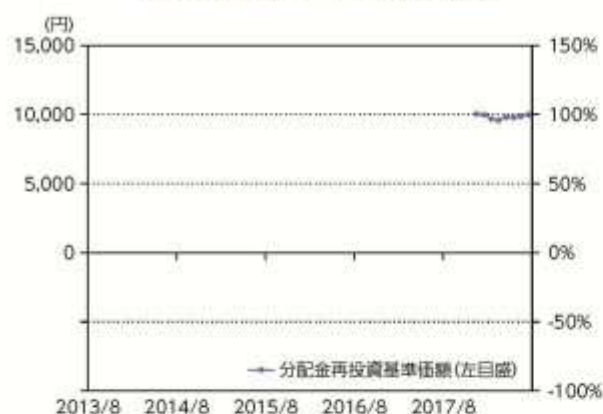
<更新・訂正後>

#### (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

\*2013年8月～2018年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## \*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>

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

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

日本国債… 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。目録は、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、販売あるいは勧誘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しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 手数料等及び税金

## (5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

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12月1日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

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

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

## 5 運用状況

以下は、2018年 7月31日現在の状況について記載してあります。

### （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	38,281,377	98.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		453,502	1.17
合計(純資産総額)		38,734,879	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。

## （参考）国内債券インデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	331,017,303,000	83.04
地方債証券	日本	22,327,380,266	5.60
特殊債券	日本	28,089,991,826	7.05
社債券	日本	14,007,002,660	3.51
	フランス	1,001,687,000	0.25
	オーストラリア	500,814,000	0.13
	オランダ	200,858,000	0.05
	スウェーデン	200,440,000	0.05
	イギリス	100,611,000	0.03
	小計		16,011,412,660
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,186,054,323	0.30
合計(純資産総額)		398,632,142,075	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。

## （参考）国内株式インデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	212,820,432,890	98.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,819,947,650	1.31
合計(純資産総額)		215,640,380,540	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	2,814,280,000	1.31

(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。

(参考) 外国債券インデックス マザーファンド

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	108,879,137,170	42.80
	フランス	25,674,561,096	10.09
	イタリア	23,040,180,367	9.06
	ドイツ	17,640,271,188	6.93
	イギリス	17,260,478,567	6.79
	スペイン	14,904,947,941	5.86
	ベルギー	6,387,324,708	2.51
	オランダ	5,440,357,239	2.14
	オーストラリア	5,309,263,850	2.09
	カナダ	5,102,210,841	2.01
	オーストリア	3,806,788,580	1.50
	メキシコ	2,136,719,333	0.84
	アイルランド	2,001,897,853	0.79
	フィンランド	1,604,744,303	0.63
	ポーランド	1,601,318,525	0.63
	デンマーク	1,533,979,254	0.60
	南アフリカ	1,521,989,383	0.60
	マレーシア	1,200,475,908	0.47
	シンガポール	981,197,307	0.39
	スウェーデン	965,098,700	0.38
ノルウェー	561,252,370	0.22	
スイス	330,697,232	0.13	
	小計	247,884,891,715	97.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,488,051,815	2.55
合計(純資産総額)		254,372,943,530	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	1,262,059,694	0.50
	買建	ドイツ	1,681,004,456	0.66

(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		4,112,035,300	1.62

(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) 外国株式インデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	208,656,953,656	59.78
	イギリス	22,154,007,008	6.35
	フランス	12,995,493,758	3.72
	カナダ	12,757,108,944	3.65
	ドイツ	12,748,858,531	3.65
	スイス	11,714,601,872	3.36
	オーストラリア	8,152,509,967	2.34
	オランダ	6,523,166,521	1.87
	アイルランド	4,807,308,550	1.38
	スペイン	4,031,086,783	1.15
	スウェーデン	3,431,859,152	0.98

	香港	3,146,885,744	0.90
	イタリア	2,601,079,837	0.75
	デンマーク	2,237,974,825	0.64
	シンガポール	1,577,367,428	0.45
	バミューダ	1,573,835,478	0.45
	ジャージー	1,528,493,073	0.44
	ベルギー	1,420,503,942	0.41
	フィンランド	1,384,350,847	0.40
	ノルウェー	956,424,077	0.27
	ケイマン	852,643,113	0.24
	キュラソー	843,118,541	0.24
	イスラエル	706,908,785	0.20
	ルクセンブルク	475,332,213	0.14
	オーストリア	309,496,652	0.09
	ニュージーランド	291,560,983	0.08
	パナマ	229,008,077	0.07
	ポルトガル	212,225,659	0.06
	リベリア	171,138,739	0.05
	パプアニューギニア	86,517,776	0.02
	英ヴァージン諸島	84,818,855	0.02
	マン島	71,453,660	0.02
	モーリシャス	9,740,682	0.00
	小計	328,743,833,728	94.18
投資信託受益証券	オーストラリア	196,110,738	0.06
	香港	64,251,311	0.02
	小計	260,362,049	0.07
投資証券	アメリカ	5,935,290,584	1.70
	オーストラリア	570,479,535	0.16
	フランス	476,436,081	0.14
	イギリス	280,635,059	0.08
	香港	197,339,607	0.06
	シンガポール	140,504,488	0.04
	カナダ	63,299,550	0.02
	小計	7,663,984,904	2.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,386,842,697	3.55
合計(純資産総額)		349,055,023,378	100.00



