

【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】	2019年4月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1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】	03-6453-3610
【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】	コア投資戦略ファンド（積極成長型）
【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 100万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2018年10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、投資対象ファンドの入替及び一部の投資対象ファンドの約款変更に伴う投資制限の追加等、ファンドの概要の更新を行いました。また、消費税率が変更予定であるため、申込手数料、投資対象ファンドの概要及び信託報酬等に注意喚起文言を追加しました。併せて運用状況等のデータ等の更新並びに委託会社等の経理状況等の更新を行ったため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前>及び<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新・訂正後>に記載している内容は、当該内容にて原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」及び「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」は原届出書の更新後の内容です。

第一部【証券情報】

(5) 申込手数料

<訂正前>

(前略)

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

(後略)

<訂正後>

(前略)

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。また、消費税率が10%になった場合は、3.3%（税込）となります。

(後略)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

< 訂正前 >

委託会社の概況（2018年10月1日現在）
(前略)
(後略)

< 訂正後 >

委託会社の概況（2019年 1月31日現在）
(前略)
(後略)

2 投資方針

(2) 投資対象

< 訂正前 >

(参考) 投資対象ファンドの概要
(前略)
(中略)

以下の内容は、2018年7月31日（ ）のファンドに関しては2018年9月28日、（ ）のファンドに関しては2018年10月9日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

(中略)

2.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）

(中略)

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

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0756%（税抜 年0.07%）
------	------------------------------

(中略)

3.FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

(中略)

4.FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.3672%（税抜 年0.34%）
------	------------------------------

(中略)

6.国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）（ 〃 ）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.5076%（税抜 年0.47%）
------	------------------------------

(中略)

8.FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

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

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

(中略)

9.FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

(中略)

14.Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

(中略)

信託報酬	<p>年率0.9%（税抜 0.9%）</p> <p>なお、この報酬率には投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。</p>
------	--

(中略)

16. FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

(中略)

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

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

(中略)

17. 大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	大和住銀投信投資顧問株式会社
------	----------------

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.7452%以内（税抜：0.69%以内）
------	---------------------------------

(中略)

18. LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）（ 〃 ）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年率0.324%（税抜0.3%）
------	---------------------------

(中略)

21. FOFs用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

主な投資制限	<p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p>
ベンチマーク	S&P MLP 指数（円換算ベース）（2018年7月31日現在）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.1512%（税抜 年0.14%）
------	------------------------------

(中略)

24. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

(中略)

主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2018年7月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
--------	--

（中略）

ベンチマーク	L B M A金価格（円ヘッジベース）（ ）（2018年7月31日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
--------	---

（中略）

25. TCAファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
------	----------------------------

（中略）

26. ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

（中略）

信託報酬	純資産総額に対し、年0.567%（税抜 年0.525%）（2018年10月1日現在）
------	--

（中略）

「HFR I総合指数^(R)（HFR I Weighted Composite Index^(R)）」（以下「HFR指数」といいます。）は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク（HFR）の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」に関する使用を、BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。

（中略）

27. Global Absolute Return Strategies Fund- Class D^{A, H, JPY}

投資顧問会社	Standard Life Investments Limited
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等に投資します。
投資態度	主として世界の株式、債券、為替、デリバティブ等の多様な資産に対して、様々な投資手法を活用した投資を行うことで、リスクの低減を図りつつ、日本円短期金利（円LIBOR 6ヶ月物）を上回る投資成果を目指します。 組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	日本円短期金利（円LIBOR 6ヶ月物）
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.85%（税抜0.85%） この他、投資信託財産に関する租税や、投資信託の運営・運用等に要する諸費用が発生します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年6月14日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 副投資顧問会社 Standard Life Investments (USA) Limited ・ 管理事務代行会社 / 保管受託銀行 The Bank of New York Mellon SA/NV, Luxembourg Branch
------	---

28.FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

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

（中略）

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

（中略）

29.BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

（中略）

30.FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

（中略）

31.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

（中略）

32.FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648%（税抜 年0.06%）
------	------------------------------

（中略）

33.マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

（中略）

信託報酬	純資産総額に対し、年0.864%（税抜 年0.8%）
------	----------------------------

（中略）

34.Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A

（中略）

35.米国株式LSマザーファンド

（後略）

<訂正後>

（前略）

（参考）投資対象ファンドの概要

（中略）

以下の内容は、2019年1月31日()のファンドに関しては2019年4月10日)現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

(中略)

2.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)

(中略)

主な投資制限	(略)
	<p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。)について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0756% (*) (税抜 年0.07%) * 消費税率が10%になった場合は、0.077%となります。
------	---

(中略)

3.FOFs用日本株配当オープン(適格機関投資家専用)

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% () (税抜 年0.06%) 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

4.FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.3672% (*) (税抜 年0.34%) * 消費税率が10%になった場合は、0.374%となります。
------	---

(中略)

6.国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.5076% (*) (税抜 年0.47%) * 消費税率が10%になった場合は、0.517%となります。
------	---

(中略)

8.FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用)

(中略)

主な投資制限	(略) (略) (略) (略) (略)
	<p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% () (税抜 年0.06%) 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

9.FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% (*) (税抜 年0.06%) * 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

14.Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

(中略)

信託報酬	<p>年率0.8% (税抜 0.8%)</p> <p>なお、この報酬率には投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。</p>
------	---

(中略)

16.FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

(中略)

主な投資制限	(略) (略) (略) (略) (略)
	一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% () (税抜 年0.06%) 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

17. 大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
------	----------------------

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.7452% () 以内 (税抜：0.69%以内) 消費税率が10%になった場合は、0.759%以内となります。
------	---

(中略)

18. LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年率0.324% (*) (税抜0.3%) * 消費税率が10%になった場合は、0.33%となります。
------	---

(中略)

21. F O F s 用 M L P インデックスファンド(適格機関投資家専用)

(中略)

主な投資制限	(略) (略) (略) (略)
	一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
ベンチマーク	S&P MLP 指数 (円換算ベース) (2019年1月31日現在)

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.1512% (*) (税抜 年0.14%) * 消費税率が10%になった場合は、0.154%となります。
------	---

(中略)

24. ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)

(中略)

主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 (以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。) を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 > (2019年1月31日現在) iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
--------	---

(中略)

ベンチマーク	L B M A 金価格 (円ヘッジベース) () (2019年1月31日現在) ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
--------	---

(中略)

25. TCAファンド (適格機関投資家専用)

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.864% () (税抜 年0.8%) 消費税率が10%になった場合は、0.88%となります。
------	--

(中略)

26. ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.567% (*) (税抜 年0.525%) * 消費税率が10%になった場合は、0.5775%となります。
------	--

(中略)

「HFRI総合指数 (HFRI Weighted Composite Index) 」 (以下「HFR指数」といいます。) は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク (HFR) の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり (適格機関投資家専用) 」に関する使用を、BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。

(中略)

27. FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド (適格機関投資家専用)

(中略)

主な投資制限	(略)
	<p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>(略)</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% () (税抜 年0.06%) 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

28. BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

(中略)

29. FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% () (税抜 年0.06%) 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

30. FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% () (税抜 年0.06%) 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

31. FOFs用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.0648% () (税抜 年0.06%) 消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。
------	---

(中略)

32. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

(中略)

信託報酬	純資産総額に対し、年0.864% () (税抜 年0.8%) 消費税率が10%になった場合は、0.88%となります。
------	--

(中略)

33. Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A

(中略)

34. 米国株式LSマザーファンド

(中略)

35. ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）()

