【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2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　民野　誠
【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】	ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

SMT 国内債券インデックス・オープン

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（※）とします。

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

（5）【申込手数料】

取得申込受付日の基準価額に、2.2%（税抜　2.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

（6）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

（７）【申込期間】

2020年 2月11日から2020年 8月11日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

＜申込みコース＞

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

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

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

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】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、わが国の公社債に投資し、NOMURA－BPI総合に連動する投資成果を目指します。

＜信託金限度額＞

上限　3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（債券　一般）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （NOMURA－BPI総合）	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他 （　　）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

※属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（http://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

［投資対象地域による区分］

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

［独立した区分］

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

［補足分類］

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式
①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをい

う。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

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

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

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

(5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の

資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

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

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

(10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資形態による属性区分］

(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

［為替ヘッジによる属性区分］

(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

［特殊型］

(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

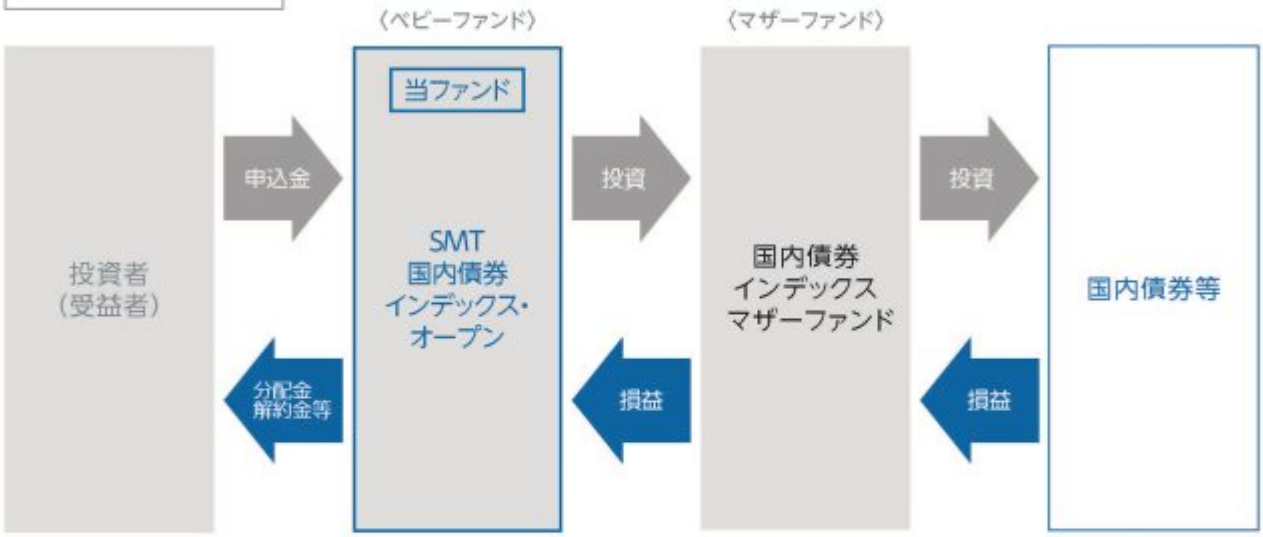
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

特色1 わが国の公社債を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

ファンドのしくみ



※各ファンドの純資産総額(2019年11月末現在)
ベビーファンド:231.44億円、マザーファンド:5,486.98億円

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。

〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内債券インデックス マザーファンド	わが国の公社債	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

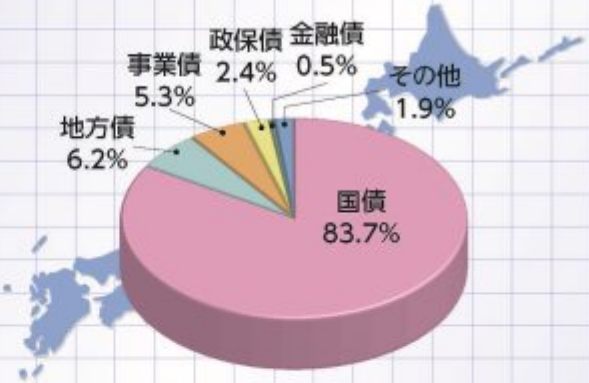
特色2 NOMURA−BPI総合に連動する投資成果を目指します。

NOMURA−BPI総合とは

インデックスの概要
(2019年11月末現在)

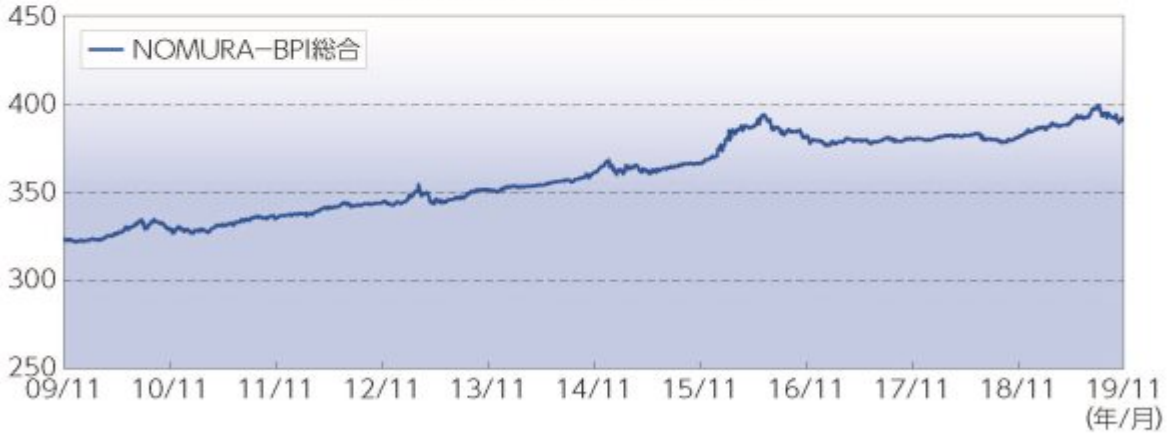
構成国	1ヵ国(日本)
構成銘柄数	13,565銘柄
時価総額	約1,072兆円

公社債種別構成比



ベンチマークの推移

(2009年11月末～2019年11月末)



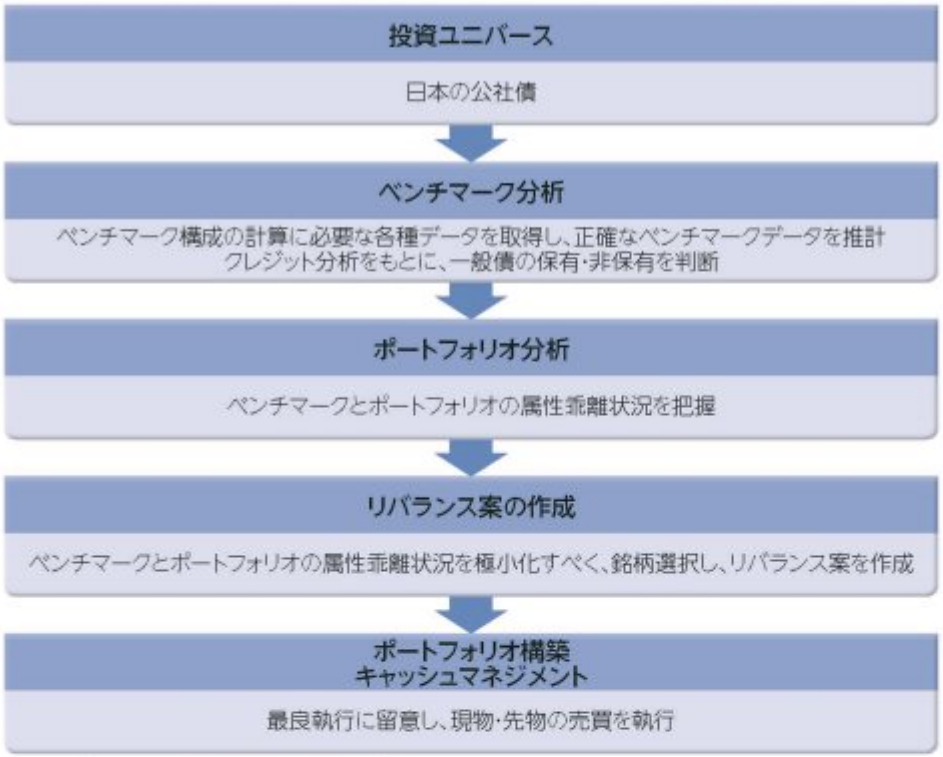
(出所)野村證券株式会社のデータをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

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

※「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。

※上記は過去のベンチマークデータをもとに作成したものであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、ファンドの運用状況を表したものではありません。