(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、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	7,997,409,062	2.29
	買建	カナダ	546,157,735	0.16
	買建	ドイツ	2,137,497,378	0.61
	買建	イギリス	991,022,716	0.28
	買建	オーストラリア	575,819,392	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		159,756,800	0.05
	売建		78,762,000	0.02

(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）J - R E I Tインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	102,137,145,200	97.52
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,600,841,202	2.48
合計（純資産総額）		104,737,986,402	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	2,557,890,000	2.44

(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。

#### (参考) グローバルREITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	46,330,333,237	70.80
	オーストラリア	4,454,706,980	6.81
	イギリス	3,600,600,703	5.50
	フランス	3,292,789,341	5.03
	シンガポール	2,356,318,388	3.60
	香港	1,421,649,103	2.17
	カナダ	1,190,324,802	1.82
	スペイン	536,940,069	0.82
	ベルギー	527,810,741	0.81
	ニュージーランド	289,841,438	0.44
	オランダ	288,333,457	0.44
	ドイツ	177,870,273	0.27
	アイルランド	171,458,037	0.26
	イタリア	71,746,435	0.11
	ガーンジー	46,036,583	0.07
	マン島	39,477,911	0.06
	イスラエル	35,720,876	0.05
	小計	64,831,958,374	99.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		608,692,466	0.93
合計(純資産総額)		65,440,650,840	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		198,763,100	0.30
	売建		87,053,100	0.13

(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。

## （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	3,107,991	2.4818	7,713,705	2.5499	7,925,066	20.46
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	2,808,882	2.7457	7,712,517	2.7116	7,616,564	19.66
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	4,823,809	1.6120	7,776,336	1.5776	7,610,041	19.65
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	5,059,208	1.3873	7,019,129	1.3917	7,040,899	18.18
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	2,467,212	1.5652	3,861,882	1.6558	4,085,209	10.55
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	2,271,932	1.6979	3,857,675	1.7622	4,003,598	10.34

(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	98.83
合計	98.83

(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。

## (参考)国内債券インデックス マザーファンド

## 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135回利付国債(5年)	8,660,000,000	101.04	8,750,568,800	100.95	8,742,616,400	0.100	2023/3/20	2.19
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.84	5,586,591,400	100.76	5,582,381,000	0.100	2022/3/20	1.40
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	4,920,000,000	100.66	4,952,847,100	100.57	4,948,290,000	0.100	2028/3/20	1.24
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.65	4,811,342,700	100.58	4,807,771,800	0.100	2021/3/20	1.21
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.95	4,785,172,200	100.85	4,780,337,400	0.100	2022/9/20	1.20
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	103.15	3,930,319,800	1.200	2020/12/20	0.99
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	103.26	3,861,924,000	103.07	3,854,930,200	0.400	2025/6/20	0.97
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.89	3,642,381,700	100.79	3,638,843,900	0.100	2022/6/20	0.91
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.55	3,630,071,600	100.47	3,627,003,100	0.100	2020/9/20	0.91
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.85	3,562,192,200	103.65	3,555,195,000	0.600	2023/12/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	100.37	3,533,164,800	100.31	3,530,982,400	0.100	2019/12/20	0.89
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	100.88	3,429,920,000	100.81	3,427,846,000	0.100	2027/3/20	0.86

日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	3,210,000,000	100.76	3,234,492,300	100.65	3,231,025,500	0.100	2027/12/20	0.81
日本	国債証券	第129回利付国債（5年）	3,200,000,000	100.76	3,224,448,000	100.67	3,221,632,000	0.100	2021/9/20	0.81
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	3,130,000,000	102.65	3,213,009,500	102.48	3,207,624,000	0.300	2025/12/20	0.80
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	100.90	3,198,625,100	0.100	2022/12/20	0.80
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	3,150,000,000	101.05	3,183,075,000	100.94	3,179,830,500	0.100	2026/6/20	0.80
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	3,060,000,000	104.08	3,185,081,200	103.80	3,176,463,600	1.200	2021/6/20	0.80
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	3,070,000,000	103.33	3,172,507,300	103.18	3,167,810,200	0.400	2025/9/20	0.79
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	3,140,000,000	100.42	3,153,345,000	100.35	3,151,272,600	0.100	2020/3/20	0.79
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	2,920,000,000	104.04	3,037,968,000	103.75	3,029,646,000	1.000	2021/12/20	0.76
日本	国債証券	第386回利付国債（2年）	2,990,000,000	100.44	3,003,283,500	100.36	3,000,913,500	0.100	2020/3/15	0.75
日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	100.61	2,978,233,600	100.52	2,975,569,600	0.100	2020/12/20	0.75
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	104.13	2,905,478,100	103.92	2,899,591,200	0.600	2024/6/20	0.73
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	2,800,000,000	100.45	2,812,656,000	100.37	2,810,360,000	0.200	2019/9/20	0.71
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,710,000,000	103.64	2,808,779,500	103.44	2,803,467,900	0.500	2024/9/20	0.70
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,750,000,000	101.08	2,779,868,800	100.99	2,777,335,000	0.100	2026/3/20	0.70
日本	国債証券	第381回利付国債（2年）	2,580,000,000	100.34	2,588,901,000	100.27	2,586,991,800	0.100	2019/10/15	0.65
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	2,450,000,000	103.17	2,527,861,000	103.02	2,524,210,500	0.400	2025/3/20	0.63
日本	国債証券	第309回利付国債（10年）	2,450,000,000	102.55	2,512,671,000	102.30	2,506,448,000	1.100	2020/6/20	0.63