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<u>この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。</u>
主要投資対象	<u>日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。</u>

投資態度

各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<日本成長株投資マザーファンドの投資態度>

わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。

ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度>

株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。

ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>期中無分配とします。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年0.4968%（ ）（税抜 年0.46%） 消費税率が10%になった場合は、0.506%となります。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額</p>
<p>設定日</p>	<p>2019年4月10日</p>
<p>信託期間</p>	<p>無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>野村信託銀行株式会社</p>

3 投資リスク

〔参考情報〕を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2014年2月～2019年1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・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)^{※6}

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

※1 TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所 (以下「東証」) が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却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算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しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 手数料等及び税金

(1) 申込手数料

< 訂正前 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24% (税抜 3.0%) (1) の率を上限として、販

売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

（後略）

<訂正後>

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

*消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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

（後略）

（3）信託報酬等

<訂正前>

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.4904%（税抜 1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

（中略）

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

（中略）

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

（中略）

ファンド名	信託報酬
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	ありません。
FOFs用JPX日経インデックス400・オープン （適格機関投資家専用）	年率 0.0756% （税抜 0.07%）
FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド （適格機関投資家専用）	年率 0.3672% （税抜 0.34%）
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.5076% （税抜 0.47%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）
FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり （適格機関投資家専用）	年率 0.0648% （税抜 0.06%）

Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	年率 0.44% (税抜 0.44%)
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	年率 0.9% (税抜 0.9%)
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	年率 0.7452%以内 (税抜 0.69%以内)
LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.324% (税抜 0.3%)
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.1512% (税抜 0.14%)
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 0.65% (税抜 0.65%)
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
TCAファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.864% (税抜 0.8%)
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.567% (税抜 0.525%) (2018年10月1日現在)
Global Absolute Return Strategies Fund- Class D _{A, H, JPY}	年率 0.85% (税抜 0.85%)
FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74% (税抜 0.74%)
FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648% (税抜 0.06%)
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.864% (税抜 0.8%)
Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A	年率 1.5% (税抜 1.5%)
米国株式LSマザーファンド	ありません。

(中略)

実質的な信託報酬率：年率1.4904%～1.98186%程度（税抜 1.38%～1.8445%程度）
（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））

<訂正後>

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.4904%（1）（税抜 1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

（中略）

1：消費税率が10%になった場合は、1.518%となります。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.968% （税抜 0.88%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.495% （税抜 0.45%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

（中略）

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

（中略）

ファンド名	信託報酬
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	ありません。
F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）	年率 0.0756%（ <u>2</u> ）（税抜 0.07%）
F0Fs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	年率 0.0648%（ <u>3</u> ）（税抜 0.06%）
F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.3672%（ <u>4</u> ）（税抜 0.34%）
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.5076%（ <u>5</u> ）（税抜 0.47%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
F0Fs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.0648%（ <u>6</u> ）（税抜 0.06%）
F0Fs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.0648%（ <u>7</u> ）（税抜 0.06%）
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	年率 0.44% （税抜 0.44%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。

外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	年率 <u>0.8%</u> (税抜 <u>0.8%</u>)
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率 <u>0.0648%</u> (<u>8</u>) (税抜 <u>0.06%</u>)
大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド （適格機関投資家専用）	年率 <u>0.7452%以内</u> (<u>9</u>) (税抜 <u>0.69%以内</u>)
LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド （適格機関投資家専用）	年率 <u>0.324%</u> (<u>10</u>) (税抜 <u>0.3%</u>)
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファン ド	ありません。
FOFs用MLPインデックスファンド（適 格機関投資家専用）	年率 <u>0.1512%</u> (<u>11</u>) (税抜 <u>0.14%</u>)
HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス	年率 <u>0.65%</u> (税抜 <u>0.65%</u>)
グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
TCAファンド（適格機関投資家専用）	年率 <u>0.864%</u> (<u>12</u>) (税抜 <u>0.8%</u>)
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファ ンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専 用）	年率 <u>0.567%</u> (<u>13</u>) (税抜 <u>0.525%</u>)
FOFs用FRMダイバーシファイド リンクファン ド（適格機関投資家専用）	年率 <u>0.0648%</u> (<u>14</u>) (税抜 <u>0.06%</u>)
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 <u>0.74%</u> (税抜 <u>0.74%</u>)
FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファ ンド（適格機関投資家専用）	年率 <u>0.0648%</u> (<u>15</u>) (税抜 <u>0.06%</u>)
FOFs用 ピクテ マルチストラテジーリンク ファンド（適格機関投資家専用）	年率 <u>0.0648%</u> (<u>16</u>) (税抜 <u>0.06%</u>)
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイ ド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 <u>0.0648%</u> (<u>17</u>) (税抜 <u>0.06%</u>)
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関 投資家専用）	年率 <u>0.864%</u> (<u>18</u>) (税抜 <u>0.8%</u>)
Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A	年率 <u>1.5%</u> (税抜 <u>1.5%</u>)
米国株式LSマザーファンド	ありません。
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファ ンド（適格機関投資家専用）	年率 <u>0.4968%</u> (<u>19</u>) (税抜 <u>0.46%</u>)

2：消費税率が10%になった場合は、0.077%となります。

3：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

4：消費税率が10%になった場合は、0.374%となります。

5：消費税率が10%になった場合は、0.517%となります。

6：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

7：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

8：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

9：消費税率が10%になった場合は、0.759%以内となります。

10：消費税率が10%になった場合は、0.33%となります。

11：消費税率が10%になった場合は、0.154%となります。

12：消費税率が10%になった場合は、0.88%となります。

13：消費税率が10%になった場合は、0.5775%となります。

14：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

15：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

16：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

17：消費税率が10%になった場合は、0.066%となります。

18：消費税率が10%になった場合は、0.88%となります。

19：消費税率が10%になった場合は、0.506%となります。

（中略）

実質的な信託報酬率：年率1.4904%～1.98186%（20）程度（税抜 1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））

20：消費税率が10%になった場合は、1.518%～2.00946%程度となります。

（5）課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

上記は、2018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）

<訂正後>

（前略）

上記は、2019年 1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、2019年1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（%）
-------	------	---------	---------

投資信託受益証券	日本	160,702,443	36.31
	ルクセンブルク	15,843,218	3.58
	ケイマン	7,782,687	1.76
	小計	184,328,348	41.65
投資証券	ルクセンブルク	11,091,506	2.51
	ケイマン	2,152,010	0.49
	小計	13,243,516	2.99
親投資信託受益証券	日本	236,568,650	53.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,475,263	1.91
合計(純資産総額)		442,615,777	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	265,505,604,820	98.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,585,478,708	1.33
合計(純資産総額)		269,091,083,528	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	3,622,080,000	1.35