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

●年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●外貨建資産への投資は行いません。

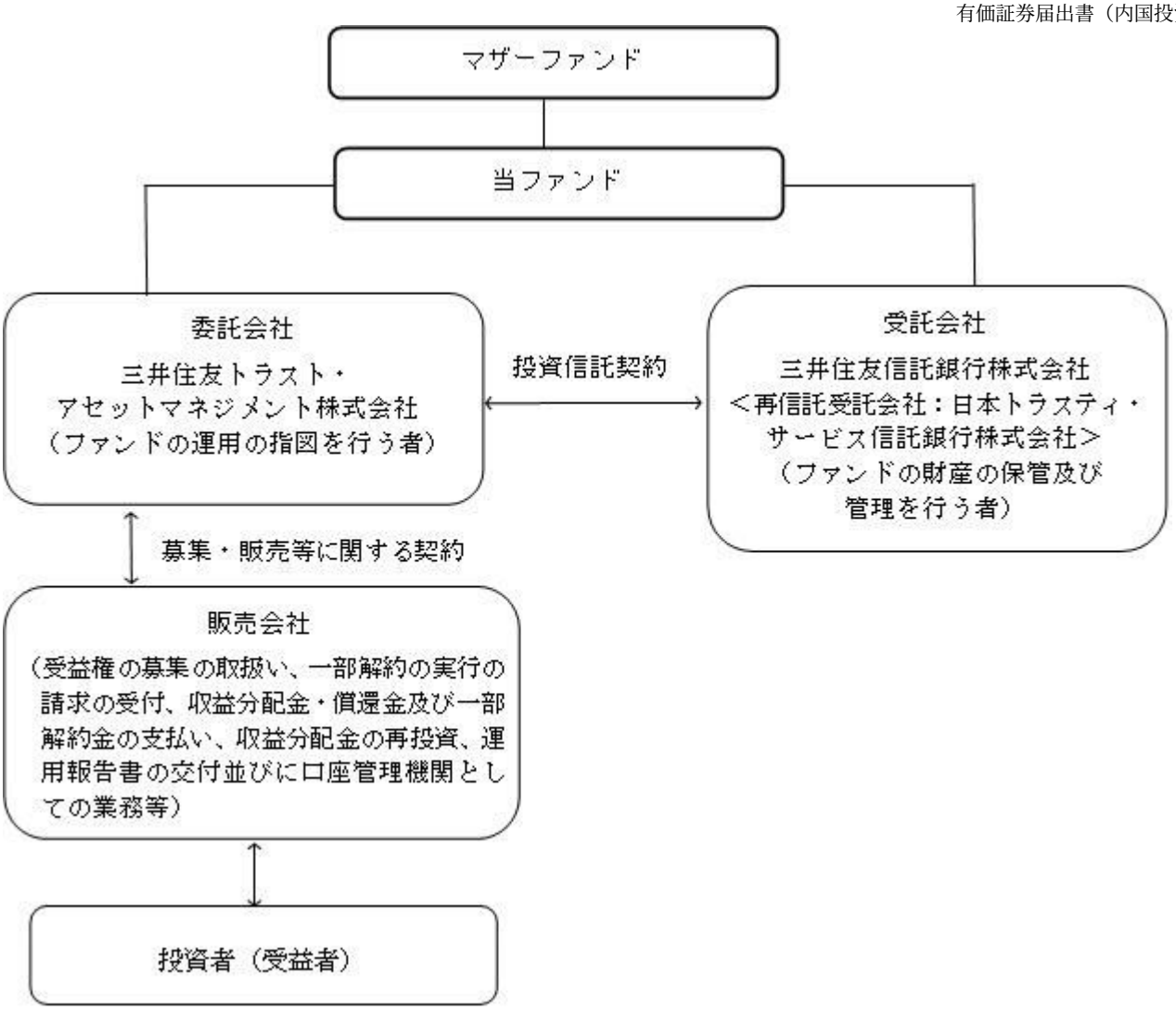
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2008年1月9日	**本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始**
2012年4月1日	**本ファンドの名称を「STAM 国内債券インデックス・オープン」から「SMT 国内債券インデックス・オープン」に変更** **本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に変更**

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2019年11月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
2007年9月30日：	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
2012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
2018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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

（イ）基本方針

本ファンドは、主として「国内債券インデックス マザーファンド」（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じてわが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA－BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

（ロ）運用方法

①投資対象

マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の公社債に直接投資することもあります。

②投資態度

1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、NOMURA－BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

3)国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

4)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

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

（2）【投資対象】

（イ）本ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1.株券または新株引受権証書

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

（ハ）委託者は、信託金を、前記（ロ）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1.預金
2.指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形
5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（ニ）前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記（ハ）第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA－BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

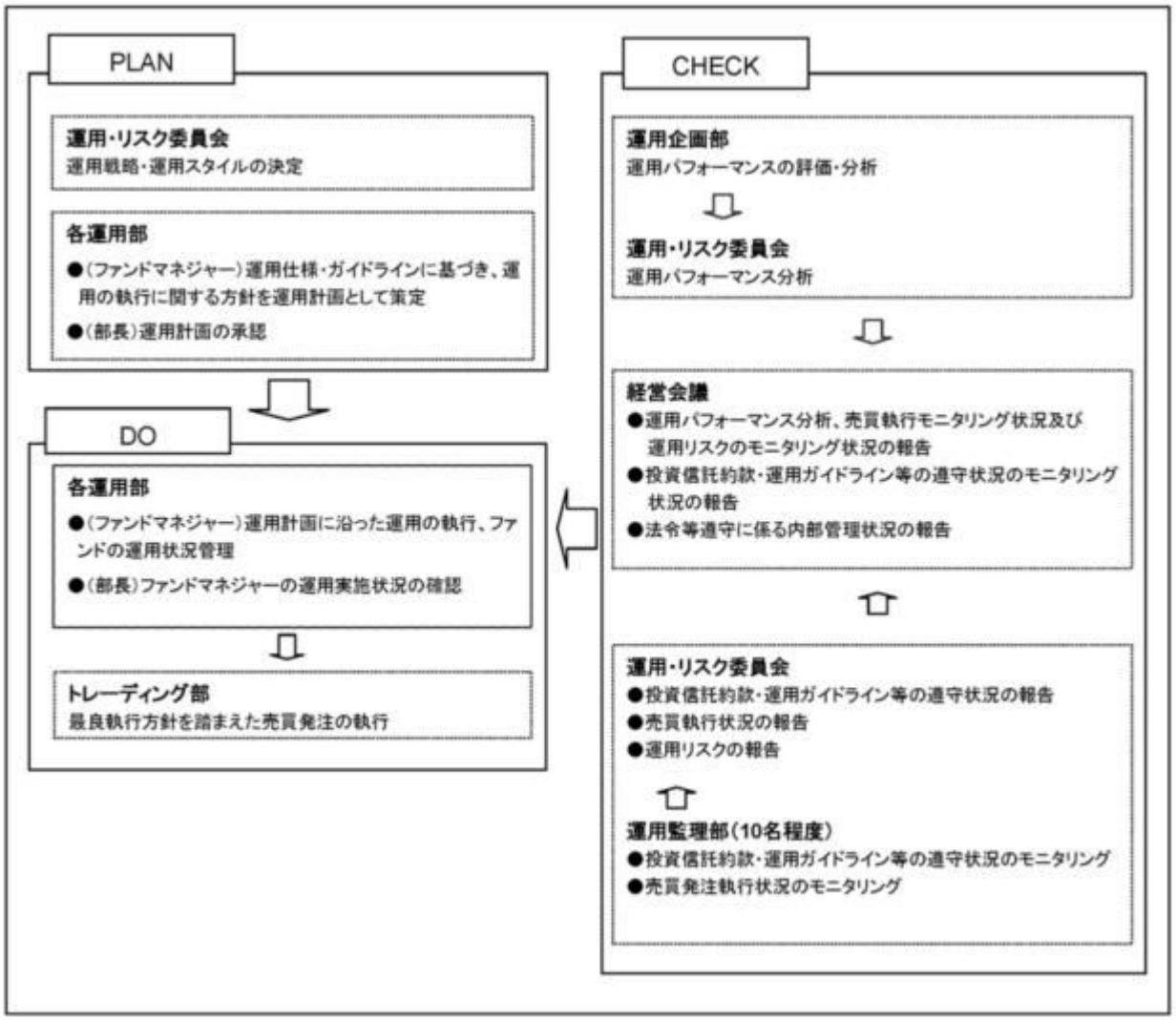
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率

以内となるよう調整を行うこととします。

⑤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。

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

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

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

①株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
②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、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
④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、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑤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、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑦外貨建資産への投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑧委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）
⑨委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1.投資信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2.株式分割により取得する株券
3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券
5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6.投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第5号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑩委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。また、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）

⑪委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）

⑫委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。また、金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

⑬委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第26条）

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

⑭委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買

戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第27条）

⑮委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第28条）

⑯委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第34条）

⑰一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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑱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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引およ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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

※前記①から⑥における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記①から⑥に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記⑪および⑫における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①金利変動リスク
債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

②信用リスク
有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

③流動性リスク
時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①ファンドは、NOMURA－BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。
②同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
③分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
④ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

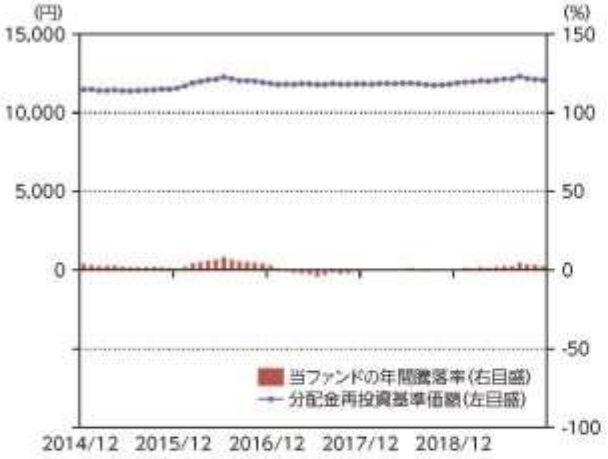
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

・運用部門から独立した運用監理部が、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



＊当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

＊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12月～2019年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

＊当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	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・運用に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	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。
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)	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。
日本国債 NOMURA-BPI国債	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。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	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。
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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	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諾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.