(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	83.04
地方債証券	5.60
特殊債券	7.05
社債券	4.02
合計	99.70

(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。

(参考) 国内株式インデックス マザーファンド

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	1,034,000	6,988.79	7,226,408,860	7,305.00	7,553,370,000	3.50
日本	株式	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ	銀行業	5,873,200	681.75	4,004,054,100	689.40	4,048,984,080	1.88
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通 信業	377,900	7,718.99	2,917,006,321	9,260.00	3,499,354,000	1.62
日本	株式	ソニー	電気機器	569,800	5,180.14	2,951,644,210	5,828.00	3,320,794,400	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	599,000	5,125.90	3,070,414,100	5,168.00	3,095,632,000	1.44
日本	株式	三井住友フィナンシャルグ ループ	銀行業	635,000	4,542.01	2,884,176,350	4,445.00	2,822,575,000	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	765,400	3,523.05	2,696,542,470	3,355.00	2,567,917,000	1.19
日本	株式	キーエンス	電気機器	41,700	66,239.59	2,762,190,903	58,910.00	2,456,547,000	1.14
日本	株式	K D D I	情報・通 信業	735,600	2,947.69	2,168,320,764	3,113.00	2,289,922,800	1.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグ ループ	銀行業	11,399,600	193.10	2,201,262,760	194.60	2,218,362,160	1.03
日本	株式	任天堂	その他製 品	52,400	42,098.63	2,205,968,212	36,760.00	1,926,224,000	0.89
日本	株式	リクルートホールディング ス	サービ ス業	627,100	2,982.97	1,870,620,487	3,055.00	1,915,790,500	0.89
日本	株式	三菱商事	卸売業	587,900	3,034.46	1,783,959,034	3,117.00	1,832,484,300	0.85
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	76,200	22,602.84	1,722,336,408	23,245.00	1,771,269,000	0.82

日本	株式	ファナック	電気機器	80,800	23,637.77	1,909,931,816	21,920.00	1,771,136,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	89,300	16,242.44	1,450,449,892	19,500.00	1,741,350,000	0.81
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	599,400	2,815.03	1,687,328,982	2,873.00	1,722,076,200	0.80
日本	株式	花王	化学	209,200	8,432.73	1,764,127,116	8,137.00	1,702,260,400	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	316,100	5,276.77	1,667,986,997	5,301.00	1,675,646,100	0.78
日本	株式	日本電産	電気機器	102,400	17,108.43	1,751,903,232	16,180.00	1,656,832,000	0.77
日本	株式	キヤノン	電気機器	457,900	3,751.98	1,718,031,642	3,617.00	1,656,224,300	0.77
日本	株式	信越化学工業	化学	146,800	11,002.33	1,615,142,044	11,270.00	1,654,436,000	0.77
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	351,200	4,888.07	1,716,690,184	4,555.00	1,599,716,000	0.74
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	152,800	10,743.36	1,641,585,408	10,440.00	1,595,232,000	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,042,000	812.36	1,658,839,120	778.60	1,589,901,200	0.74
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	493,000	2,940.89	1,449,858,770	3,176.00	1,565,768,000	0.73
日本	株式	ダイキン工業	機械	116,100	12,700.32	1,474,507,152	13,320.00	1,546,452,000	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	836,500	1,678.76	1,404,282,740	1,817.50	1,520,338,750	0.71
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	313,400	4,473.49	1,401,991,766	4,675.00	1,465,145,000	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	971,800	1,511.40	1,468,778,520	1,438.00	1,397,448,400	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別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	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.14
		食料品	4.17
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.40
		医薬品	4.73
		石油・石炭製品	0.82
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	1.01



鉄鋼	1.04
非鉄金属	0.84
金属製品	0.64
機械	5.10
電気機器	13.39
輸送用機器	8.57
精密機器	1.73
その他製品	2.02
電気・ガス業	1.72
陸運業	4.25
海運業	0.19
空運業	0.58
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.66
卸売業	4.69
小売業	4.76
銀行業	6.84
証券、商品先物取引業	0.90
保険業	2.25
その他金融業	1.19
不動産業	2.36
サービス業	4.48
小計	98.69
合計	98.69

(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。

(参考) 外国債券インデックス マザーファンド

#### 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 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,579.38	1,851,391,888	10,559.39	1,847,893,480	1.750	2023/5/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/24	15,750,000	10,755.42	1,693,979,574	10,665.59	1,679,831,251	2.125	2024/2/29	0.66

アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	9,883.35	1,630,754,392	9,845.21	1,624,460,882	2.500	2046/2/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,704.62	1,568,227,371	10,680.24	1,564,655,764	1.875	2022/10/31	0.62
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	14,003.01	1,540,331,194	13,905.36	1,529,590,531	3.500	2020/4/25	0.60
アメリカ	国債証券	T 1.875% 12/15/20	12,500,000	10,913.81	1,364,226,840	10,887.30	1,360,913,621	1.875	2020/12/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,800.38	1,350,048,337	10,772.71	1,346,589,501	2.375	2024/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	9,947.66	1,313,091,507	9,945.23	1,312,770,848	1.500	2026/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,456.74	1,286,180,048	10,440.61	1,284,195,924	2.000	2025/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	12,150,000	10,481.67	1,273,523,765	10,464.95	1,271,492,260	2.250	2027/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,950,000	10,610.83	1,267,995,089	10,594.12	1,265,998,509	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,584.54	1,270,145,971	10,549.08	1,265,890,310	2.125	2025/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/19	11,500,000	10,975.00	1,262,125,675	10,984.28	1,263,193,334	1.250	2019/6/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,402.09	1,265,632,284	11,340.76	1,258,824,391	3.625	2021/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,118.77	1,223,065,766	11,078.16	1,218,598,567	2.625	2020/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,705.15	1,198,977,085	10,684.78	1,196,696,055	1.750	2022/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,665.36	1,162,525,270	10,621.76	1,157,772,512	2.875	2045/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	10,400,000	10,989.74	1,142,933,806	10,889.33	1,132,490,909	2.750	2028/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,577.43	1,110,630,732	10,558.41	1,108,633,409	2.000	2024/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,347.90	1,112,400,469	9,314.70	1,108,449,618	2.250	2046/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 06/30/19	10,000,000	11,018.71	1,101,871,273	11,021.35	1,102,135,532	1.625	2019/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	10,859.68	1,085,968,024	10,843.74	1,084,374,187	1.500	2020/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,698.50	1,085,898,082	10,674.02	1,083,413,054	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,656.48	1,081,633,180	10,634.86	1,079,439,080	1.750	2022/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,588.17	1,058,817,521	10,575.16	1,057,516,717	1.250	2021/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	9,620,000	10,886.90	1,047,319,812	10,883.49	1,046,991,865	1.250	2020/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,606.64	1,039,451,682	10,594.55	1,038,266,070	1.125	2021/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,715.47	1,023,328,248	10,695.62	1,021,432,421	1.750	2022/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,696.84	1,021,548,644	10,674.41	1,019,406,938	1.750	2022/5/31	0.40
フランス	国債証券	FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000	14,405.92	1,022,820,589	14,339.07	1,018,074,311	2.250	2022/10/25	0.40

(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	97.45
合計	97.45

(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。

(参考) 外国株式インデックス マザーファンド

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	410,252	20,933.91	8,588,181,533	21,081.90	8,648,895,372	2.48
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	591,521	10,919.57	6,459,158,204	11,697.12	6,919,094,308	1.98
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	33,277	178,782.11	5,949,332,394	197,511.21	6,572,580,608	1.88
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェ ア・サービ ス	193,825	20,541.61	3,981,478,940	18,989.37	3,680,614,757	1.05
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,972	12,284.36	3,402,425,586	12,958.19	3,589,057,823	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェ ア・サービ ス	25,480	119,424.06	3,042,925,226	135,403.33	3,450,077,037	0.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェ ア・サービ ス	24,157	120,368.69	2,907,746,511	136,546.74	3,298,559,608	0.94
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	217,581	13,481.81	2,933,387,244	14,672.19	3,192,390,142	0.91
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	342,921	8,741.36	2,997,597,674	9,073.95	3,111,650,546	0.89
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	787,725	3,348.06	2,637,351,824	3,475.72	2,737,913,979	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	378,753	6,093.12	2,307,788,442	6,492.97	2,459,233,722	0.70
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	252,246	8,625.45	2,175,736,395	9,112.39	2,298,565,441	0.66
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	103,404	21,547.17	2,228,064,055	22,100.98	2,285,329,829	0.65

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	78,518	27,187.37	2,134,698,260	28,178.77	2,212,541,322	0.63
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	145,964	14,572.96	2,127,127,868	15,150.64	2,211,448,718	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	154,681	13,568.71	2,098,822,481	14,190.40	2,194,986,546	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	587,152	3,534.23	2,075,131,555	3,552.32	2,085,751,793	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	94,571	20,741.81	1,961,573,867	21,900.05	2,071,109,893	0.59
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	483,121	3,961.18	1,913,730,092	4,283.87	2,069,630,409	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	378,881	6,154.05	2,331,654,362	5,294.06	2,005,821,361	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信 サービス	334,367	5,384.91	1,800,536,721	5,826.91	1,948,328,054	0.56
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	390,187	4,802.29	1,873,792,143	4,681.29	1,826,579,165	0.52
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	202,806	8,249.15	1,672,977,744	8,903.00	1,805,582,224	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,238	39,973.59	1,808,325,306	38,971.17	1,762,977,816	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,634,371	1,067.37	1,744,490,644	1,057.41	1,728,213,346	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	328,376	4,707.78	1,545,922,391	5,131.99	1,685,223,104	0.48
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	180,510	8,510.14	1,536,165,600	9,332.62	1,684,631,525	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	208,262	7,597.52	1,582,275,626	8,024.91	1,671,284,410	0.48
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェ ア・サービ ス	75,127	21,221.78	1,594,328,794	21,965.54	1,650,205,777	0.47
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	218,364	6,559.58	1,432,376,324	7,194.55	1,571,032,485	0.45