(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。

(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	203,683,617,826	60.07
	イギリス	20,467,237,371	6.04
	カナダ	12,623,734,273	3.72
	フランス	12,160,010,048	3.59
	スイス	11,619,651,715	3.43
	ドイツ	10,808,701,139	3.19
	オーストラリア	7,653,162,032	2.26
	オランダ	5,873,223,630	1.73
	アイルランド	5,447,571,267	1.61
	スペイン	3,838,616,168	1.13
	香港	3,179,621,991	0.94
	スウェーデン	3,022,304,271	0.89
	イタリア	2,360,770,076	0.70
	デンマーク	2,128,288,415	0.63
	フィンランド	1,600,175,024	0.47
	シンガポール	1,523,403,393	0.45
	バミューダ	1,348,904,537	0.40
	ベルギー	1,182,382,873	0.35
	ジャージー	901,502,550	0.27
	ノルウェー	883,033,280	0.26
	ケイマン	878,690,866	0.26
	イスラエル	691,535,098	0.20
	キュラソー	583,961,314	0.17
	ルクセンブルク	454,136,176	0.13
	オーストリア	322,683,886	0.10
	ニュージーランド	281,146,263	0.08
	パナマ	219,803,502	0.06
	ポルトガル	192,008,130	0.06
	リベリア	183,031,803	0.05
	パプアニューギニア	71,655,161	0.02
	英ヴァージン諸島	53,975,112	0.02
	マン島	40,199,288	0.01
モーリシャス	8,643,761	0.00	
	小計	316,287,382,239	93.28
投資信託受益証券	オーストラリア	154,106,677	0.05

	香港	68,580,833	0.02
	小計	222,687,510	0.07
投資証券	アメリカ	6,605,272,949	1.95
	オーストラリア	620,605,482	0.18
	フランス	443,392,821	0.13
	イギリス	250,893,525	0.07
	香港	212,176,000	0.06
	シンガポール	145,111,786	0.04
	カナダ	65,432,508	0.02
	小計	8,342,885,071	2.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,223,536,387	4.19
合計(純資産総額)		339,076,491,207	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	9,221,598,060	2.72
	買建	カナダ	520,977,049	0.15
	買建	ドイツ	2,369,212,811	0.70
	買建	イギリス	1,031,039,940	0.30
	買建	オーストラリア	575,124,900	0.17

(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		270,457,800	0.08
	売建		409,161,300	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	110,849,310,941	44.78
	フランス	24,338,555,272	9.83
	イタリア	21,786,708,713	8.80
	ドイツ	16,717,338,807	6.75
	イギリス	16,482,236,228	6.66
	スペイン	14,051,181,971	5.68
	ベルギー	5,909,949,813	2.39
	オーストラリア	5,127,771,420	2.07
	オランダ	5,054,784,814	2.04
	カナダ	4,901,674,323	1.98
	オーストリア	3,534,833,753	1.43
	メキシコ	1,888,031,771	0.76
	アイルランド	1,854,164,682	0.75
	フィンランド	1,535,061,096	0.62
	ポーランド	1,518,389,416	0.61
	南アフリカ	1,482,040,245	0.60
	デンマーク	1,321,421,878	0.53
	マレーシア	1,118,647,611	0.45
	シンガポール	956,823,105	0.39
	スウェーデン	935,615,834	0.38
ノルウェー	580,768,205	0.23	
	小計	241,945,309,898	97.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,620,937,425	2.27
合計(純資産総額)		247,566,247,323	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	1,101,599,230	0.44
	買建	ドイツ	1,280,668,710	0.52

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		3,268,815,000	1.32

(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)新興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	ブラジル	4,879,290,164	10.31
	メキシコ	4,754,209,476	10.05
	インドネシア	4,259,588,371	9.00
	ポーランド	4,248,087,224	8.98
	南アフリカ	4,108,477,750	8.68
	タイ	3,973,458,565	8.40
	ロシア	3,439,016,364	7.27
	コロンビア	3,213,398,995	6.79
	マレーシア	2,626,830,940	5.55
	トルコ	2,356,906,865	4.98
	ハンガリー	2,213,593,031	4.68
	チェコ	1,860,691,155	3.93
	チリ	1,486,018,224	3.14
	ペルー	1,453,939,691	3.07

	フィリピン	135,056,532	0.29
	ウルグアイ	111,708,085	0.24
	ドミニカ共和国	42,837,478	0.09
	小計	45,163,108,910	95.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,147,184,654	4.54
合計(純資産総額)		47,310,293,564	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) 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	104,371,162,950	97.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,637,837,409	2.47
合計(純資産総額)		107,009,000,359	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	2,608,411,000	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

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	54,100,062,363	71.67
	オーストラリア	5,191,326,755	6.88
	イギリス	3,911,983,949	5.18

	フランス	3,390,012,264	4.49
	シンガポール	2,843,430,821	3.77
	香港	1,731,186,955	2.29
	カナダ	1,401,808,411	1.86
	ベルギー	655,904,266	0.87
	スペイン	547,784,128	0.73
	ニュージーランド	334,176,157	0.44
	オランダ	274,889,284	0.36
	ドイツ	208,747,397	0.28
	アイルランド	178,317,884	0.24
	ガンジー	101,064,453	0.13
	イスラエル	45,589,232	0.06
	マン島	33,807,980	0.04
	イタリア	26,387,827	0.03
	韓国	9,520,490	0.01
	小計	74,986,000,616	99.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		497,005,002	0.66
合計(純資産総額)		75,483,005,618	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		35,001,650	0.05
	売建		49,014,000	0.06

(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)グローバル・コモディティ(米ドル建て) 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	アイルランド	9,439,858,560	43.52
	ルクセンブルク	9,012,223,248	41.54
	イギリス	2,085,747,187	9.61
	アメリカ	368,720,640	1.70
	ジャージー	358,696,320	1.65
	小計	21,265,245,955	98.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		427,660,300	1.97
合計(純資産総額)		21,692,906,255	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) ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	18,066,979,576	101.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		206,315,756	1.16
合計(純資産総額)		17,860,663,820	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	売建		17,858,435,748	99.99

(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) 米国株式LS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	アイルランド	19,284,315,019	97.21

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		553,848,166	2.79
合計(純資産総額)		19,838,163,185	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		19,115,360,000	96.36

(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	37,757,855	2.3349	88,163,660	2.3777	89,776,851	20.28
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	20,387,294	1.7047	34,755,797	1.7709	36,103,858	8.16
日本	投資信託受益証券	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	22,469,249	1.4112	31,710,219	1.4042	31,551,319	7.13
日本	投資信託受益証券	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,444,152	1.179	31,180,219	1.1725	31,005,768	7.01
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	16,101,077	1.7393	28,004,641	1.8052	29,065,664	6.57
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	8,580,559	2.7144	23,291,502	2.6959	23,132,329	5.23
日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	21,040,467	1.0353	21,784,334	1.0424	21,932,582	4.96

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	15,387,327	1.4169	21,803,481	1.4253	21,931,557	4.95
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	20,839,706	0.9374	19,536,116	0.9789	20,399,988	4.61
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	1,729.609	8,876.99	15,353,729	9,160	15,843,218	3.58
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	1,137.244	9,761.29	11,100,975	9,752.97	11,091,506	2.51
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	12,149,981	0.8499	10,326,739	0.8421	10,231,499	2.31
日本	投資信託受益証券	FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	8,610,053	1.1761	10,126,739	1.1745	10,112,507	2.28
日本	投資信託受益証券	FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,880,291	1.0708	8,438,949	1.0779	8,494,165	1.92
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	27,449,094	0.3043	8,354,560	0.3019	8,286,881	1.87
日本	投資信託受益証券	FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	8,088,768	0.9995	8,085,446	1.0006	8,093,621	1.83
日本	投資信託受益証券	FOFs用 ビクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	7,521,559	1.0084	7,585,446	0.9963	7,493,729	1.69
日本	投資信託受益証券	FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	7,638,173	0.9345	7,138,172	0.9291	7,096,626	1.60
日本	投資信託受益証券	FOFs用MLPインデックスファンド（適格機関投資家専用）	10,241,292	0.5945	6,088,809	0.6056	6,202,126	1.40
日本	親投資信託受益証券	米国株式LSマザーファンド	5,633,450	1.0214	5,754,490	1.0307	5,806,396	1.31
日本	投資信託受益証券	大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	4,729,841	0.9654	4,566,605	0.9553	4,518,417	1.02
ケイマン	投資信託受益証券	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	437.7428	9,044.96	3,959,370	9,052.8	3,962,800	0.90
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	3,437.9878	1,106.89	3,805,506	1,111.08	3,819,887	0.86
日本	投資信託受益証券	LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	3,368,458	1.0021	3,375,581	1.0032	3,379,237	0.76
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	3,426,143	0.9441	3,234,678	0.9383	3,214,749	0.73
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	3,911,563	0.8233	3,220,656	0.8085	3,162,498	0.71