(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。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込受付日の基準価額に、2.2%（税抜　2.0%）（※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。）。

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

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

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞
ありません。
＜信託財産留保額＞
ご解約時には、解約請求受付日の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.407%（税抜　0.37%）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.165%　（税抜　0.15%）	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　0.198%　（税抜　0.18%）	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　0.044%　（税抜　0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

②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。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税
収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税　率（内　訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）
ロ．一部解約金及び償還金に対する課税
一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。
ハ．損益通算について
一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離

課税を選択したものに限ります。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

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

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

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

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税　率　（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2019年11月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2019年11月29日現在の状況について記載してあります。

【ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	23,131,966,753	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	11,576,555	0.05
合計(純資産総額)		23,143,543,308	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【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	国内債券インデックス　マザーファンド	16,231,820,050	1.4209	23,064,882,864	1.4251	23,131,966,753	99.95

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末 (2010年 5月10日)	1,289,313,952	1,289,313,952	10,427	10,427
第6期計算期間末 (2010年11月10日)	1,712,750,650	1,712,750,650	10,608	10,608
第7期計算期間末 (2011年 5月10日)	1,945,332,716	1,945,332,716	10,577	10,577
第8期計算期間末 (2011年11月10日)	2,259,444,456	2,259,444,456	10,719	10,719
第9期計算期間末 (2012年 5月10日)	2,463,198,717	2,463,198,717	10,833	10,833
第10期計算期間末 (2012年11月12日)	3,066,664,253	3,066,664,253	10,924	10,924
第11期計算期間末 (2013年 5月10日)	3,739,483,572	3,739,483,572	11,008	11,008
第12期計算期間末 (2013年11月11日)	4,211,448,426	4,211,448,426	11,126	11,126
第13期計算期間末 (2014年 5月12日)	5,616,910,509	5,616,910,509	11,158	11,158
第14期計算期間末 (2014年11月10日)	7,342,793,395	7,342,793,395	11,332	11,332
第15期計算期間末 (2015年 5月11日)	8,940,681,279	8,940,681,279	11,405	11,405
第16期計算期間末 (2015年11月10日)	9,689,682,166	9,689,682,166	11,490	11,490
第17期計算期間末 (2016年 5月10日)	11,128,827,418	11,128,827,418	12,117	12,117
第18期計算期間末 (2016年11月10日)	11,429,906,685	11,429,906,685	12,004	12,004
第19期計算期間末 (2017年 5月10日)	12,705,311,972	12,705,311,972	11,828	11,828
第20期計算期間末 (2017年11月10日)	14,469,503,805	14,469,503,805	11,839	11,839
第21期計算期間末 (2018年 5月10日)	16,625,312,200	16,625,312,200	11,867	11,867
第22期計算期間末 (2018年11月12日)	19,721,627,990	19,721,627,990	11,773	11,773
第23期計算期間末 (2019年 5月10日)	21,550,239,467	21,550,239,467	12,016	12,016
第24期計算期間末 (2019年11月11日)	23,056,782,675	23,056,782,675	12,047	12,047
2018年11月末日	20,037,010,431	—	11,820	—
12月末日	20,357,553,407	—	11,903	—
2019年 1月末日	20,506,268,760	—	11,948	—
2月末日	20,614,602,343	—	11,969	—
3月末日	21,464,234,304	—	12,048	—
4月末日	21,464,648,620	—	12,006	—
5月末日	21,680,879,867	—	12,078	—
6月末日	21,591,667,311	—	12,146	—
7月末日	22,089,281,756	—	12,155	—
8月末日	22,281,351,588	—	12,314	—
9月末日	22,446,466,609	—	12,179	—
10月末日	23,088,101,341	—	12,126	—
11月末日	23,143,543,308	—	12,079	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2009年11月11日～2010年 5月10日	0
第6期計算期間	2010年 5月11日～2010年11月10日	0

第7期計算期間	2010年11月11日～2011年 5月10日	0
第8期計算期間	2011年 5月11日～2011年11月10日	0
第9期計算期間	2011年11月11日～2012年 5月10日	0
第10期計算期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	0
第11期計算期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	0
第12期計算期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	0
第13期計算期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	0
第14期計算期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	0
第15期計算期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	0
第16期計算期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	0
第17期計算期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	0
第18期計算期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	0
第19期計算期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	0
第20期計算期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	0
第21期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第22期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0
第23期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0
第24期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第5期計算期間	2009年11月11日～2010年 5月10日	1.7
第6期計算期間	2010年 5月11日～2010年11月10日	1.7
第7期計算期間	2010年11月11日～2011年 5月10日	△0.3
第8期計算期間	2011年 5月11日～2011年11月10日	1.3
第9期計算期間	2011年11月11日～2012年 5月10日	1.1
第10期計算期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	0.8
第11期計算期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	0.8
第12期計算期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	1.1
第13期計算期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	0.3
第14期計算期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	1.6
第15期計算期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	0.6
第16期計算期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	0.7
第17期計算期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	5.5
第18期計算期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	△0.9
第19期計算期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	△1.5
第20期計算期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	0.1
第21期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.2
第22期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	△0.8
第23期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	2.1

第24期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5期計算期間	2009年11月11日～2010年 5月10日	498,829,147	269,130,786	1,236,486,970
第6期計算期間	2010年 5月11日～2010年11月10日	621,066,652	242,915,458	1,614,638,164
第7期計算期間	2010年11月11日～2011年 5月10日	732,650,786	508,108,928	1,839,180,022
第8期計算期間	2011年 5月11日～2011年11月10日	547,586,954	278,845,259	2,107,921,717
第9期計算期間	2011年11月11日～2012年 5月10日	736,294,422	570,398,071	2,273,818,068
第10期計算期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	964,878,664	431,308,207	2,807,388,525
第11期計算期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	1,400,258,994	810,645,144	3,397,002,375
第12期計算期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	1,124,387,822	736,211,347	3,785,178,850
第13期計算期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	1,936,022,808	687,183,520	5,034,018,138
第14期計算期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	2,391,400,106	945,500,253	6,479,917,991
第15期計算期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	3,282,806,865	1,923,453,760	7,839,271,096
第16期計算期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	2,166,687,541	1,572,588,079	8,433,370,558
第17期計算期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	2,578,229,241	1,827,449,643	9,184,150,156
第18期計算期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	1,781,940,704	1,444,677,700	9,521,413,160
第19期計算期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	2,502,734,797	1,282,205,749	10,741,942,208
第20期計算期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	3,658,253,620	2,177,979,358	12,222,216,470
第21期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	4,100,925,368	2,313,439,170	14,009,702,668
第22期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	4,821,613,379	2,080,391,932	16,750,924,115
第23期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	3,528,658,228	2,344,496,472	17,935,085,871
第24期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	3,925,958,702	2,722,002,352	19,139,042,221

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

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	456,973,896,800	83.28
地方債証券	日本	29,410,393,434	5.36
特殊債券	日本	37,868,858,098	6.90
社債券	日本	20,054,367,970	3.65

	フランス	1,599,637,000	0.29
	オーストラリア	701,358,000	0.13
	アメリカ	209,108,000	0.04
	イギリス	100,418,000	0.02
	小計	22,664,888,970	4.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,779,897,592	0.32
合計(純資産総額)		548,697,934,894	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	日本	153,160,000	0.03

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	9,710,000,000	101.37	9,843,793,200	101.18	9,824,869,300	0.100	2023/12/20	1.79
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	7,340,000,000	101.99	7,486,099,800	101.30	7,435,933,800	0.100	2024/6/20	1.36
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	6,840,000,000	103.04	7,047,952,000	101.92	6,971,806,800	0.100	2029/6/20	1.27
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,830,000,000	101.59	6,938,836,600	101.11	6,905,813,000	0.100	2023/9/20	1.26
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	6,550,000,000	102.61	6,721,481,900	102.27	6,698,750,500	0.100	2028/3/20	1.22
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	6,460,000,000	102.39	6,614,812,400	101.91	6,583,515,200	0.100	2026/3/20	1.20
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	103.52	6,542,464,000	0.400	2025/9/20	1.19
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	5,890,000,000	103.97	6,124,268,300	103.36	6,088,257,400	0.400	2025/6/20	1.11
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	5,970,000,000	101.28	6,046,822,900	100.95	6,026,774,700	0.100	2022/12/20	1.10
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	5,600,000,000	101.20	5,667,200,000	101.09	5,661,040,000	0.100	2023/6/20	1.03
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	5,580,000,000	101.13	5,643,054,000	101.01	5,636,469,600	0.100	2023/3/20	1.03

