

【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】 | DCターゲット・イヤー ファンド2055 |
| 【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30年2月9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。

- ・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

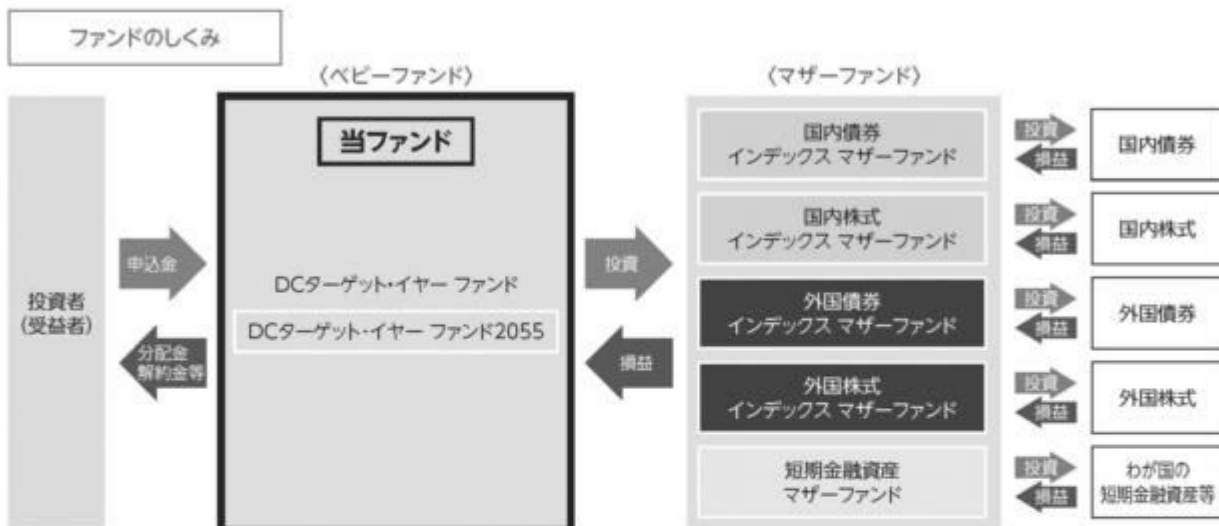
（1）ファンドの目的及び基本的性格

<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. 国内及び外国の主要金融資産に分散投資し、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。

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 |
|------|---------------------------|
| 国内債券 | NOMURA-BPI 総合 |
| 国内株式 | TOPIX(東証株価指数) |
| 外国債券 | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) |
| 外国株式 | MSCI コクサイ・インデックス(円ベース) |

*わが国の短期金融資産等への投資は、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果を目指します。「無担保コール翌日物金利」とは、日本銀行が金融調節を行う上でのターゲット・レートとしている短期金利で、金融機関の間で担保なしにお金を借りて翌営業日に返す翌日物の金利です。

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。

「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。

「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。

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。

「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。

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。

3. 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)に近づくにしたがい、原則として1年に2回、各マザーファンドの基本組入比率を変更します。