ケイマン	投資証券	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A	236	8,951.22	2,112,488	9,118.68	2,152,010	0.49
日本	投資信託受益証券	F O F s 用世界物価連動債ファン ド 為替ヘッジあり（適格機関投資 家専用）	2,133,516	0.9888	2,109,738	0.9881	2,108,127	0.48
日本	投資信託受益証券	F0Fs用日本物価連動国債ファンド(適 格機関投資家専用)	2,150,198	0.9811	2,109,738	0.9792	2,105,473	0.48
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザー ファンド	1,244,277	1.6277	2,025,346	1.6597	2,065,126	0.47

(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(%)
投資信託受益証券	41.65
投資証券	2.99
親投資信託受益証券	53.45
合計	98.09

(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	1,321,400	6,885.78	9,098,869,692	6,675.00	8,820,345,000	3.28
日本	株式	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ	銀行業	8,145,200	662.71	5,397,905,492	583.60	4,753,538,720	1.77
日本	株式	ソニー	電気機器	795,400	5,357.91	4,261,681,614	5,467.00	4,348,451,800	1.62
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通 信業	486,300	7,991.79	3,886,407,477	8,526.00	4,146,193,800	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	795,900	5,006.37	3,984,569,883	4,671.00	3,717,648,900	1.38

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	824,300	4,410.27	3,635,385,561	4,045.00	3,334,293,500	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	751,700	4,455.42	3,349,144,564	4,389.00	3,299,211,300	1.23
日本	株式	キーエンス	電気機器	58,200	63,201.91	3,678,351,162	55,860.00	3,251,052,000	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,000,300	3,398.93	3,399,949,679	3,249.00	3,249,974,700	1.21
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	15,892,400	190.25	3,023,529,100	179.40	2,851,096,560	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,025,500	2,892.90	2,966,668,950	2,723.00	2,792,436,500	1.04
日本	株式	三菱商事	卸売業	819,600	3,068.17	2,514,672,132	3,181.00	2,607,147,600	0.97
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	106,200	22,534.91	2,393,207,442	23,490.00	2,494,638,000	0.93
日本	株式	任天堂	その他製品	73,000	39,738.07	2,900,879,110	33,830.00	2,469,590,000	0.92
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	811,700	2,986.47	2,424,117,699	2,912.50	2,364,076,250	0.88
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	489,500	4,851.52	2,374,819,040	4,739.00	2,319,740,500	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	423,900	5,282.96	2,239,446,744	5,312.00	2,251,756,800	0.84
日本	株式	花王	化学	287,900	8,277.84	2,383,190,136	7,672.00	2,208,768,800	0.82
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	835,600	2,776.61	2,320,135,316	2,605.50	2,177,155,800	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	210,900	10,472.37	2,208,622,833	10,080.00	2,125,872,000	0.79
日本	株式	ファナック	電気機器	112,700	22,117.94	2,492,691,838	18,360.00	2,069,172,000	0.77
日本	株式	キヤノン	電気機器	638,500	3,597.21	2,296,818,585	3,114.00	1,988,289,000	0.74
日本	株式	村田製作所	電気機器	124,400	16,102.18	2,003,111,192	15,420.00	1,918,248,000	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	161,900	12,680.67	2,053,000,473	11,765.00	1,904,753,500	0.71
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	687,200	2,902.41	1,994,536,152	2,750.00	1,889,800,000	0.70
日本	株式	信越化学工業	化学	204,700	10,427.57	2,134,523,579	9,176.00	1,878,327,200	0.70
日本	株式	日本電産	電気機器	142,700	16,084.28	2,295,226,756	13,030.00	1,859,381,000	0.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	533,900	3,846.08	2,053,422,112	3,413.00	1,822,200,700	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,093,300	1,674.48	1,830,708,984	1,609.50	1,759,666,350	0.65
日本	株式	三井物産	卸売業	962,200	1,868.88	1,798,236,336	1,772.50	1,705,499,500	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	0.12
		鉱業	0.28
		建設業	2.94
		食料品	4.27
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.29
		化学	7.08
		医薬品	5.28
		石油・石炭製品	0.69
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	0.90
		鉄鋼	1.00
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.58
		機械	4.86
		電気機器	12.69
		輸送用機器	8.18
		精密機器	1.88
		その他製品	2.08
		電気・ガス業	1.95
		陸運業	4.69
		海運業	0.17
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.03
		卸売業	5.00
		小売業	4.84
		銀行業	6.46
		証券、商品先物取引業	0.84
		保険業	2.26
		その他金融業	1.15
		不動産業	2.43
サービス業	4.72		
	小計	98.67	

合計	98.67
----	-------

(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	411,495	20,471.15	8,423,777,341	18,005.64	7,409,230,832	2.19
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	620,635	10,761.99	6,679,271,994	11,591.16	7,193,882,566	2.12
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,323	175,803.20	6,209,896,469	182,010.05	6,429,141,095	1.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・ 娯楽	205,664	19,907.46	4,094,248,575	16,389.76	3,370,784,259	0.99
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	229,254	13,323.61	3,054,491,541	14,343.49	3,288,303,465	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	286,626	12,036.85	3,450,076,872	11,376.51	3,260,804,587	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	26,855	117,234.50	3,148,332,761	118,663.97	3,186,721,118	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	25,494	118,157.23	3,012,300,452	119,636.99	3,050,025,433	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	361,142	8,562.57	3,092,306,415	7,876.71	2,844,613,836	0.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	809,805	3,278.93	2,655,297,312	3,167.46	2,565,030,776	0.76
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	261,490	8,448.64	2,209,235,667	9,525.47	2,490,817,661	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	110,724	21,273.76	2,355,516,791	22,441.40	2,484,801,751	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	82,318	26,796.67	2,205,848,425	29,459.51	2,425,048,372	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	151,622	14,334.07	2,173,361,694	14,992.89	2,273,252,877	0.67

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	501,305	3,919.85	1,965,042,495	4,530.55	2,271,190,777	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	212,473	8,187.90	1,739,708,475	10,298.89	2,188,238,010	0.65
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	390,589	5,965.32	2,329,992,183	5,457.80	2,131,759,144	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	352,654	5,341.66	1,883,757,807	5,883.83	2,074,959,711	0.61
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	401,562	4,715.77	1,893,676,272	5,089.52	2,043,758,473	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	393,606	6,010.59	2,365,806,748	5,179.95	2,038,862,706	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	163,581	13,276.25	2,171,743,351	12,313.56	2,014,266,029	0.59
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	619,927	3,461.26	2,145,734,577	3,200.15	1,983,862,613	0.59
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	46,611	39,195.99	1,826,964,724	42,245.97	1,969,126,964	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,692	20,324.97	1,985,587,526	19,850.33	1,939,218,712	0.57
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	227,576	6,507.43	1,480,936,091	7,994.39	1,819,332,482	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	345,058	4,653.63	1,605,773,860	5,214.82	1,799,417,292	0.53
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	78,802	20,870.02	1,644,599,855	22,230.01	1,751,769,973	0.52
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	185,277	8,340.77	1,545,353,993	9,387.27	1,739,245,261	0.51
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,050	24,042.27	1,443,738,537	28,234.20	1,695,464,070	0.50
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,712,303	1,041.83	1,783,930,360	931.43	1,594,898,464	0.47