日本	国債証券	第１３１回利付国債（５年）	5,540,000,000	100.81	5,585,261,800	100.66	5,577,007,200	0.100	2022/3/20	1.02
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	4,960,000,000	102.47	5,082,550,600	102.03	5,060,787,200	0.100	2026/9/20	0.92
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,890,000,000	102.42	5,008,771,900	102.13	4,994,548,200	0.100	2028/9/20	0.91
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	4,870,000,000	101.51	4,943,537,000	101.25	4,931,167,200	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	4,870,000,000	100.89	4,913,579,300	100.75	4,906,768,500	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第１２７回利付国債（５年）	4,780,000,000	100.50	4,804,234,600	100.35	4,796,730,000	0.100	2021/3/20	0.87
日本	国債証券	第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	102.41	4,680,411,200	1.000	2021/12/20	0.85
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,490,000,000	102.03	4,581,457,900	102.10	4,584,559,400	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	4,410,000,000	101.45	4,474,347,300	101.38	4,470,858,000	0.100	2024/9/20	0.81
日本	国債証券	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	100.98	4,422,924,000	100.90	4,419,463,800	0.100	2022/9/20	0.81
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,110,000,000	103.24	4,243,537,400	102.29	4,204,365,600	0.100	2027/9/20	0.77
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	3,940,000,000	102.12	4,023,833,200	102.02	4,019,588,000	0.100	2029/3/20	0.73
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	3,270,000,000	120.55	3,942,310,900	120.33	3,934,889,100	1.500	2034/6/20	0.72
日本	国債証券	第４０３回利付国債（２年）	3,770,000,000	100.80	3,800,271,400	100.47	3,787,907,500	0.100	2021/8/1	0.69
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	3,620,000,000	103.72	3,754,953,600	103.34	3,740,980,400	0.500	2024/9/20	0.68
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	3,590,000,000	102.46	3,678,361,000	102.20	3,669,267,200	0.100	2028/6/20	0.67
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	3,430,000,000	103.28	3,542,778,400	103.06	3,534,992,300	0.300	2025/12/20	0.64
日本	国債証券	第４０１回利付国債（２年）	3,460,000,000	100.59	3,480,483,800	100.41	3,474,497,400	0.100	2021/6/1	0.63
日本	国債証券	第３９８回利付国債（２年）	3,460,000,000	100.47	3,476,284,000	100.34	3,471,833,200	0.100	2021/3/1	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	83.28
地方債証券	5.36
特殊債券	6.90
社債券	4.13
合計	99.68

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1	円	153,320,330	153,160,000	0.03

(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。

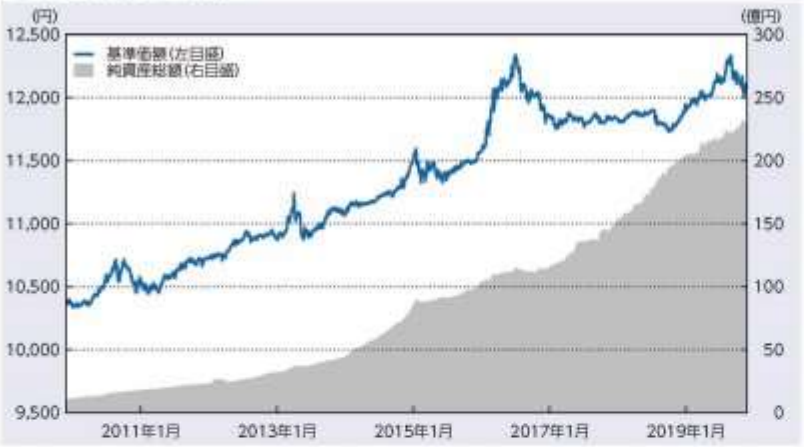
≪参考情報≫

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：2008年１月９日
作成基準日：2019年11月29日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	12,079円
純資産総額	231.44億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2017年11月	0円
2018年５月	0円
2018年11月	0円
2019年５月	0円
2019年11月	0円
設定来分配金合計額	0円

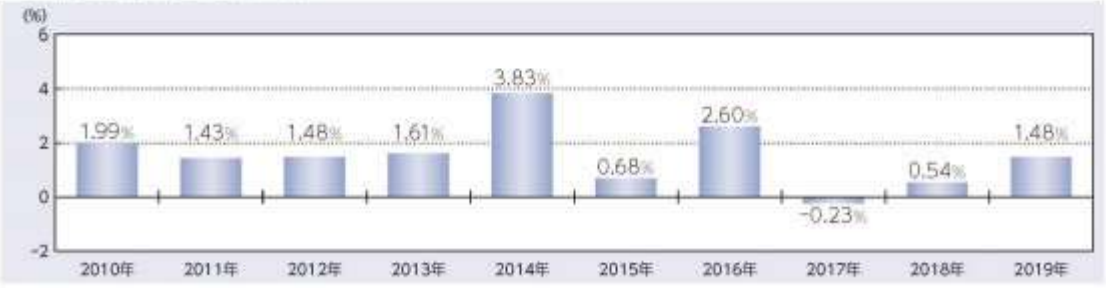
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国／地域	種類	利率	償還期限	実質投資比率
第138回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2023/12/20	1.8%
第140回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2024/06/20	1.4%
第355回利付国債(10年)	日本	国債	0.1%	2029/06/20	1.3%
第137回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2023/09/20	1.3%
第350回利付国債(10年)	日本	国債	0.1%	2028/03/20	1.2%
第342回利付国債(10年)	日本	国債	0.1%	2026/03/20	1.2%
第340回利付国債(10年)	日本	国債	0.4%	2025/09/20	1.2%
第339回利付国債(10年)	日本	国債	0.4%	2025/06/20	1.1%
第134回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2022/12/20	1.1%
第136回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2023/06/20	1.0%

※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）



※2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

ありません。

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

＜受付不可日＞

ありません。

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場

合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象である公社債の評価方法

原則として、次のいずれかから入手した価額で評価します。

1)日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

2)価格情報会社の提供する価額

3)金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2008年 1月 9日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年5月11日から11月10日までおよび11月11日から翌年5月10日までとします。（第1計算期間は、2008年1月9日から2008年5月12日までとします。）

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監

督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託

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

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第24期計算期間(2019年5月11日から2019年11月11日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第23期 （2019年 5月10日現在）	第24期 （2019年11月11日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	75,465,946	106,900,124
親投資信託受益証券	21,539,462,931	23,045,260,204
未収入金	13,629,116	12,571,859
流動資産合計	21,628,557,993	23,164,732,187
資産合計	21,628,557,993	23,164,732,187
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,369,866	62,484,463
未払受託者報酬	4,367,818	4,849,595
未払委託者報酬	36,034,415	40,009,079
未払利息	105	238
その他未払費用	546,322	606,137
流動負債合計	78,318,526	107,949,512
負債合計	78,318,526	107,949,512
純資産の部		
元本等		
元本	17,935,085,871	19,139,042,221
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,615,153,596	3,917,740,454
（分配準備積立金）	468,927,816	444,521,539
元本等合計	21,550,239,467	23,056,782,675
純資産合計	21,550,239,467	23,056,782,675
負債純資産合計	21,628,557,993	23,164,732,187

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期 自　2018年11月13日 至　2019年 5月10日	第24期 自　2019年 5月11日 至　2019年11月11日
営業収益		
受取利息	7	16
有価証券売買等損益	452,843,668	90,107,702
営業収益合計	452,843,675	90,107,718
営業費用		
支払利息	24,226	22,403
受託者報酬	4,367,818	4,849,595
委託者報酬	36,034,415	40,009,079
その他費用	548,557	606,185
営業費用合計	40,975,016	45,487,262
営業利益又は営業損失（△）	411,868,659	44,620,456
経常利益又は経常損失（△）	411,868,659	44,620,456
当期純利益又は当期純損失（△）	411,868,659	44,620,456
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	37,442,302	36,189,841
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,970,703,875	3,615,153,596
剰余金増加額又は欠損金減少額	688,051,245	844,424,462
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	688,051,245	844,424,462
剰余金減少額又は欠損金増加額	418,027,881	550,268,219
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	418,027,881	550,268,219
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,615,153,596	3,917,740,454

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月11日から11月10日まで、及び11月11日から翌年5月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第24期計算期間は2019年 5月11日から2019年11月11日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第23期 (2019年 5月10日現在)	第24期 (2019年11月11日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	17,935,085,871口	19,139,042,221口
２. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2016円 (1万口当たり純資産額) (12,016円)	1口当たり純資産額 1.2047円 (1万口当たり純資産額) (12,047円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第23期
自 2018年11月13日
至 2019年 5月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	74,978,874円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	3,151,873,083円
分配準備積立金額	D	393,948,942円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,620,800,899円
当ファンドの期末残存口数	F	17,935,085,871口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,018円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第24期
自 2019年 5月11日
至 2019年11月11日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	40,046,647円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	3,473,218,915円
分配準備積立金額	D	404,474,892円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,917,740,454円
当ファンドの期末残存口数	F	19,139,042,221口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,046円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第24期 自 2019年 5月11日 至 2019年11月11日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第24期 (2019年11月11日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第23期 自 2018年11月13日 至 2019年 5月10日	第24期 自 2019年 5月11日 至 2019年11月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	16,750,924,115円	17,935,085,871円
期中追加設定元本額	3,528,658,228円	3,925,958,702円
期中一部解約元本額	2,344,496,472円	2,722,002,352円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第23期 (2019年 5月10日現在)	第24期 (2019年11月11日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	449,214,674	87,575,231
合計	449,214,674	87,575,231

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内債券インデックス　マザーファンド	16,217,635,612	23,045,260,204	
合計		16,217,635,612	23,045,260,204	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年11月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	463,584,390
国債証券	454,389,855,700
地方債証券	28,980,144,518
特殊債券	37,656,629,556
社債券	22,426,856,690
未収利息	963,441,888
前払費用	67,756,218
流動資産合計	544,948,268,960
資産合計	544,948,268,960
負債の部	
流動負債	
未払解約金	170,039,306
未払利息	1,033
流動負債合計	170,040,339
負債合計	170,040,339
純資産の部	
元本等	
元本	383,388,386,551
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	161,389,842,070
元本等合計	544,778,228,621