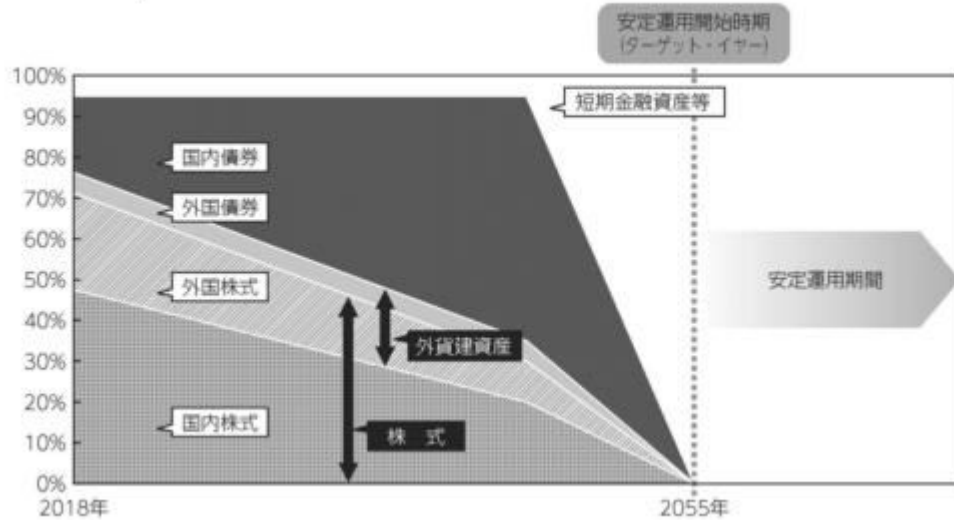
- 株式の実質組入れを徐々に減らし、公社債及び短期金融資産等の実質組入れを徐々に増やすことにより、株価等の変動リスクの低減をはかることを基本とします。
- 原則として1年に2回、各マザーファンドの基本組入比率を変更します。なお、予定された基本組入比率については、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で見直すことがあります。
- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)以降は、「短期金融資産 マザーファンド」に原則として100%投資を行い、より安定的な運用を行うことを基本とします。ただし、低金利状態が続き、基準価額騰落率が継続的にマイナスになることが見込まれる場合には、繰上償還手続きを行うことがあります。
- 将来の市場構造及び市況環境の変化等に応じ、主要投資対象の追加が行われる場合があります。

ファンドの安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)

DCターゲット・イヤー ファンド2055

2055年8月の決算日の翌日(第39計算期間開始日)

基本組入比率イメージ



※上記は当初設定時における基本組入比率のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率の推移

| ■ 当初設定時(2018年2月) | 国内債券 | 国内株式 | 外国債券 | 外国株式 | 短期金融資産等 |
|-------------------------|--------|--------|-------|--------|---------|
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 18.75% | 47.50% | 5.00% | 23.75% | 5.00% |
| ■ 2018年7月末現在 | 国内債券 | 国内株式 | 外国債券 | 外国株式 | 短期金融資産等 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 18.75% | 47.50% | 5.00% | 23.75% | 5.00% |
| ■ 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)以降 | 国内債券 | 国内株式 | 外国債券 | 外国株式 | 短期金融資産等 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 0% | 0% | 0% | 0% | 100% |

分配方針

- 原則として、毎年8月28日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 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等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※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85%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40%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11月30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