(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	6.25
		素材	4.35
		資本財	6.78
		商業・専門サービス	1.09
		運輸	1.90
		自動車・自動車部品	1.21
		耐久消費財・アパレル	1.81
		消費者サービス	1.83
		メディア・娯楽	5.53
		小売	4.52
		食品・生活必需品小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	4.61
		家庭用品・パーソナル用品	1.92
		ヘルスケア機器・サービス	4.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.14
		銀行	8.24
		各種金融	4.15
		保険	3.68
		不動産	0.63
		ソフトウェア・サービス	8.14
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.88		
電気通信サービス	2.32		
公益事業	3.30		
半導体・半導体製造装置	2.80		
	小計	93.28	
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.46
合計			95.81

(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	10,384.01	1,817,202,595	10,566.73	1,849,178,601	1.750	2023/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	9,700.84	1,600,639,569	9,798.29	1,616,718,029	2.500	2046/2/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,506.94	1,539,267,222	10,658.99	1,561,542,193	1.875	2022/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,260.91	1,503,224,601	10,542.97	1,544,545,126	2.250	2027/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	10,866.58	1,515,888,022	10,891.08	1,519,305,708	2.500	2020/5/31	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,600.93	1,325,117,258	10,812.31	1,351,539,608	2.375	2024/8/15	0.55
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	10,180,000	13,487.41	1,373,018,897	13,138.18	1,337,467,174	3.500	2020/4/25	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	9,763.96	1,288,842,902	10,071.14	1,329,391,242	1.500	2026/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,263.64	1,262,428,412	10,521.22	1,294,110,687	2.000	2025/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,389.08	1,246,690,433	10,619.64	1,274,357,226	2.125	2025/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/20	11,500,000	10,820.54	1,244,362,410	10,856.30	1,248,475,563	2.250	2020/3/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,191.53	1,242,260,099	11,136.70	1,236,174,358	3.625	2021/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	10,844.13	1,192,854,854	10,961.97	1,205,817,149	2.750	2021/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	10,913.45	1,200,479,650	10,912.41	1,200,366,122	2.625	2020/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,507.46	1,176,835,809	10,646.85	1,192,447,467	1.750	2022/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 06/30/25	10,500,000	10,690.28	1,122,479,770	11,015.97	1,156,677,511	2.750	2025/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,468.41	1,141,057,142	10,573.81	1,152,545,891	2.875	2045/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	10,400,000	10,786.80	1,121,827,470	10,963.62	1,140,216,630	2.750	2028/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3% 10/31/25	10,000,000	10,951.94	1,095,194,149	11,182.51	1,118,251,294	3.000	2025/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,382.10	1,090,120,931	10,612.34	1,114,296,176	2.000	2024/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,500.93	1,065,845,013	10,727.02	1,088,792,787	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	9,760,000	10,945.57	1,068,287,881	11,070.02	1,080,434,293	2.875	2028/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,459.69	1,061,658,872	10,617.12	1,077,638,170	1.750	2022/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	10,659.13	1,065,913,665	10,726.38	1,072,638,371	1.500	2020/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,392.64	1,039,264,544	10,536.71	1,053,671,965	1.250	2021/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	9,620,000	10,685.85	1,027,979,161	10,754.49	1,034,581,942	1.250	2020/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,410.77	1,020,256,331	10,552.41	1,034,137,045	1.125	2021/6/30	0.42

アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/47	9,950,000	10,180.64	1,012,974,406	10,268.40	1,021,706,308	2.750	2047/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,517.59	1,004,430,645	10,653.74	1,017,432,822	1.750	2022/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,499.30	1,002,683,905	10,641.35	1,016,249,624	1.750	2022/5/31	0.41

(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	97.73
合計	97.73

(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) 新興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 (%)
コロンビ ア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	48,100,000,000	4.24	2,039,580,781	4.21	2,025,659,927	9.850	2027/6/28	4.28
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	8,870,000,000	16.80	1,490,297,191	16.75	1,486,018,224	5.500	2020/8/5	3.14
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000	2,626.08	986,094,799	2,701.93	1,014,575,518	0.000	2020/7/1	2.14
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	25,850,000	3,022.50	781,316,892	3,129.16	808,890,436	10.000	2023/1/1	1.71
コロンビ ア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.24	768,566,064	3.26	772,206,745	4.375	2023/3/21	1.63
南アフリ カ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	76,750,000	875.14	671,675,323	896.78	688,285,807	10.500	2026/12/21	1.45
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	167,500,000	356.18	596,602,631	368.69	617,571,336	3.400	2036/6/17	1.31
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/20	21,600,000	2,681.39	579,182,194	2,748.35	593,644,617	0.000	2020/4/1	1.25
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	367.23	502,740,279	383.34	524,799,428	3.650	2031/6/20	1.11
南アフリ カ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	68,850,000	719.51	495,387,061	736.07	506,790,718	8.750	2048/2/28	1.07

メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000	542.38	497,368,283	549.69	504,066,555	6.500	2021/6/10	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,700,000	522.87	484,701,136	538.08	498,805,444	7.500	2027/6/3	1.05
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	91,600,000	532.69	487,949,857	541.37	495,899,134	6.500	2022/6/9	1.05
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	15,700,000	2,952.10	463,480,293	3,128.65	491,198,386	10.000	2027/1/1	1.04
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	15,550,000	2,995.50	465,800,415	3,132.93	487,172,128	10.000	2025/1/1	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	85,000,000	565.87	480,997,065	568.31	483,070,725	8.000	2020/6/11	1.02
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	77,350,000	604.24	467,381,767	615.05	475,745,545	10.000	2024/12/5	1.01
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	13,800,000	3,063.12	422,711,062	3,105.35	428,539,527	10.000	2021/1/1	0.91
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	17,850,000	2,288.13	408,431,808	2,378.34	424,535,283	0.000	2022/1/1	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000	2,815.88	409,711,461	2,902.82	422,361,582	2.500	2026/7/25	0.89
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	56,800,000	718.52	408,124,159	737.13	418,692,623	8.750	2044/1/31	0.88
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	11,600,000,000	3.59	416,760,214	3.58	415,532,323	7.750	2021/4/14	0.88
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	14,000,000	2,934.64	410,850,418	2,964.05	414,967,667	2.250	2022/4/25	0.88
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	16,500,000	2,387.33	393,910,683	2,488.76	410,646,305	0.000	2021/7/1	0.87
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	409.82	389,332,534	421.72	400,643,362	4.875	2029/6/22	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000	2,920.08	389,830,684	2,924.89	390,473,667	1.500	2020/4/25	0.83
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000	2,993.74	380,205,150	3,062.35	388,918,715	3.250	2025/7/25	0.82
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	13,150,000	2,779.10	365,452,561	2,878.46	378,518,764	2.500	2027/7/25	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	74,100,000	489.64	362,829,995	510.66	378,403,395	7.750	2042/11/13	0.80
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000	0.77	375,574,554	0.77	375,747,703	8.375	2024/3/15	0.79