	2019年11月11日現在
項目	金額（円）
純資産合計	544,778,228,621
負債純資産合計	544,948,268,960

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年11月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年11月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	383,388,386,551口
2.	担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
		有価証券　102,114,000円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　1.4210円
		(1万口当たり純資産額)　(14,210円)

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2019年11月11日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月11日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	323,053,631,511円
期中追加設定元本額	69,145,686,993円
期中一部解約元本額	8,810,931,953円
期末元本額	383,388,386,551円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,886,598,375円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,094,623円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	16,217,635,612円
世界経済インデックスファンド	1,871,612,724円
ＤＣマイセレクション２５	20,652,257,059円
ＤＣマイセレクション５０	22,450,147,202円
ＤＣマイセレクション７５	6,037,032,858円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	466,191,154円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	87,425,895,071円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,859,727,453円
ＤＣマイセレクションＳ２５	8,432,614,464円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,169,496,432円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,748,875,442円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,098,557,870円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,321,004,045円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	444,595,437円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	1,678,420,933円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	68,600,655円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,467,901円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	43,537,426円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	14,180,873円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	936,306円

区分	2019年11月11日現在
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	163,688,329円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	277,388,058円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	60,737,829円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	136,848,775円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,160,349,363円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	929,797,421円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,518,017,394円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	813,639,053円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	98,686,012円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,213,168,528円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	27,939,515円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,388,530,116円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,775,491,885円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	162,640,095円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	6,283,800,135円
日本債券ファンド・シリーズ１	10,750,577,904円
分散投資コア戦略ファンドＡ	11,119,221,758円
分散投資コア戦略ファンドＳ	9,240,772,765円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	69,591,922円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	824,595,419円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	49,018,766円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,613,846円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	62,178,364円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	12,147,720円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	12,350,425円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	25,389,893円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,478,881円
グローバル経済コア	207,827,251円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,115,043円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	811,672円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	18,784円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	14,886円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	10,633円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	7,089円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	78,046,213,867円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△2,533,160,400

地方債証券	△75,960,781
特殊債券	△152,921,391
社債券	△56,889,520
合計	△2,818,932,092

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス　マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第３９５回利付国債（２年）	560,000,000	561,708,000	
	第３９６回利付国債（２年）	1,710,000,000	1,715,643,000	
	第３９７回利付国債（２年）	1,600,000,000	1,605,680,000	
	第３９８回利付国債（２年）	3,460,000,000	3,473,286,400	
	第３９９回利付国債（２年）	3,100,000,000	3,112,679,000	
	第４００回利付国債（２年）	630,000,000	632,683,800	
	第４０１回利付国債（２年）	3,460,000,000	3,475,327,800	
	第４０２回利付国債（２年）	620,000,000	622,889,200	
	第４０３回利付国債（２年）	3,770,000,000	3,788,510,700	
	第４０４回利付国債（２年）	360,000,000	361,886,400	
	第４０５回利付国債（２年）	100,000,000	100,558,000	
	第４０６回利付国債（２年）	120,000,000	120,699,600	
	第１２６回利付国債（５年）	2,960,000,000	2,969,472,000	
	第１２７回利付国債（５年）	4,780,000,000	4,798,737,600	
	第１２８回利付国債（５年）	1,610,000,000	1,617,373,800	
	第１２９回利付国債（５年）	3,340,000,000	3,357,702,000	
	第１３０回利付国債（５年）	3,160,000,000	3,179,686,800	
	第１３１回利付国債（５年）	5,540,000,000	5,579,223,200	
	第１３２回利付国債（５年）	4,870,000,000	4,908,180,800	
	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,417,711,800	

第１３４回利付国債（５年）	5,970,000,000	6,025,938,900	
第１３５回利付国債（５年）	5,680,000,000	5,737,424,800	
第１３６回利付国債（５年）	5,900,000,000	5,964,192,000	
第１３７回利付国債（５年）	6,830,000,000	6,909,569,500	
第１３８回利付国債（５年）	9,710,000,000	9,830,501,100	
第１３９回利付国債（５年）	4,870,000,000	4,934,089,200	
第１４０回利付国債（５年）	7,340,000,000	7,440,558,000	
第１４１回利付国債（５年）	1,050,000,000	1,065,172,500	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	609,916,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,675,258,900	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	822,393,000	
第４回利付国債（４０年）	1,000,000,000	1,509,840,000	
第５回利付国債（４０年）	890,000,000	1,301,616,100	
第６回利付国債（４０年）	1,620,000,000	2,338,470,000	
第７回利付国債（４０年）	830,000,000	1,154,123,300	
第８回利付国債（４０年）	800,000,000	1,041,312,000	
第９回利付国債（４０年）	1,170,000,000	1,141,019,100	
第１０回利付国債（４０年）	1,920,000,000	2,196,268,800	
第１１回利付国債（４０年）	1,730,000,000	1,924,884,500	
第１２回利付国債（４０年）	820,000,000	825,420,200	
第３１２回利付国債（１０年）	3,810,000,000	3,868,559,700	
第３１３回利付国債（１０年）	1,350,000,000	1,377,229,500	
第３１４回利付国債（１０年）	470,000,000	478,206,200	
第３１５回利付国債（１０年）	3,140,000,000	3,209,896,400	
第３１６回利付国債（１０年）	1,170,000,000	1,194,160,500	
第３１７回利付国債（１０年）	890,000,000	911,279,900	
第３１８回利付国債（１０年）	1,960,000,000	2,003,218,000	
第３１９回利付国債（１０年）	1,710,000,000	1,756,597,500	
第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	4,684,844,100	
第３２１回利付国債（１０年）	2,470,000,000	2,539,703,400	
第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	769,387,500	
第３２３回利付国債（１０年）	970,000,000	997,780,800	
第３２４回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,811,294,800	
第３２５回利付国債（１０年）	2,920,000,000	3,003,395,200	
第３２６回利付国債（１０年）	1,660,000,000	1,706,397,000	
第３２７回利付国債（１０年）	1,610,000,000	1,660,022,700	
第３２８回利付国債（１０年）	2,770,000,000	2,844,263,700	
第３２９回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,330,797,500	
第３３０回利付国債（１０年）	1,690,000,000	1,755,301,600	
第３３１回利付国債（１０年）	1,380,000,000	1,422,600,600	
第３３２回利付国債（１０年）	3,250,000,000	3,356,892,500	
第３３３回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,411,270,400	

第３３４回利付国債（１０年）	2,790,000,000	2,893,006,800	
第３３５回利付国債（１０年）	3,620,000,000	3,743,297,200	
第３３６回利付国債（１０年）	510,000,000	528,405,900	
第３３７回利付国債（１０年）	3,380,000,000	3,467,136,400	
第３３８回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,529,502,500	
第３３９回利付国債（１０年）	5,890,000,000	6,090,201,100	
第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	6,544,612,800	
第３４１回利付国債（１０年）	3,430,000,000	3,534,855,100	
第３４２回利付国債（１０年）	5,760,000,000	5,867,366,400	
第３４３回利付国債（１０年）	3,200,000,000	3,262,048,000	
第３４４回利付国債（１０年）	3,620,000,000	3,692,906,800	
第３４５回利付国債（１０年）	2,290,000,000	2,336,967,900	
第３４６回利付国債（１０年）	3,360,000,000	3,430,056,000	
第３４７回利付国債（１０年）	2,270,000,000	2,318,078,600	
第３４８回利付国債（１０年）	4,110,000,000	4,198,323,900	
第３４９回利付国債（１０年）	3,090,000,000	3,157,238,400	
第３５０回利付国債（１０年）	6,550,000,000	6,688,467,000	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	3,830,000,000	3,910,008,700	
第３５２回利付国債（１０年）	4,890,000,000	4,988,484,600	
第３５３回利付国債（１０年）	4,490,000,000	4,576,701,900	
第３５４回利付国債（１０年）	3,940,000,000	4,012,456,600	
第３５５回利付国債（１０年）	7,040,000,000	7,162,566,400	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	141,187,200	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	200,377,600	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	149,578,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	145,319,900	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	62,633,500	
第６回利付国債（３０年）	190,000,000	244,085,400	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	230,524,200	
第８回利付国債（３０年）	100,000,000	122,491,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	281,630,400	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	181,676,800	
第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	109,619,100	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	242,259,500	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	366,887,700	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	397,617,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	456,783,200	
第１６回利付国債（３０年）	370,000,000	498,519,500	
第１７回利付国債（３０年）	570,000,000	762,232,500	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	457,673,550	
第１９回利付国債（３０年）	380,000,000	505,327,800	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	654,686,400	