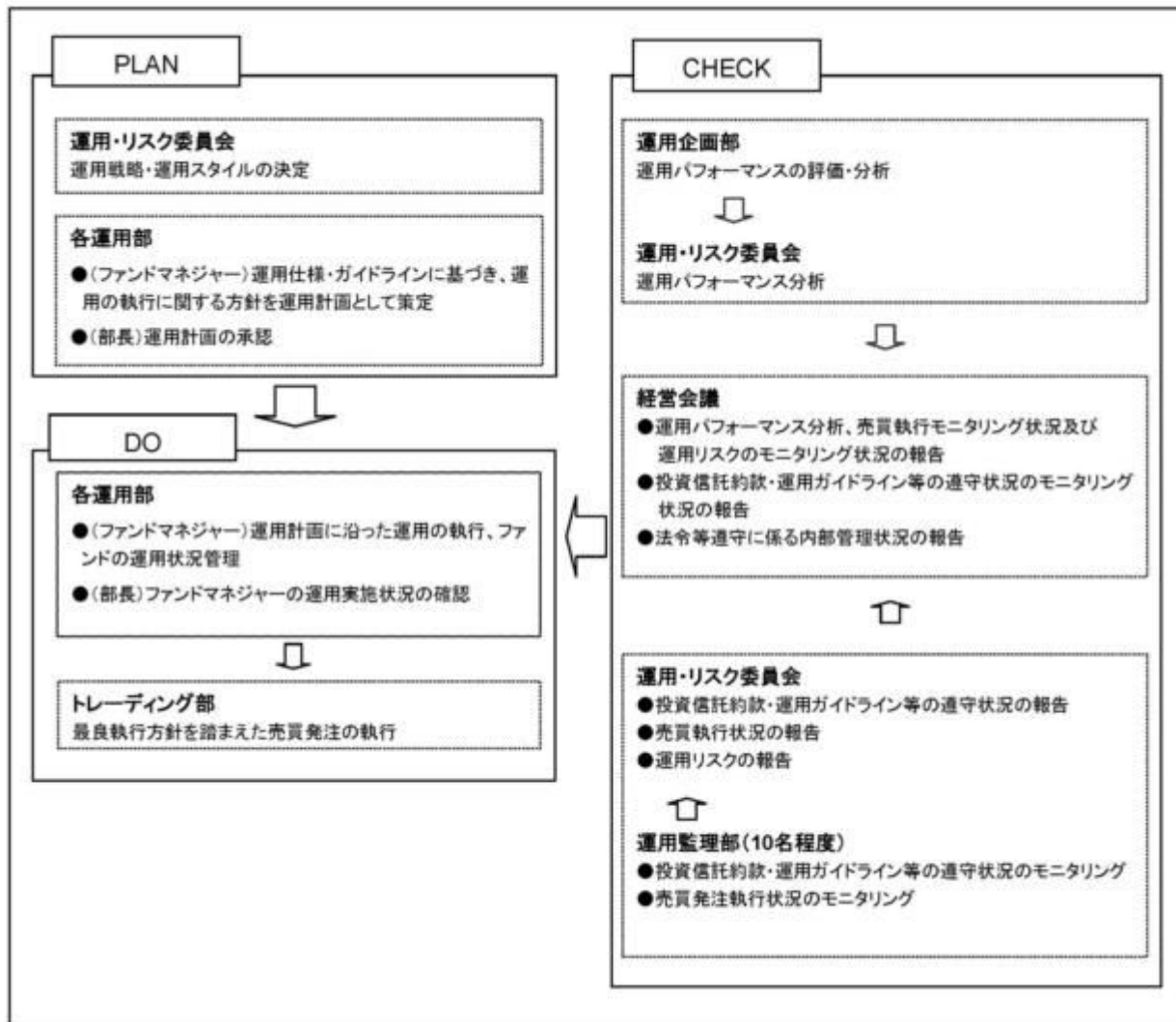
(後略)

2 投資方針

(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>

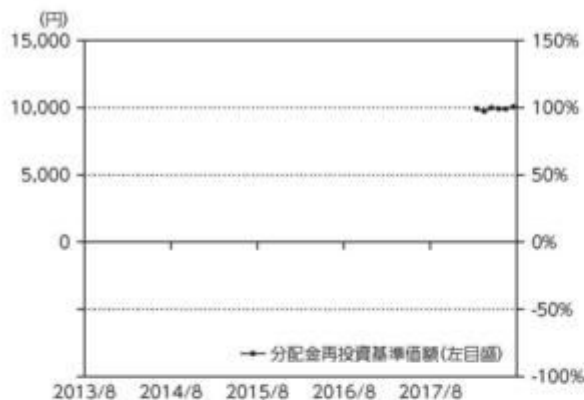
(2) リスクの管理体制

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〕

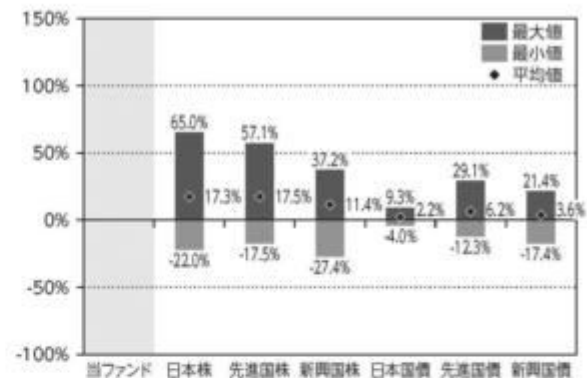
当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移