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	95.46
合計	95.46

(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) 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	11,133	679,554.57	7,565,481,027	704,000	7,837,632,000	7.32
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,497	609,508.91	7,007,523,938	638,000	7,335,086,000	6.85
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	34,076	146,764.66	5,001,152,554	155,900	5,312,448,400	4.96
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,729	214,902.28	4,669,611,642	223,000	4,845,567,000	4.53
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,356	177,284.94	4,495,236,938	173,700	4,404,337,200	4.12
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	22,907	177,564.51	4,067,470,230	190,300	4,359,202,100	4.07
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,394	247,777.42	3,566,508,183	256,200	3,687,742,800	3.45
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,421	239,050.98	3,686,405,162	237,500	3,662,487,500	3.42
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,205	297,678.14	3,335,483,558	322,000	3,608,010,000	3.37
日本	投資証券	G L P投資法人	28,488	112,662.45	3,209,527,875	115,700	3,296,061,600	3.08
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,278	416,122.98	3,028,543,048	443,500	3,227,793,000	3.02
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,005	80,131.66	2,965,272,078	83,500	3,089,917,500	2.89
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	6,040	481,235.27	2,906,661,030	471,500	2,847,860,000	2.66
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,556	725,005.36	2,578,119,060	747,000	2,656,332,000	2.48
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	29,663	70,768.24	2,099,198,303	76,200	2,260,320,600	2.11
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,820	524,538	2,003,735,160	579,000	2,211,780,000	2.07
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,654	720,578.74	1,912,415,997	728,000	1,932,112,000	1.81
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,185	139,281.91	1,836,431,983	144,500	1,905,232,500	1.78
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	39,663	46,396.51	1,840,224,776	47,350	1,878,043,050	1.76
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,586	228,275.65	1,731,699,080	230,000	1,744,780,000	1.63
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,911	441,782.37	1,727,810,849	445,000	1,740,395,000	1.63
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,294	164,518.58	1,529,035,682	178,900	1,662,696,600	1.55
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,295	148,807.11	1,531,969,197	155,600	1,601,902,000	1.50

日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,395	113,027.57	1,514,004,300	116,300	1,557,838,500	1.46
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,801	126,391.49	1,491,545,973	127,400	1,503,447,400	1.40
日本	投資証券	プレミアム投資法人	10,931	122,851.66	1,342,891,495	132,900	1,452,729,900	1.36
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,711	368,978.15	1,369,277,914	385,500	1,430,590,500	1.34
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,217	162,522.3	1,335,445,739	168,700	1,386,207,900	1.30
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,708	161,488.16	1,244,750,737	167,900	1,294,173,200	1.21
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,386	274,540.71	1,204,135,565	288,700	1,266,238,200	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	97.53
合計	97.53

(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	183,110	20,536.55	3,760,448,902	19,749.00	3,616,239,390	4.79
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	373,211	7,348.16	2,742,416,579	7,451.77	2,781,084,176	3.68
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	88,960	22,481.38	1,999,943,645	22,908.83	2,037,970,406	2.70
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	224,210	7,579.99	1,699,511,400	8,346.33	1,871,331,995	2.48
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	218,800	7,353.28	1,608,898,557	7,845.12	1,716,512,256	2.27
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	82,090	19,877.99	1,631,784,735	20,836.42	1,710,461,783	2.27
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	81,730	20,175.23	1,648,921,951	19,771.19	1,615,899,931	2.14
香港	投資証券	LINK REIT	1,270,500	1,001.58	1,272,507,690	1,182.03	1,501,780,549	1.99
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	213,040	6,546.03	1,394,566,248	6,960.36	1,482,836,117	1.96
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	123,260	12,045.67	1,484,749,845	11,705.57	1,442,828,903	1.91
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	91,040	13,537.96	1,232,496,133	14,214.92	1,294,126,462	1.71

アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	175,530	6,841.75	1,200,932,537	7,362.42	1,292,326,846	1.71
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	39,150	27,684.67	1,083,855,038	29,529.24	1,156,070,122	1.53
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,139,590	318.20	999,045,166	320.57	1,006,482,227	1.33
アメリカ	投資証券	HCP INC	280,910	3,142.82	882,852,114	3,367.95	946,091,846	1.25
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	954,420	826.42	788,752,584	951.46	908,100,089	1.20
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	63,260	13,564.58	858,095,341	14,095.06	891,653,850	1.18
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	440,510	2,059.44	907,204,557	1,978.71	871,643,128	1.15
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	75,730	9,909.77	750,467,626	10,626.86	804,772,774	1.07
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	96,840	7,112.84	688,808,250	8,078.29	782,302,030	1.04
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	103,660	7,634.52	791,395,123	7,491.00	776,517,060	1.03
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	68,190	10,958.44	747,256,657	11,346.00	773,684,067	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	162,290	4,451.07	722,364,738	4,753.92	771,514,456	1.02
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	101,590	7,106.76	721,976,418	7,078.04	719,058,246	0.95
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	215,680	3,112.63	671,332,399	3,261.17	703,369,749	0.93
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	172,360	3,578.89	616,858,292	4,014.08	691,867,932	0.92
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,620	14,018.79	611,499,777	14,321.70	624,712,659	0.83
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,950	10,629.04	562,808,092	11,344.91	600,713,260	0.80
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	50,750	11,188.01	567,791,650	11,770.94	597,375,652	0.79
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,450	10,087.98	559,378,514	10,522.26	583,459,716	0.77

(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	99.34
合計	99.34

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

(参考)グローバル・コモディティ(米ドル建て) 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 (%)
アイルラ ンド	社債券	STAR HELIOS 006 11/08/19	88,000,000	10,896.00	9,588,480,000	10,727.11	9,439,858,560	0.000	2019/11/8	43.52
ルクセン ブルク	社債券	SG ISSUER 012 08/30/19	30,000,000	10,751.26	3,225,379,440	10,672.63	3,201,789,600	0.000	2019/8/30	14.76
ルクセン ブルク	社債券	SG ISSUER 011 06/28/19	22,000,000	10,417.21	2,291,788,368	10,048.29	2,210,624,064	0.000	2019/6/28	10.19
ルクセン ブルク	社債券	SG ISSUER 009 02/28/19	20,000,000	10,984.25	2,196,851,520	9,768.26	1,953,652,800	0.000	2019/2/28	9.01
ルクセン ブルク	社債券	SG ISSUER 010 04/26/19	17,000,000	10,931.95	1,858,432,656	9,683.27	1,646,156,784	0.000	2019/4/26	7.59
イギリス	社債券	CS USD COM 015 09/30/19	12,000,000	10,656.28	1,278,754,560	10,194.29	1,223,315,712	0.000	2019/9/30	5.64
イギリス	社債券	BAR USD COM 036 10/31/19	8,000,000	10,661.73	852,938,880	10,780.39	862,431,475	0.000	2019/10/31	3.98
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	2,774.66	416,199,960	2,458.13	368,720,640	0.000	2036/6/12	1.70
ジャー ジー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	1,004.61	401,844,480	896.74	358,696,320	0.000	9999/99/99	1.65

(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。

(注3) 償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	98.03
合計	98.03

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

(参考) ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

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	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	13,128,500	1,309.94	17,197,600,266	1,376.16	18,066,979,576	101.16
------	----------	--------------------	------------	----------	----------------	----------	----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	101.16
合計	101.16

(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)米国株式LS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(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/22	165,000,000	10,815.07	17,844,876,929	11,687.46	19,284,315,019	0.000	2022/10/18	97.21

(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	97.21
合計	97.21

(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）新興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）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。