第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	667,985,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	548,700,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	591,297,300	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	524,213,800	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	472,335,500	
第２６回利付国債（３０年）	530,000,000	725,522,300	
第２７回利付国債（３０年）	1,010,000,000	1,406,818,900	
第２８回利付国債（３０年）	1,640,000,000	2,295,491,600	
第２９回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,943,718,000	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,435,236,800	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,502,897,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,700,000,000	2,367,998,000	
第３３回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,235,979,700	
第３４回利付国債（３０年）	1,585,000,000	2,195,874,850	
第３５回利付国債（３０年）	2,190,000,000	2,956,609,500	
第３６回利付国債（３０年）	1,980,000,000	2,685,038,400	
第３７回利付国債（３０年）	1,830,000,000	2,450,992,200	
第３８回利付国債（３０年）	1,250,000,000	1,653,737,500	
第３９回利付国債（３０年）	900,000,000	1,213,389,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,290,000,000	1,713,132,900	
第４１回利付国債（３０年）	930,000,000	1,215,835,500	
第４２回利付国債（３０年）	1,230,000,000	1,609,811,700	
第４３回利付国債（３０年）	910,000,000	1,192,327,500	
第４４回利付国債（３０年）	1,080,000,000	1,418,245,200	
第４５回利付国債（３０年）	1,210,000,000	1,532,876,400	
第４６回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,954,645,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,994,654,200	
第４８回利付国債（３０年）	1,710,000,000	2,133,156,600	
第４９回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,822,313,600	
第５０回利付国債（３０年）	1,070,000,000	1,176,229,600	
第５１回利付国債（３０年）	1,840,000,000	1,791,442,400	
第５２回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,575,420,000	
第５３回利付国債（３０年）	1,120,000,000	1,174,768,000	
第５４回利付国債（３０年）	1,850,000,000	2,034,926,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,143,407,200	
第５６回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,384,576,200	
第５７回利付国債（３０年）	1,360,000,000	1,493,660,800	
第５８回利付国債（３０年）	1,420,000,000	1,558,663,000	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	182,153,300	
第６０回利付国債（３０年）	2,530,000,000	2,846,174,100	
第６１回利付国債（３０年）	1,300,000,000	1,390,792,000	
第６２回利付国債（３０年）	480,000,000	487,483,200	
第６３回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,324,214,800	

第６４回利付国債（３０年）	350,000,000	345,394,000	
第４８回利付国債（２０年）	130,000,000	133,877,900	
第４９回利付国債（２０年）	140,000,000	144,358,200	
第５０回利付国債（２０年）	220,000,000	226,250,200	
第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	103,518,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	114,673,900	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	83,869,600	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	210,098,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	147,264,600	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	158,613,000	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	253,152,000	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	318,042,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	211,836,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	367,433,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	249,672,000	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	331,491,200	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	214,398,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	345,968,000	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	239,019,000	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	357,162,300	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	141,918,400	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	209,919,600	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	429,179,400	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	448,000,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	222,142,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	700,515,900	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	400,737,600	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	223,662,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	146,131,700	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	300,582,900	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	324,417,200	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	190,173,900	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	303,569,100	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	248,600,000	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	440,567,400	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	681,348,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	330,910,300	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	533,398,300	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	332,473,400	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	243,455,100	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	634,089,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	489,598,200	

第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	405,660,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	734,063,400	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	527,454,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	1,024,012,000	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	476,223,200	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	713,071,700	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	725,765,800	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,867,264,200	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	475,092,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	519,098,800	
第９９回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,362,830,500	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	575,145,600	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	868,810,800	
第１０２回利付国債（２０年）	410,000,000	500,245,100	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	484,564,000	
第１０４回利付国債（２０年）	360,000,000	429,843,600	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,414,442,400	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	458,899,400	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	312,696,800	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	781,631,400	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	617,578,000	
第１１０回利付国債（２０年）	950,000,000	1,146,184,500	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,183,438,800	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	956,192,300	
第１１３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,762,228,500	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,840,176,800	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	860,384,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,306,778,600	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,320,213,600	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	802,507,200	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	633,159,200	
第１２０回利付国債（２０年）	790,000,000	926,962,300	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,813,290,000	
第１２２回利付国債（２０年）	440,000,000	527,111,200	
第１２３回利付国債（２０年）	830,000,000	1,024,676,500	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	746,298,400	
第１２５回利付国債（２０年）	820,000,000	1,024,762,200	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	895,717,300	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,239,973,200	
第１２８回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,535,977,800	
第１２９回利付国債（２０年）	1,350,000,000	1,630,044,000	
第１３０回利付国債（２０年）	1,115,000,000	1,349,718,650	
第１３１回利付国債（２０年）	870,000,000	1,042,851,600	

	第１３２回利付国債（２０年）	840,000,000	1,009,176,000	
	第１３３回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,444,017,400	
	第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,374,419,000	
	第１３５回利付国債（２０年）	590,000,000	710,365,900	
	第１３６回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,751,828,400	
	第１３７回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,351,436,800	
	第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	732,585,800	
	第１３９回利付国債（２０年）	550,000,000	656,760,500	
	第１４０回利付国債（２０年）	1,840,000,000	2,226,344,800	
	第１４１回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,921,980,400	
	第１４２回利付国債（２０年）	540,000,000	661,732,200	
	第１４３回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,357,774,100	
	第１４４回利付国債（２０年）	1,740,000,000	2,067,746,400	
	第１４５回利付国債（２０年）	2,155,000,000	2,624,768,450	
	第１４６回利付国債（２０年）	2,100,000,000	2,562,651,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	2,390,000,000	2,888,577,900	
	第１４８回利付国債（２０年）	2,130,000,000	2,550,078,600	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,540,000,000	3,045,206,000	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,270,000,000	2,692,083,800	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,435,000,000	1,661,213,400	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,910,000,000	3,373,533,900	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,650,000,000	3,114,598,000	
	第１５４回利付国債（２０年）	1,980,000,000	2,298,403,800	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,160,000,000	2,441,016,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	1,960,000,000	2,026,875,200	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,910,000,000	2,910,000,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,110,000,000	2,211,406,600	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,070,000,000	2,203,287,300	
	第１６０回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,516,912,600	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,750,000,000	1,859,532,500	
	第１６２回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,176,341,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,556,094,200	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,720,000,000	1,792,291,600	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,706,813,600	
	第１６６回利付国債（２０年）	900,000,000	968,562,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,450,000,000	2,545,427,500	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,780,000,000	1,814,211,600	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,070,000,000	1,070,000,000	
	第１７０回利付国債（２０年）	30,000,000	30,027,900	
国債証券合計		414,860,000,000	454,389,855,700	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	109,853,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	110,727,000	

第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	137,853,000	
第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	135,899,000	
第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	131,121,000	
第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	130,649,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	118,597,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	119,765,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	238,430,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	238,418,000	
第６９５回東京都公募公債	100,000,000	101,633,000	
第６９６回東京都公募公債	100,000,000	101,920,000	
第７００回東京都公募公債	100,000,000	101,904,000	
第７０２回東京都公募公債	200,000,000	204,422,000	
第７１６回東京都公募公債	100,000,000	102,424,000	
第７１７回東京都公募公債	100,000,000	102,149,000	
第７２０回東京都公募公債	100,000,000	103,154,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	102,689,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	102,288,000	
第７６４回東京都公募公債	150,000,000	152,235,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	101,468,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	101,252,000	
平成２３年度第６回北海道公募公債	200,000,000	204,018,000	
平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	102,657,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	101,384,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,549,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	300,000,000	304,578,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	140,966,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	118,796,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	117,027,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	204,666,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	101,220,000	
第２２６回神奈川県公募公債	200,000,000	202,716,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	101,252,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	238,612,000	
第３４５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,422,000	
第３４９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,025,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,445,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,033,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,189,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,659,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	154,625,510	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,098,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,011,000	

	第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,956,280	
	第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,878,000	
	平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	120,691,000	
	平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	119,022,000	
	平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	103,104,000	
	平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	103,125,000	
	平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	100,747,000	
	平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	105,474,000	
	第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	105,110,000	
	第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	118,317,000	
	第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	103,065,000	
	第４回兵庫県公募公債（１２年）	200,000,000	209,688,000	
	第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	109,712,000	
	平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	400,000,000	408,400,000	
	平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	103,107,000	
	平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	102,462,000	
	第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	104,242,000	
	第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	124,717,000	
	第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	107,724,000	
	平成２３年度第３回静岡県公募公債	103,290,000	105,195,700	
	平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	102,021,000	
	平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	102,313,000	
	平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	101,328,000	
	平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,479,000	
	平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	101,527,000	
	平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	121,197,000	
	平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,028,000	
	平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,881,000	
	平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,084,000	
	平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,192,000	
	平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,993,000	
	平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,390,000	
	平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,860,000	
	平成２８年度第１３回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,760,000	
		200,000,000	203,078,000	

平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）			
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	315,966,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	106,687,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	120,249,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	102,500,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	128,869,183	
平成２９年度第１回広島県公募公債	200,000,000	202,406,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,251,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	111,040,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	239,388,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	201,656,000	
平成２２年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	101,540,000	
平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	193,000,000	196,209,590	
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,602,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	102,754,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,883,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	102,900,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,550,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,740,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	101,330,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	118,354,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	118,234,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	110,095,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	121,128,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債	200,000,000	203,872,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	110,460,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	135,450,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,224,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,870,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	106,687,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,649,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	120,699,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	119,060,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	103,199,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	102,297,000	

平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	103,061,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,549,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	320,000,000	323,913,600	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	101,430,000	
第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,505,000	
第９５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,663,000	
第９７回共同発行市場公募地方債	356,000,000	363,152,040	
第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,825,000	
第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,914,500	
第１０７回共同発行市場公募地方債	800,000,000	818,688,000	
第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,414,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,600,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,281,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,297,000	
第１１３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,350,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,273,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,332,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,123,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,708,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,684,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,430,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,712,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,898,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,730,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,572,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,480,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,168,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,391,482	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,026,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,668,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,548,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,287,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,602,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,865,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,316,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,223,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,711,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,586,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	196,206,083	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,507,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,921,000	
	100,000,000	101,980,000	