*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)^{#1}
- 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{#2}
- 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{#3}
- 日本国債… NOMURA-BPI国債^{#4}
- 先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{#5}
- 新興国債… JPモルガン・ガバナメント・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・ディバースファイド(円ベース)^{#6}

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

#1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している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顧客に対しても、責任を負いません。

#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

< 訂正前 >

(前略)

上記は、平成29年11月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

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。

(後略)

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 | 488,791 | 97.20 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 14,065 | 2.80 |
| 合計(純資産総額) | | 502,856 | 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 | 4.02 |
| 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) 短期金融資産 マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 社債券 | 日本 | 301,511,000 | 1.14 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 26,186,607,793 | 98.86 |
| 合計(純資産総額) | | 26,488,118,793 | 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。

(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 | 国内株式インデックス マザーファ ンド | 150,691 | 1.5926 | 240,000 | 1.5776 | 237,730 | 47.28 |
| 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 | 47,770 | 2.4357 | 116,354 | 2.5499 | 121,808 | 24.22 |
| 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 | 67,485 | 1.3891 | 93,750 | 1.3917 | 93,918 | 18.68 |
| 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 | 9,345 | 2.6752 | 25,000 | 2.7116 | 25,339 | 5.04 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 短期金融資産 マザーファンド | 9,860 | 1.0141 | 10,000 | 1.0138 | 9,996 | 1.99 |

(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 | 97.20 |
| 合計 | 97.20 |

(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 | KDDI | 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) 短期金融資産 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 | 社債券 | 第424回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102.11 | 102,115,000 | 100.61 | 100,611,000 | 2.000 | 2018/11/22 | 0.38 |
| 日本 | 社債券 | 第316回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102.18 | 102,183,000 | 100.49 | 100,493,000 | 2.075 | 2018/10/25 | 0.38 |
| 日本 | 社債券 | 第358回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101.78 | 101,789,000 | 100.40 | 100,407,000 | 1.702 | 2018/10/25 | 0.38 |

(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（％） |
|-----|---------|
| 社債券 | 1.14 |
| 合計 | 1.14 |

(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）短期金融資産 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・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・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・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) 短期金融資産 マザーファンド

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) |
| 2018年 2月末日 | 496,277 | | 9,926 | |
| 3月末日 | 486,609 | | 9,732 | |
| 4月末日 | 499,958 | | 9,999 | |
| 5月末日 | 496,015 | | 9,920 | |
| 6月末日 | 495,288 | | 9,906 | |
| 7月末日 | 502,856 | | 10,057 | |

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

該当事項はありません。

（４）設定及び解約の実績

該当事項はありません。

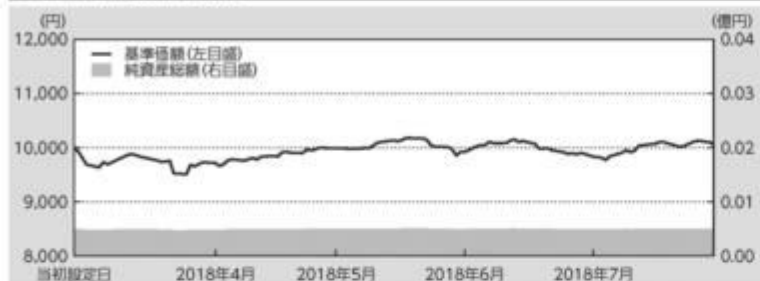
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2018年2月27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 | 10,057円 |
| 純資産総額 | 0.01億円 |