（参考）グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

（参考）米国株式L S 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	T O P I X先物	買建	231	円	3,542,776,780	3,622,080,000	1.35

(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。

（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	631	アメリカドル	80,610,847	8,783,357,889	84,632,875	9,221,598,060	2.72
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	34	カナダドル	5,912,669	490,042,006	6,285,920	520,977,049	0.15
	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	4,943,966	542,303,630	5,149,240	564,820,135	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	458	ユーロ	13,901,171	1,739,731,551	14,417,840	1,804,392,676	0.53
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	50	オーストラリアドル	7,013,250	553,766,220	7,283,750	575,124,900	0.17
	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	105	イギリスポンド	7,031,908.75	1,004,719,122	7,216,125	1,031,039,940	0.30

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

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

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	1,830,000.00	200,202,000	199,378,500	0.06
	カナダドル	買建	140,000.00	11,538,800	11,601,800	0.00
	ユーロ	買建	120,000.00	15,011,880	15,018,000	0.00
	イギリスポンド	買建	150,000.00	21,485,700	21,430,500	0.01
	スイスフラン	買建	100,000.00	10,998,300	10,969,000	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	1,000,000.00	12,070,000	12,060,000	0.00
	アメリカドル	売建	2,550,000.00	277,746,000	277,746,000	0.08
	カナダドル	売建	220,000.00	18,227,440	18,229,200	0.01
	ユーロ	売建	450,000.00	56,312,100	56,317,500	0.02

イギリスポンド	売建	200,000.00	28,569,800	28,572,000	0.01
スイスフラン	売建	140,000.00	15,356,180	15,356,600	0.00
ノルウェークローネ	売建	1,000,000.00	12,945,000	12,940,000	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) 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	40	アメリカドル	4,576,628.77	498,669,470	4,583,437.6	499,411,360	0.20
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカドル	3,042,740.68	331,537,025	3,050,000	332,328,000	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	17	アメリカドル	2,474,693	269,642,549	2,476,687.5	269,859,870	0.11
	ドイツ	ユーレック・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	19	ユーロ	2,126,791	266,167,893	2,125,530	266,010,079	0.11
	ドイツ	ユーレック・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	20	ユーロ	2,655,260	332,305,789	2,656,600	332,473,490	0.13
	ドイツ	ユーレック・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	33	ユーロ	5,427,942	679,306,941	5,450,940	682,185,141	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	15,060,000.00	1,634,752,685	1,638,979,800	0.66

カナダドル	買建	1,680,000.00	137,644,535	139,120,800	0.06
ユーロ	買建	10,040,000.00	1,251,914,411	1,256,506,000	0.51
イギリスポンド	買建	1,640,000.00	230,544,655	234,208,400	0.09

(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)新興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)J-REIT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REIT指数先物	買建	1,418	円	2,530,988,200	2,608,411,000	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

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	イギリスポンド	買建	245,000.00	35,034,960	35,001,650	0.05
	アメリカドル	売建	450,000.00	49,014,000	49,014,000	0.06

(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）グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

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	売建	163,989,309.00	17,613,531,076	17,858,435,748	99.99

(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）米国株式 L S 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	売建	176,000,000.00	19,118,880,000	19,115,360,000	96.36

(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）
2018年10月末日	1,004,806		10,048	
11月末日	63,576,512		10,205	

12月末日	321,077,747		9,625	
2019年 1月末日	442,615,777		9,988	

分配の推移

当ファンドの第1期計算期間が2018年10月26日から2019年7月10日のため記載しておりません。

収益率の推移


当ファンドの第1期計算期間が2018年10月26日から2019年7月10日のため記載しておりません。

(4) 設定及び解約の実績

当ファンドの第1期計算期間が2018年10月26日から2019年7月10日のため記載しておりません。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

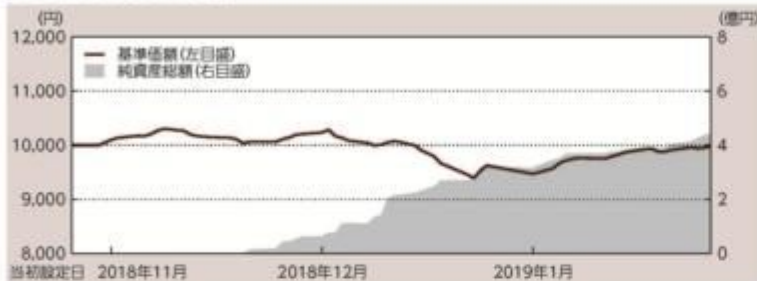


運用実績

当初設定日：2018年10月26日
作成基準日：2019年1月31日



基準価額・純資産の推移



基準価額	9,988円
純資産総額	4.43億円

※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	—	—	—	—	—

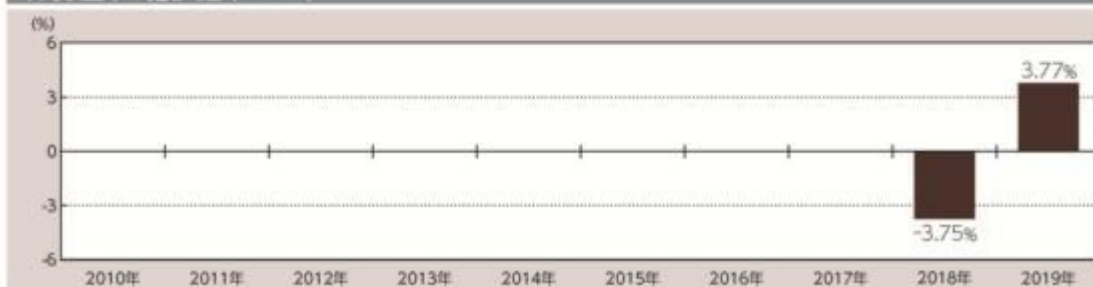
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	20.3%
J-REIT インデックス マザーファンド	8.2%
FOFs 用JPX 日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	7.1%
FOFs 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	7.0%
グローバルREIT インデックス マザーファンド	6.6%
外国債券インデックス マザーファンド	5.2%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	5.0%
国内株式インデックス マザーファンド	5.0%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	4.6%
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	3.6%

※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年末までの収益率です。また、2019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

<訂正前>

(1)当ファンドは、2018年10月26日から運用を開始する予定であり、該当事項はありません。

(後略)

<訂正後>

(1)当ファンドは、2018年10月26日から運用を開始していますが、2019年4月10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。

(後略)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(2019年 1月31日現在)

資産総額	443,643,429円
負債総額	1,027,652円
純資産総額(-)	442,615,777円
発行済口数	443,142,897口
1口当たり純資産額(/)	0.9988円
(1万口当たり純資産額)	(9,988円)

(参考) 国内株式インデックス マザーファンド

(2019年 1月31日現在)

資産総額	272,638,679,723円
負債総額	3,547,596,195円
純資産総額(-)	269,091,083,528円
発行済口数	188,793,426,909口
1口当たり純資産額(/)	1.4253円
(1万口当たり純資産額)	(14,253円)

（参考）外国株式インデックス マザーファンド

（2019年 1月31日現在）

資産総額	339,750,780,671円
負債総額	674,289,464円
純資産総額（ - ）	339,076,491,207円
発行済口数	142,608,117,935口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3777円
（1万口当たり純資産額）	（23,777円）

（参考）外国債券インデックス マザーファンド

（2019年 1月31日現在）

資産総額	247,638,183,590円
負債総額	71,936,267円
純資産総額（ - ）	247,566,247,323円
発行済口数	91,832,166,627口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6959円
（1万口当たり純資産額）	（26,959円）