(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	6.95
		素材	4.58
		資本財	6.97
		商業・専門サービス	1.06
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.30
		耐久消費財・アパレル	1.78
		消費者サービス	1.73
		メディア	1.93
		小売	4.66
		食品・生活必需品小売り	1.46
		食品・飲料・タバコ	4.67
		家庭用品・パーソナル用品	1.80
		ヘルスケア機器・サービス	4.56
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.91
		銀行	8.82
		各種金融	4.28
		保険	3.72
		不動産	0.60
		ソフトウェア・サービス	11.18
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.15		
電気通信サービス	2.28		
公益事業	2.89		
半導体・半導体製造装置	2.94		
	小計	94.18	
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.20
合計			96.45

(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。

(参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	11,666	547,799.35	6,390,627,217	622,000	7,256,252,000	6.93
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,047	527,605.56	6,356,064,181	585,000	7,047,495,000	6.73
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,706	140,052.21	5,000,704,210	158,400	5,655,830,400	5.40
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	22,768	200,131.76	4,556,599,911	203,900	4,642,395,200	4.43
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,569	161,427.48	4,288,966,716	173,400	4,607,064,600	4.40
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	24,003	156,034.34	3,745,292,263	174,200	4,181,322,600	3.99
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,082	258,368.97	3,896,720,855	276,000	4,162,632,000	3.97
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,159	232,165.88	3,751,568,454	226,100	3,653,549,900	3.49
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,740	266,578	3,129,625,742	290,900	3,415,166,000	3.26
日本	投資証券	G L P 投資法人	26,633	113,108.17	3,012,410,139	119,400	3,179,980,200	3.04
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,626	364,656.27	2,780,868,715	402,500	3,069,465,000	2.93
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,773	453,275.3	2,616,758,324	499,000	2,880,727,000	2.75
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,881	75,839.15	2,645,345,391	81,900	2,856,753,900	2.73
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,727	606,673.87	2,261,073,513	678,000	2,526,906,000	2.41
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	31,081	65,155.45	2,025,096,689	72,200	2,244,048,200	2.14
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,003	444,495.98	1,779,317,407	529,000	2,117,587,000	2.02
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,780	567,764.86	1,578,386,336	681,000	1,893,180,000	1.81
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,098	440,689.6	1,805,945,980	450,000	1,844,100,000	1.76
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	36,243	47,225.11	1,711,579,867	49,350	1,788,592,050	1.71
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,934	132,503.94	1,713,805,959	138,100	1,786,185,400	1.71
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,044	206,308.46	1,659,545,252	216,000	1,737,504,000	1.66
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,035	117,007.3	1,642,197,455	120,600	1,692,621,000	1.62
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,787	132,326.45	1,427,405,416	143,700	1,550,091,900	1.48
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,688	159,683.15	1,387,327,231	172,900	1,502,155,200	1.43

日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,365	114,531.89	1,416,186,928	119,500	1,477,617,500	1.41
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,610	159,636.95	1,374,474,139	162,100	1,395,681,000	1.33
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,889	325,971.95	1,267,704,921	346,500	1,347,538,500	1.29
日本	投資証券	プレミアム投資法人	11,453	101,442.12	1,161,816,691	112,800	1,291,898,400	1.23
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	13,550	79,465.66	1,076,759,693	91,000	1,233,050,000	1.18
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	8,077	134,013.15	1,082,424,212	152,500	1,231,742,500	1.18

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.52
合計	97.52

(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。

## (参考)グローバルREITインデックス マザーファンド

### イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	159,650	17,855.13	2,850,571,582	19,078.17	3,045,831,213	4.65
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	275,330	7,333.14	2,019,036,022	7,215.64	1,986,684,914	3.04
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	77,370	23,295.53	1,802,375,206	23,811.64	1,842,306,974	2.82
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	69,650	26,114.58	1,818,880,749	24,608.74	1,713,998,880	2.62
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	105,770	13,337.85	1,410,744,553	13,404.45	1,417,789,470	2.17
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	70,980	20,501.32	1,455,184,176	19,112.59	1,356,611,759	2.07
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	189,110	7,636.37	1,444,115,425	7,079.10	1,338,730,057	2.05
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	191,040	7,397.70	1,413,257,831	6,849.31	1,308,493,520	2.00
香港	投資証券	LINK REIT	1,103,500	976.50	1,077,577,019	1,099.38	1,213,171,347	1.85
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	182,910	7,009.17	1,282,047,541	6,152.17	1,125,294,183	1.72
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	79,210	13,927.31	1,103,182,589	13,550.99	1,073,373,973	1.64
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,731,080	337.88	922,785,777	349.39	954,218,869	1.46



アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	145,780	6,181.03	901,071,545	6,146.62	896,054,803	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	33,860	28,228.73	955,824,896	25,954.13	878,807,113	1.34
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	380,060	2,222.42	844,653,021	2,296.79	872,920,630	1.33
アメリカ	投資証券	GGP INC	323,930	2,431.11	787,512,377	2,348.97	760,902,370	1.16
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,740	13,969.49	736,751,346	13,634.24	719,070,250	1.10
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	88,610	8,268.02	732,629,678	7,777.36	689,151,923	1.05
アメリカ	投資証券	HCP INC	240,480	2,943.98	707,969,561	2,828.53	680,206,049	1.04
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	64,560	9,545.74	616,273,614	10,380.54	670,167,992	1.02
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	820,120	715.22	586,571,967	798.25	654,668,253	1.00
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	58,220	11,548.37	672,346,119	10,951.13	637,575,167	0.97
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	182,550	3,177.10	579,980,737	3,171.55	578,967,493	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	136,780	4,373.79	598,247,543	4,112.92	562,565,266	0.86
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	143,850	4,407.09	633,960,904	3,875.35	557,470,407	0.85
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	75,270	7,267.82	547,049,165	6,960.32	523,903,813	0.80
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	383,850	1,384.05	531,269,511	1,357.39	521,035,583	0.80
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,390	14,414.64	538,963,708	13,592.06	508,207,288	0.78
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	45,150	10,951.13	494,443,813	11,159.83	503,866,564	0.77
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	515,430	811.49	418,267,992	970.58	500,269,544	0.76