※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

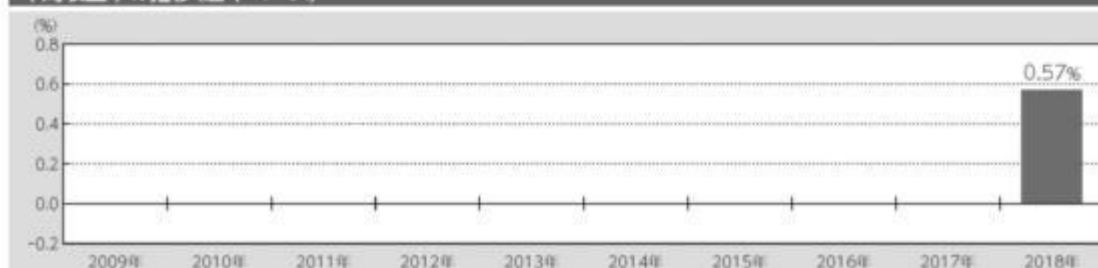
| | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|
| 決算期 | - | - | - | - | - |
| 分配金 | - | - | - | - | - |

※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 | 上位組入銘柄 | 国/地域 | 種類 | 業種 | 利率 | 償還期限 | 実質投資比率 |
|---------------------------|-------|-------------------|------|----|----------------------|--------|------------|--------|
| 国内株式 インデックス マザーファンド | 47.3% | トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | - | - | 1.7% |
| | | 三菱UFJフィナンシャルグループ | 日本 | 株式 | 銀行業 | - | - | 0.9% |
| 外国株式 インデックス マザーファンド | 24.2% | APPLE INC | アメリカ | 株式 | テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア | - | - | 0.6% |
| | | MICROSOFT CORP | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス | - | - | 0.5% |
| 国内債券 インデックス マザーファンド | 18.7% | 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% |
| 外国債券 インデックス マザーファンド | 5.0% | T 1.75% 05/15/23 | アメリカ | 国債 | - | 1.750% | 2023/05/15 | 0.0% |
| | | T 2.125% 02/29/24 | アメリカ | 国債 | - | 2.125% | 2024/02/29 | 0.0% |
| 短期金融資産 マザーファンド | 2.0% | 第316回中国電力株式会社社債 | 日本 | 社債 | - | 2.075% | 2018/10/25 | 0.0% |
| | | 第424回中部電力株式会社社債 | 日本 | 社債 | - | 2.0% | 2018/11/22 | 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）

※2018年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第3【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

- (1)当ファンドは、平成30年 2月27日から運用を開始していますが、平成30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 | 503,790円 |
| 負債総額 | 934円 |
| 純資産総額（ - ） | 502,856円 |
| 発行済口数 | 500,000口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0057円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,057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）短期金融資産 マザーファンド

（2018年 7月31日現在）

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 26,488,318,835円 |
| 負債総額 | 200,042円 |
| 純資産総額（ - ） | 26,488,118,793円 |
| 発行済口数 | 26,127,035,841口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0138円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,138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年間に於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

会社が取締役（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11月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 494 | 9,669,496 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 69 | 244,603 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 合計 | 563 | 9,914,099 |

< 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) |
|----------|-------------------------|-------------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 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 |
| 固定負債 | | |
| 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 |
| 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 | 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 | | 当事業年度 | |
|--------------|-------------------------------|-----------|-------------------------------|-----------|
| | (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) | | (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) | |
|------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 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) | |
|----------|--------------------------------------|----|--------------------------------------|----|
| 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 その他有価証券」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「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)

| 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おります。

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

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

<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

<訂正前>

(1)受託会社

(中略)

資本金の額：342,037百万円（平成29年3月末日現在）

(中略)

(2)販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在） | 事業の内容 |
|----|-----------------------------|-------|
|----|-----------------------------|-------|

(後略)

<訂正後>

(1)受託会社

(中略)

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 |
|----|-----------------------------|-------|
|----|-----------------------------|-------|

(後略)

3 資本関係

<訂正前>

(前略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成29年3月末日現在）

(後略)

<訂正後>

(前略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成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。