（参考）新興国債券インデックス マザーファンド

（2019年 1月31日現在）

資産総額	47,316,985,976円
負債総額	6,692,412円
純資産総額（ - ）	47,310,293,564円
発行済口数	28,505,564,979口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6597円
（1万口当たり純資産額）	（16,597円）

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

（2019年 1月31日現在）

資産総額	107,863,827,465円
負債総額	854,827,106円
純資産総額（ - ）	107,009,000,359円
発行済口数	60,427,789,465口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7709円
（1万口当たり純資産額）	（17,709円）

（参考）グローバルREITインデックス マザーファンド

（2019年 1月31日現在）

資産総額	75,548,332,182円
負債総額	65,326,564円
純資産総額（ - ）	75,483,005,618円
発行済口数	41,813,208,732口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8052円
（1万口当たり純資産額）	（18,052円）

（参考）グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

（2019年 1月31日現在）

資産総額	21,778,062,241円
負債総額	85,155,986円
純資産総額（ - ）	21,692,906,255円
発行済口数	71,855,764,818口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3019円
（1万口当たり純資産額）	（3,019円）

（参考）ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

（2019年 1月31日現在）

資産総額	18,180,824,197円
負債総額	320,160,377円
純資産総額（ - ）	17,860,663,820円

発行済口数	18,246,236,136口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9789円
（1万口当たり純資産額）	（9,789円）

（参考）米国株式LSマザーファンド

（2019年1月31日現在）

資産総額	19,942,431,733円
負債総額	104,268,548円
純資産総額（ - ）	19,838,163,185円
発行済口数	19,247,053,295口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0307円
（1万口当たり純資産額）	（10,307円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

<訂正前>

(1)資本金の額（2018年10月1日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2018年10月9日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)資本金の額（2019年1月31日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2019年4月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 事業の内容及び営業の概況

<訂正前>

（前略）

2018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
単位型株式投資信託	65	222,303
単位型公社債投資信託	0	0
合計	567	9,995,414

<訂正後>

（前略）

2019年1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	532	11,462,075

追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	81	335,324
単位型公社債投資信託	0	0
合計	613	11,797,399

3 委託会社等の経理状況

<更新・訂正後>

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

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第33期事業年度の中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 貸借対照表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成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		
別途積立金		繰越利益 剰余金		

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
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 その他有価証券	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 その他有価証券	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

中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間末
(2018年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		23,034,588
預け金		1,999,987
未収委託者報酬		6,297,689
その他流動資産		160,541
流動資産合計		31,492,806
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	35,878
器具備品	1	94,797
その他有形固定資産	1	1,967
有形固定資産合計		132,642
無形固定資産		476,662
投資その他の資産		
投資有価証券		37,334
会員権		25,000
繰延税金資産		244,590

その他		4,358
投資その他の資産合計		311,284
固定資産合計		920,589
資産合計		32,413,396
負債の部		
流動負債		
未払金		3,522,021
未払費用		119,978
未払法人税等		768,587
賞与引当金		119,869
その他流動負債	2	107,652
流動負債合計		4,638,109
固定負債		
退職給付引当金		530,260
資産除去債務		13,489
その他固定負債		578
固定負債合計		544,327
負債合計		5,182,436

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		75,000
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		24,405,169
利益剰余金合計		26,580,169
株主資本合計		27,230,169
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		789
評価・換算差額等合計		789
純資産合計		27,230,959
負債・純資産合計		32,413,396

中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日)

至 2018年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		14,970,762
営業収益合計		14,970,762
営業費用		10,448,993
一般管理費	1	2,088,498
営業利益		2,433,271
営業外収益	2	23,558
営業外費用		8,748
経常利益		2,448,081
特別損失		49,894
税引前中間純利益		2,398,187
法人税、住民税及び事業税		726,276
法人税等調整額		3,774
法人税等合計		730,051
中間純利益		1,668,135

中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
中間純利益			1,668,135	1,668,135	1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	500	-	1,637,635	1,638,135	1,638,135
当中間期末残高	75,000	2,100,000	24,405,169	26,580,169	27,230,169

	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	182	182	25,592,216
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	607	607	607
当中間期変動額合計	607	607	1,638,742
当中間期末残高	789	789	27,230,959

重要な会計方針

第33期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
其他有価証券	
時価のあるもの	中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)
時価のないもの	移動平均法による原価法によっております。
2. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定額法によっております。
(2) 無形固定資産	定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
3. 引当金の計上基準	
(1) 貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
(2) 賞与引当金	従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。
(3) 退職給付引当金	従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	
消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
<p>有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016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）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法へ変更しております。</p> <p>この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。</p> <p>なお、この変更による当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に及ぼす影響は軽微であります。</p>

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
<p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。</p>

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間末 （2018年9月30日）									
1	有形固定資産の減価償却累計額								
	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 40px;">建 物</td> <td style="text-align: right;">66,454千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">342,351千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">その他有形固定資産</td> <td style="text-align: right;">3,136千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">411,942千円</td> </tr> </table>	建 物	66,454千円	器具備品	342,351千円	その他有形固定資産	3,136千円	計	411,942千円
建 物	66,454千円								
器具備品	342,351千円								
その他有形固定資産	3,136千円								
計	411,942千円								
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。								

（中間損益計算書関係）

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1	減価償却実施額		
	有形固定資産	19,715千円	
	無形固定資産	44,989千円	
2	営業外収益の主要項目		
	受取利息	819千円	
	貸倒引当金戻入	17,088千円	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018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）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

2018年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	23,034,588	23,034,588	-
(2)預け金	1,999,987	1,999,987	-
(3)未収委託者報酬	6,297,689	6,297,689	-
(4)投資有価証券 其他有価証券	37,331	37,331	-
(5)未払金	(3,522,021)	(3,522,021)	-
(6)未払法人税等	(768,587)	(768,587)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、(2)預け金、並びに(3)未収委託者報酬

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

(4)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。

(5)未払金、並びに(6)未払法人税等

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

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

その他有価証券

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他	21,579	19,493	2,085
小計	21,579	19,493	2,085
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	15,752	16,700	947
小計	15,752	16,700	947
合計	37,331	36,193	1,137

(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。

(デリバティブ取引関係)

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

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

(関連情報)

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第33期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第33期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第33期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第33期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1株当たり純資産額	9,076,986円44銭
1株当たり中間純利益	556,045円23銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第33期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
中間純利益	1,668,135千円
普通株式に係る中間純利益	1,668,135千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

(共通支配下の取引等)

1. 取引の概要

(1) 対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

(2) 企業結合日

2018年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社(当社の親会社の連結子会社)を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

(4) 結合後企業の名称
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

(5) その他取引の概要に関する事項
三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

2. 実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定であります。

(その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加)

当社は、2018年9月28日開催の臨時株主総会において、その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加について決議しており、2018年10月1日付で実行しております。

1. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の目的

資本規模の充実を図るため、会社法第450条第1項の規定に基づき、その他資本剰余金の額の減少を行い、その全額を資本金に組み入れることにしました。

2. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の要領

(1) 減少すべきその他資本剰余金の額

その他資本剰余金18,939,438千円のうち1,700,000千円を減少します。

(2) その他資本剰余金の額の減少方法

減少すべきその他資本剰余金の額の全額を資本金に組み入れます。
資本金の額は2,000,000千円になります。

5 その他

< 訂正前 >

(前略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2018年10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 >

(前略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2019年4月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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。

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月3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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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