	平成２３年度第２回熊本県公募公債（１０年）			
	平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	204,792,000	
	平成２３年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	102,150,000	
	平成２３年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	102,150,000	
	平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,644,000	
	第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	241,238,000	
	第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	303,384,000	
	第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	105,971,000	
	第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	134,514,000	
	第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	140,175,000	
	第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	118,416,000	
	第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	129,745,000	
	第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	102,344,000	
	第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,582,000	
	平成２３年度第４回京都市公募公債	100,000,000	102,274,000	
	平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	102,388,000	
	平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	102,785,000	
	平成２８年度第６回京都市公募公債	300,000,000	303,672,000	
	平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	140,074,800	
	平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	240,116,000	
	平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	121,634,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	112,189,000	
	第２０回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	119,913,000	
	平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	102,260,000	
	平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	101,186,000	
	平成２９年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	203,448,000	
	平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	101,429,000	
	平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	204,248,000	
	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	110,748,000	
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,518,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,226,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	118,495,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	101,100,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,310,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,984,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	200,000,000	201,026,000	
	平成２８年度第４回北九州市公募公債	145,000,000	146,384,750	
		100,000,000	120,190,000	

	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）			
	平成２３年度第６回福岡市公募公債	100,000,000	101,980,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	205,400,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	102,133,000	
	平成２２年度第６回広島市公募公債	100,000,000	101,892,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	154,336,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,365,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	106,194,900	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	172,971,600	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	200,000,000	204,360,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	203,502,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	117,250,000	
地方債証券合計		27,414,220,000	28,980,144,518	
特殊債券	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,013,000	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,507,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,217,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,960,000	
	第７５回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,146,000	
	第６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,562,000	
	第９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,428,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	105,949,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	104,800,000	
	第１７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	462,960,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	132,988,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	271,028,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	275,522,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,246,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	159,124,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,097,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	111,529,000	
	第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,708,000	
	第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,190,000	
	第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,608,000	

第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,009,000	
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,010,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,625,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,417,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,499,000	
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,989,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,847,000	
第１２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,890,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,338,000	
第１２６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,558,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,424,000	
第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,024,000	
第１３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,026,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,278,000	
第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,372,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	138,668,000	
第１５５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	307,564,810	
第１５７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,514,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,960,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,016,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,573,000	
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,476,000	
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,662,000	
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,443,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,954,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,886,000	
	200,000,000	205,022,000	

第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	626,088,000	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,296,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,275,000	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,970,000	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	153,048,280	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,823,000	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,162,000	
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	236,136,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	105,400,680	
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,342,000	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,202,000	
第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,064,000	
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,708,000	
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,976,000	
第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,090,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	229,998,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,614,000	
第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,231,000	
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,070,000	
第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	107,415,160	
第２９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	319,049,400	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	207,447,700	
第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,444,000	
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,269,000	
第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,605,000	
	520,000,000	529,999,600	

	第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
	第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,086,000	
	第３６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,857,000	
	第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	218,594,580	
	第２回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,519,000	
	第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	388,512,000	
	第３回政府保証公営企業債券（１５年）	300,000,000	310,431,000	
	第３回公営企業債券（２０年）	110,000,000	113,825,800	
	第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	110,066,000	
	第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	405,576,000	
	第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,595,000	
	第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	136,233,000	
	第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	43,935,200	
	第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	134,007,000	
	第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	240,356,000	
	第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,396,000	
	第１９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	116,535,000	
	第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	239,404,000	
	第２１回地方公共団体金融機構債券（５年）	400,000,000	400,200,000	
	第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,856,380	
	第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,990,710	
	第２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,085,000	
	第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	118,929,000	
	第２９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,091,000	
	第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,330,000	
	第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,455,000	
	第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,455,000	
	第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,934,000	
	第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,138,000	
	第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,400,000	
	第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,428,000	
	第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,288,000	
	第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,233,000	
	第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,662,000	
	Ｆ７３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,085,000	
	Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,388,000	
	第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,617,000	
	第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,444,000	
	第８７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,575,000	

	第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,205,000	
	第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,960,000	
	第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,189,000	
	第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,551,650	
	第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,617,000	
	第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,594,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	112,112,000	
	第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,343,080	
	第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,182,000	
	Ｆ１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,695,000	
	Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,048,000	
	Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,142,000	
	Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,078,000	
	Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,652,000	
	第７回阪神高速道路債券	100,000,000	111,286,000	
	第１９回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,063,000	
	第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,602,000	
	第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,559,440	
	第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,619,000	
	第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	212,320,500	
	第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,960,660	
	第８１回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,021,000	
	第１２７回都市再生債券	400,000,000	400,816,000	
	第１５９回都市再生債券	200,000,000	180,778,000	
	第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,051,000	
	第３４４回東京交通債券	100,000,000	105,305,000	
	第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,766,000	
	第５９回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	511,620,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,774,000	14,304,023	
	第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,253,000	14,872,007	
	第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,520,000	15,282,735	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	239,175,000	239,758,587	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	168,342,000	168,631,548	
	第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,458,000	15,152,851	
	第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,468,000	16,281,771	
	第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,546,000	12,857,893	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	26,052,000	27,057,346	
		15,147,000	15,843,762	

第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券			
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,285,000	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,683,000	14,257,275	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,986,000	16,929,014	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,659,000	14,255,351	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,839,000	16,686,069	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,889,000	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,997,000	14,246,146	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,279,000	14,530,024	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,076,000	22,707,493	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,465,000	23,183,487	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,051,000	26,149,930	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,528,000	28,545,454	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,649,000	30,930,892	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,572,000	31,860,872	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,258,000	68,141,517	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,971,000	14,497,846	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,372,000	33,412,121	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,113,000	14,686,693	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,885,000	14,604,659	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,090,000	36,452,096	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,778,000	13,303,175	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,732,000	36,093,914	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,731,000	33,915,996	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,890,000	15,736,496	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,924,000	67,944,819	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,718,000	36,921,204	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,363,000	15,024,272	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,684,000	48,492,652	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,441,000	46,096,113	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,443,000	46,141,679	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,588,000	97,957,178	
第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,474,000	
第６３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,506,000	
第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,878,000	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,312,000	104,188,219	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,641,000	53,065,691	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,586,000	53,440,567	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,472,000	54,448,111	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,182,000	47,597,429	

第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,093,000	47,163,670	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,916,000	53,896,113	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,532,000	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,154,000	143,420,566	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,648,000	195,179,680	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,252,000	54,579,304	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,729,000	56,165,610	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,709,000	57,035,226	
第８７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,141,000	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,737,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,082,000	180,420,676	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,104,000	61,368,865	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,870,000	126,776,037	
第９２回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	409,016,000	
第９３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,778,000	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,407,000	71,869,560	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,210,000	75,598,842	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,324,000	75,052,784	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	222,231,000	231,580,258	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,888,000	155,090,674	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,053,000	75,923,252	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,489,000	80,629,629	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,952,000	83,718,476	
第１１１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,998,000	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,987,000	88,051,720	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,178,000	88,055,010	
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,862,000	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,335,000	88,603,104	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,809,000	89,492,298	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,307,000	89,868,267	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,589,000	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,175,000	91,604,273	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,899,000	92,457,008	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,788,000	92,088,992	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,190,000	92,494,017	

第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,756,000	93,127,752	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,460,000	186,878,270	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,959,000	93,299,762	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,740,000	189,023,883	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,788,000	94,164,973	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,786,000	189,255,310	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,960,000	95,343,091	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,850,000	192,188,952	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,120,000	192,454,673	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	134,406,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,875,000	97,623,760	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,399,000	98,374,215	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,544,000	97,678,392	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,992,000	196,360,843	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,714,000	98,307,123	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,906,000	98,652,043	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,088,000	198,237,023	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,866,000	98,646,517	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,413,000	296,162,965	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,676,000	198,140,491	
第１６１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,018,000	
第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,692,000	
第１６９回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,374,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,465,000	
第１９４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,207,000	
第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,119,000	
第５７回日本学生支援債券	100,000,000	100,032,000	
第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,214,000	
い第７９５号商工債	200,000,000	200,106,000	
い第８００号商工債	200,000,000	200,198,000	
い第８０２号商工債	100,000,000	100,131,000	

	い第８０４号商工債	300,000,000	300,420,000	
	い第７９５号農林債	100,000,000	100,000,000	
	い第７９６号農林債	200,000,000	199,998,000	
	第３１７回信金中金債（５年）	200,000,000	200,160,000	
	第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,329,000	
	第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,339,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,698,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,359,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,294,000	
	第２１８号商工債（３年）	300,000,000	300,492,000	
	第２２１号商工債（３年）	200,000,000	200,352,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,697,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	120,127,000	
	第３８回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,073,000	
	第３３回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,044,000	
	第５９回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,671,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,013,000	
	第３２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,827,000	
	第５３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,004,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,636,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,101,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,758,000	
特殊債券合計		35,583,364,000	37,656,629,556	
社債券	第２０回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,944,000	
	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,436,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	200,000,000	200,052,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,881,000	
	第１１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,596,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,858,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,101,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,642,000	
	第９回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,728,000	
	第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,614,000	

第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,916,000	
第１回ＨＳＢＣ・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,431,000	
第１０回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	200,000,000	209,326,000	
第１１回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	300,471,000	
第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	401,628,000	
第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,823,000	
第２１回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,445,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,395,000	
第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,749,000	
第７回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,057,000	
第１１回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,189,000	
第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,095,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,352,000	
第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,609,000	
第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,059,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,338,000	
第７回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,873,000	
第２回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,759,000	
第１１回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,964,000	
第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,833,000	
第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,791,000	
第１２回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,072,000	
第５７回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,210,000	
第９回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,619,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,216,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,206,000	
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,142,000	
第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,067,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	99,848,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,493,000	
第８回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,053,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,485,000	