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.07
合計	99.07

(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。

#### (参考)国内債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

#### (参考)国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）国内債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内株式インデックス マザーファンド

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	161	円	2,788,796,260	2,814,280,000	1.31

(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。

（参考）外国債券インデックス マザーファンド

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	47	アメリカ ドル	5,326,000.58	591,239,324	5,316,507.93	590,185,545	0.23
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	28	アメリカ ドル	3,352,830.86	372,197,754	3,342,500	371,050,925	0.15
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	19	アメリカ ドル	2,730,294.75	303,090,020	2,709,875	300,823,224	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	23	ユーロ	2,576,367	334,747,364	2,574,160	334,460,609	0.13
	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	3,431,694	445,880,001	3,422,120	444,636,051	0.17
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	43	ユーロ	6,975,392	906,312,683	6,941,490	901,907,796	0.35

(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	17,270,000.00	1,916,039,169	1,915,070,300	0.75
	カナダドル	買建	2,080,000.00	176,068,100	177,008,000	0.07
	ユーロ	買建	13,260,000.00	1,721,913,756	1,722,871,800	0.68
	イギリスポンド	買建	2,040,000.00	298,223,851	297,085,200	0.12

(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) 外国株式インデックス マザーファンド

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	514	アメリカドル	71,155,003	7,898,916,883	72,042,240	7,997,409,062	2.29
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	33	カナダドル	6,331,640.5	539,265,821	6,412,560	546,157,735	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	58	スイスフラン	4,977,426	559,263,585	5,304,680	596,033,844	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	338	ユーロ	11,628,611	1,510,905,427	11,863,800	1,541,463,534	0.44
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	45	オーストラリアドル	6,805,840	559,508,106	7,004,250	575,819,392	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	89	イギリスポンド	6,755,853.75	984,260,333	6,802,270	991,022,716	0.28

(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	760,000.00	84,428,400	84,360,000	0.02
	カナダドル	買建	350,000.00	29,774,850	29,806,000	0.01
	ユーロ	買建	110,000.00	14,248,410	14,292,300	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	800,000.00	10,063,200	10,144,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	180,000.00	14,795,280	14,796,000	0.00
	香港ドル	買建	450,000.00	6,369,750	6,358,500	0.00
	アメリカドル	売建	400,000.00	44,396,000	44,396,000	0.01
	ユーロ	売建	80,000.00	10,393,040	10,394,400	0.00
	イギリスポンド	売建	70,000.00	10,198,020	10,197,600	0.00
	スイスフラン	売建	50,000.00	5,617,345	5,618,000	0.00

	シンガポールドル	売建	100,000.00	8,154,400	8,156,000	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。

### (参考) J - R E I T インデックス マザーファンド

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証 R E I T 指数先物	買建	1,455	円	2,487,609,450	2,557,890,000	2.44

(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。

### (参考) グローバル R E I T インデックス マザーファンド

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	1,220,000.00	135,479,800	135,415,000	0.21
	イギリスポンド	買建	90,000.00	13,111,740	13,111,200	0.02
	オーストラリアドル	買建	350,000.00	28,770,000	28,766,500	0.04
	香港ドル	買建	1,000,000.00	14,142,000	14,130,000	0.02
	シンガポールドル	買建	90,000.00	7,338,960	7,340,400	0.01
	ユーロ	売建	670,000.00	87,041,710	87,053,100	0.13

(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。

### (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）
2017年12月末日	7,511,421		10,022	
2018年 1月末日	20,168,184		9,984	
2月末日	22,738,351		9,684	
3月末日	25,853,199		9,585	
4月末日	28,753,091		9,810	
5月末日	32,524,968		9,780	
6月末日	35,654,255		9,866	
7月末日	38,734,879		9,986	

## 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	2017年12月19日～2018年 6月18日	0.8

(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	2017年12月19日～2018年 6月18日	35,684,543	817,649	34,866,894

(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12月19日  
作成基準日：2018年7月31日

**基準価額・純資産の推移**

基準価額	9,986円
純資産総額	0.39億円

※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

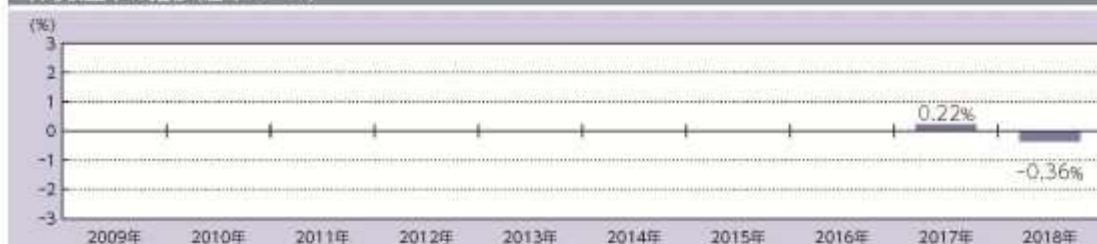
決算期	-	-	-	-	-
分配金	-	-	-	-	-

※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われない場合があります。

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位紹介銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期間	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	20.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
外国債券 インデックス マザーファンド	19.7%	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.1%
		T 2.125% 02/29/24	アメリカ	国債	-	2.125%	2024/02/29	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	19.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
国内債券 インデックス マザーファンド	18.2%	第135回利付国債（5年）	日本	国債	-	0.1%	2023/03/20	0.4%
		第131回利付国債（5年）	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.3%
J-REIT インデックス マザーファンド	10.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
グローバル 能研インデックス マザーファンド	10.3%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
		PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.3%

※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 財務諸表

(1)当ファンドは、2017年12月19日から運用を開始していますが、2018年10月1日現在、記載すべき財務諸表及び中間財務諸表はありません。

当ファンドの会計監査は、有限責任監査法人トーマツが行います。

(2)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づいて作成され、監査証明を受けた当ファンドの財務諸表は有価証券報告書に記載されます。

(3)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）」に基づいて作成され、監査証明を受けた当ファンドの中間財務諸表は半期報告書に記載されます。

(4)法令の定めるところにより、当ファンドの有価証券報告書の提出は、計算期間の終了毎に行われ、半期報告書の提出は、計算期間開始6ヶ月経過毎に行われます。

#### 2 ファンドの現況

##### 純資産額計算書

（2018年 7月31日現在）

資産総額	39,058,641円
負債総額	323,762円
純資産総額（ - ）	38,734,879円
発行済口数	38,789,866口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9986円
（1万口当たり純資産額）	（9,986円）

##### （参考）国内債券インデックス マザーファンド

（2018年 7月31日現在）

資産総額	403,339,441,024円
負債総額	4,707,298,949円



純資産総額（ - ）	398,632,142,075円
発行済口数	286,437,263,302口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3917円
（1万口当たり純資産額）	（13,917円）

（参考）国内株式インデックス マザーファンド

（2018年 7月31日現在）

資産総額	216,272,899,897円
負債総額	632,519,357円
純資産総額（ - ）	215,640,380,540円
発行済口数	136,688,724,992口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5776円
（1万口当たり純資産額）	（15,776円）

（参考）外国債券インデックス マザーファンド

（2018年 7月31日現在）

資産総額	254,533,238,872円
負債総額	160,295,342円
純資産総額（ - ）	254,372,943,530円
発行済口数	93,809,909,942口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7116円
（1万口当たり純資産額）	（27,116円）

（参考）外国株式インデックス マザーファンド

（2018年 7月31日現在）

資産総額	349,388,517,241円
負債総額	333,493,863円
純資産総額（ - ）	349,055,023,378円

発行済口数	136,890,118,975口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5499円
（1万口当たり純資産額）	（25,499円）

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

（2018年 7月31日現在）

資産総額	106,721,254,669円
負債総額	1,983,268,267円
純資産総額（ - ）	104,737,986,402円
発行済口数	63,254,857,515口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6558円
（1万口当たり純資産額）	（16,558円）

（参考）グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

（2018年 7月31日現在）

資産総額	65,846,628,661円
負債総額	405,977,821円
純資産総額（ - ）	65,440,650,840円
発行済口数	37,136,242,582口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7622円
（1万口当たり純資産額）	（17,622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

< 更新・訂正後 >

##### (1) 資本金の額（平成30年10月1日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：平成30年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

##### (2) 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

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

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

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

###### 投資運用の意思決定機構

[ PLAN（計画） ]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[ DO（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

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

委託会社の機構は平成30年10月 1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9月29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	488	9,143,727
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	64	238,626
単位型公社債投資信託	0	0
合計	552	9,382,354

### < 訂正後 >

（前略）

平成30年7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	502	9,773,110
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	65	222,303
単体型公社債投資信託	0	0
合計	567	9,995,414

### 3 委託会社等の経理状況

<更新・訂正後>

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1) 貸借対照表

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日現在）		当事業年度 （平成30年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		20,260,630		23,973,152
前払費用		143,622		157,614
未収委託者報酬		5,252,944		5,373,307
繰延税金資産		61,677		94,211
その他		5,474		9,842
流動資産合計		25,724,348		29,608,128
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	47,993	1	36,782
器具備品	1	73,765	1	79,655
その他	1	2,830	1	1,912
有形固定資産合計		124,589		118,350
無形固定資産				
ソフトウェア		221,499		210,679
その他		6,656		4,377
無形固定資産合計		228,156		215,056
投資その他の資産				
投資有価証券		71,153		42,802
長期前払費用		9,828		7,810

長期貸付金	19,838	17,088
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	137,359	154,422
その他	145	70
貸倒引当金	19,838	17,088
投資その他の資産合計	243,485	230,105
固定資産合計	596,231	563,512
資産合計	26,320,580	30,171,641

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	13,630	24,591
未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863
その他未払金	784,201	789,595
未払費用	67,780	74,279
未払法人税等	863,230	838,596
未払消費税等	91,120	72,890
賞与引当金	98,072	106,177
その他	3,100	1,241
流動負債合計	4,020,860	4,068,279
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	13,148	13,374
退職給付引当金	437,197	496,696
その他	2,065	1,074
固定負債合計	452,411	511,145
負債合計	4,473,271	4,579,425
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	71,500	74,500
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	19,026,944	22,767,534
利益剰余金合計	21,198,444	24,942,034

株主資本合計	21,848,444	25,592,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,134	182
評価・換算差額等合計	1,134	182
純資産合計	21,847,309	25,592,216
負債・純資産合計	26,320,580	30,171,641

## ( 2 ) 損益計算書

( 単位：千円 )

	前事業年度 ( 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日 )	当事業年度 ( 自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178
営業収益合計	30,245,448	29,206,178
営業費用		
支払手数料	12,880,325	12,544,178
広告宣伝費	95,688	175,296
公告費	3,094	-
調査費	6,239,223	6,008,380
調査費	360,520	396,842
委託調査費	5,876,937	5,609,496
図書費	1,766	2,041
営業雑経費	1,460,885	1,474,361
通信費	24,920	33,158
印刷費	370,785	368,414
協会費	30,665	36,616
諸会費	105	105
情報機器関連費	943,725	942,093
その他営業雑経費	90,684	93,973
営業費用合計	20,679,217	20,202,216
一般管理費		
給料	1,874,710	2,006,157
役員報酬	89,520	84,130
給料・手当	1,526,244	1,649,268
賞与	258,946	272,758
退職給付費用	76,106	84,944
福利費	221,018	239,702
交際費	5,612	5,831
旅費交通費	61,961	73,807
租税公課	106,691	102,158
不動産賃借料	113,697	124,629
減価償却費	134,710	119,300

業務委託費	1	486,690	1	484,841
諸経費		223,685		246,326
一般管理費合計		3,304,885		3,487,699
営業利益		6,261,346		5,516,262

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		4,669		2,136
収益分配金		129		116
投資有価証券売却益		307		499
貸倒引当金戻入		3,000		2,750
その他		1,591		4,351
営業外収益合計		9,697		9,854
営業外費用				
長期前払費用償却	1	4,644	1	-
投資有価証券売却損		604		2,224
固定資産除却損		-		7,891
その他		0		1,182
営業外費用合計		5,249		11,298
経常利益		6,265,794		5,514,818
特別損失				
統合関連費用		-		51,569
特別損失合計		-		51,569
税引前当期純利益		6,265,794		5,463,248
法人税、住民税及び事業税		1,889,846		1,739,837
法人税等調整額		45,558		50,178
法人税等合計		1,935,405		1,689,659
当期純利益		4,330,389		3,773,589

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					

剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
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	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	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
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

## 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。

## 未適用の会計基準等

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）
- ・「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30年2月16日）

## (1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異が見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

## (2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 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29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
		千円		千円
建物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	〃	325,834	〃
その他	1,759	〃	2,677	〃
計	362,567	〃	392,342	〃

## (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28年4月1日 至平成29年3月31日)		当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	
		千円		千円
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	〃	-	〃

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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

## 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30年6月29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30年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成30年3月31日	平成30年6月29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。

当事業年度（平成30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	23,973,152	23,973,152	-
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
(4) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(5) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-

（\*）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29年3月31日	平成30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、「(3)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

当事業年度（平成30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	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

（有価証券関係）

#### 1. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成30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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

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

## 2. 事業年度中に売却した其他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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
62,968	499	2,224

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
（1）退職給付債務	437,197	496,696
（2）退職給付引当金	437,197	496,696

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
（1）退職給付費用	76,106	84,944

（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14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

### 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29年3月31日）		当事業年度 （平成30年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	28,688	千円	42,041	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,074	"	5,232	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,265	"	32,511	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	133,869	"	152,088	"

その他	6,972	"	23,674	"
繰延税金資産 合計	205,870	"	255,547	"
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	"
その他	-	"	80	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,913	"
繰延税金資産の純額	199,037	"	248,633	"

## 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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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）	2,945,175千円

（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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

（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）

当事業年度（平成30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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	7,282,436円46銭	8,530,738円79銭
1株当たり当期純利益金額	1,443,463円05銭	1,257,863円25銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 5 その他

### < 訂正前 >

#### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

#### (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成29年12月1日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

### < 訂正後 >

#### (1) 定款の変更

当社は平成30年10月1日付けで監査等委員会の設置等に関し、定款の変更を行いました。

#### (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成30年10月1日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1 名称、資本金の額及び事業の内容

&lt; 訂正前 &gt;

## (1)受託会社

(前略)

資本金の額：342,037百万円（平成29年3月末日現在）

(中略)

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

&lt; 訂正後 &gt;

## (1)受託会社

(前略)

資本金の額：342,037百万円（平成30年3月末日現在）

(中略)

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成30年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 3 資本関係

&lt; 訂正前 &gt;

(前略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成29年3月末日現在）

(後略)

&lt; 訂正後 &gt;

（前略）

(参考)再信託受託会社

（中略）

資本金の額　：51,000百万円（平成30年3月末日現在）

（後略）

## 独立監査人の監査報告書

平成30年 6月 1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30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

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。