	第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,833,000	
	第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,075,000	
	第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,878,000	
	第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,874,000	
	第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,354,000	
	第２８回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	99,876,000	
	第１０回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,765,000	
	第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,867,000	
	第３６回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,348,000	
	第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,008,000	
	第１５回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,300,000	
	第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,444,000	
	第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,558,000	
	第１２回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,824,000	
	第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,123,000	
	第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,080,000	
	第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
	第６回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,058,000	
	第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,908,000	
	第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,197,000	
	第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,299,000	
	第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,654,000	
	第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,794,000	
	第１４回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,906,000	
	第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,620,000	
	第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,263,000	
	第２７回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	99,920,000	
	第２回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,090,000	
	第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,431,000	
	第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,228,000	
	第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,818,000	
	第７６回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,831,000	
	第５０回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,771,000	
	第１１回株式会社りそなホールディングス無担保社債	700,000,000	699,167,000	
	第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	123,790,000	
	第３２回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,415,000	
		100,000,000	116,705,000	

第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債			
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	102,478,000	
第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,626,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,940,000	
第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	308,307,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,549,000	
第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,236,000	
第２３回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,853,000	
第３７回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,824,000	
第２回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,472,000	
第６６回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	302,646,000	
第７３回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	300,825,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,487,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第１９３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,961,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,808,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,788,000	
第４８回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,014,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,452,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,758,000	
第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,477,000	
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,892,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,384,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,334,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,224,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,046,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,749,000	
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	103,130,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,157,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,491,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,994,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,971,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,560,000	
第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	102,955,000	

第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,345,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,701,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	239,038,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,369,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,392,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,062,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,013,650	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	118,521,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,782,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,265,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,083,800	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	134,855,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,732,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,380,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	113,363,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,840,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,722,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,060,000	
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	203,880,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	102,649,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,572,000	
第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	100,000,000	102,404,000	
第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,976,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,283,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,511,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,033,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,476,000	
第４９６回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,301,000	
第５０５回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,283,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,398,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,194,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,963,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,123,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,130,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,462,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,493,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,412,000	

	第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,934,000	
	第３３０回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,417,000	
	第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,358,780	
	第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,429,000	
	第４８７回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,194,000	
	第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,423,000	
	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,258,000	
	第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,846,000	
	第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,894,000	
	第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,423,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,810,000	
	第３２０回北海道電力株式会社社債	201,000,000	203,102,460	
	第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,186,000	
	第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,127,000	
	第３４４回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,376,000	
	第３５１回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,037,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,267,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,511,000	
	第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,792,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,942,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,425,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,652,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
	第３回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,004,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	201,338,000	
社債券合計		21,966,000,000	22,426,856,690	
合計			543,453,486,464	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン】

【純資産額計算書】

（2019年11月29日現在）

Ⅰ　資産総額	23,195,658,780円
Ⅱ　負債総額	52,115,472円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	23,143,543,308円
Ⅳ　発行済口数	19,159,409,907口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2079円
（1万口当たり純資産額）	（12,079円）

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2019年11月29日現在）

Ⅰ　資産総額	561,029,442,871円
Ⅱ　負債総額	12,331,507,977円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	548,697,934,894円
Ⅳ　発行済口数	385,021,315,509口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4251円
（1万口当たり純資産額）	（14,251円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

ません。

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年11月29日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数：12,000株
発行済株式総数　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018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

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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発します。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。

②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2020年 2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】

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

2019年11月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	538	12,742,439
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	311,227
単位型公社債投資信託	15	127,121
合計	640	13,180,787

3【委託会社等の経理状況】

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

　また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関す

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

(2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(3) 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33期事業年度（自　2018年4月1日　至　2019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34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日　至 2019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 （2018年3月31日現在）		当事業年度 （2019年3月31日現在）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		23,973,152		23,830,484
有価証券		―		2,268,127
前払費用		157,614		197,843
未収委託者報酬		5,373,307		6,351,590
未収運用受託報酬		―		5,525,778
未収収益		896		212,722
その他		8,946		2,261,900
流動資産合計		29,513,917		40,648,447
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	36,782	※1	282,407
器具備品	※1	79,655	※1	564,981
その他	※1	1,912	※1	14,462
有形固定資産合計		118,350		861,851
無形固定資産				
ソフトウェア		210,679		1,487,265
その他		4,377		7,256
無形固定資産合計		215,056		1,494,522
投資その他の資産				
投資有価証券		42,802		11,334,053
関係会社株式		―		4,663,000
長期貸付金		17,088		―
繰延税金資産		248,633		141,789
その他		32,880		32,492
貸倒引当金		△17,088		―
投資その他の資産合計		324,317		16,171,335
固定資産合計		657,724		18,527,709
資産合計		30,171,641		59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日現在）	当事業年度 （2019年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
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	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	－	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	－	5,464,685
その他営業収益	－	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	－	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	－	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240

営業利益	5,516,262	8,554,888

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	―	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	―	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	△50,178	△125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2017年4月1日　至　2018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			
その他資本剰余金から資本金への振替			
会社分割による増加			
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					
その他資本剰余金から資本金への振替					－
会社分割による増加					－
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	繰延ヘッジ損益	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				
その他資本剰余金から資本金への振替				－
会社分割による増加				－
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

当事業年度（自　2018年4月1日　至　2019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			
その他資本剰余金から資本金への振替	1,700,000	△1,700,000	△1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	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
当期変動額					
その他資本剰余金から資本金への振替					－
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		△30,500	△30,000	△30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	－	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	－	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から資本金への振替				－
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				△30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）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．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．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、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。

４．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

５．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。

６．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

（4）ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

７．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計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）

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、当事業年度より定額法へ変更しております。
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。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

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）

「『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）を当事業年度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。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2018年3月31日）		当事業年度 （2019年3月31日）	
建　　物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	〃	351,328	〃
そ の 他	2,677	〃	3,595	〃
計	392,342	〃	408,445	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018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
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017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
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019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
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

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

2019年6月27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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

（リース取引関係）

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、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しているほか、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ております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため有価証券及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの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極めて低いものと

考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、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極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

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

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

②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、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、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。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③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（2018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) 未収運用受託報酬	―	―	―
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	―
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	―
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	―
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	―	―	―
ヘッジ会計が適用されているもの	―	―	―
デリバティブ取引計	―	―	―

(*) 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（2019年3月31日）　（単位:千円）

	貸借対照表計上額 (*1)	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	23,830,484	23,830,484	－
（2）未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	－
（3）未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	－
（4）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,602,178	13,602,178	－
（5）未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	－
（6）未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	－
（7）デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	－
デリバティブ取引計	81,231	81,231	－

（*1）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。
（*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。
（注1） 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬
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。

（4）有価証券及び投資有価証券
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、及び（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。

（7）デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

（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	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019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、「(4)有価証券及び投資有価証券 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（2018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	－	－	－
未収運用受託報酬	－	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	－	12,846	21,065	496

当事業年度（2019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	23,830,484	－	－	－
未収委託者報酬	6,351,590	－	－	－
未収運用受託報酬	5,525,778	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、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子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

２．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）　（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

当事業年度（2019年3月31日）　（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	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	9,196,375	9,602,961	△406,585
小計	9,196,375	9,602,961	△406,585

合計	13,602,178	13,035,220	566,957

（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。

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018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

当事業年度（2019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
1,538,203	46,789	34,437

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	－	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	－	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	－	42	42
	スイスフラン	7,802	－	△6	△6
	香港ドル	183,640	－	645	645
	ユーロ	183,228	－	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	－	90	90
	スイスフラン	1,110	－	5	5
	香港ドル	560	－	4	4
	ユーロ	2,492	－	△0	△0
合計		1,346,753	－	7,916	7,916

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739,103	－	△8,766	△8,766
合計		6,739,103	－	△8,766	△8,766

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2．時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		3,432,867	－	13,731
	英ポンド		2,575,513	－	50,256
	カナダドル	有価証券	40,963	－	566
	スイスフラン	投資有価証券	34,448	－	△132
	香港ドル	子会社株式	566,113	－	2,528
	人民元		1,725,146	－	9,137
	ユーロ		262,583	－	6,080
	買建				
	ユーロ		6,313	－	△86
合計			8,643,951	－	82,081

（注） 1．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（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（2018年3月31日）	当事業年度（2019年3月31日）
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

（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（2018年3月31日）	当事業年度（2019年3月31日）
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

（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15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

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（2018年3月31日）		当事業年度（2019年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	〃	－	
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	〃	40,467	〃

退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	〃	164,674	〃
その他	23,674	〃	82,358	〃
繰延税金資産 合計	255,547	〃	413,091	〃
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	△6,833	〃	―	
有価証券評価差額	―		△173,602	〃
繰延ヘッジ損益	―		△58,719	〃
その他	△80	〃	△38,979	〃
繰延税金負債 合計	△6,913	〃	△271,302	〃
繰延税金資産の純額	248,633	〃	141,789	〃

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。

（企業結合等関係）

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)実施した会計処理の概要

「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しております。

（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］

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 2017年4月1日　至 2018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。

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

［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。

（持分法損益等）

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
重要性が乏しいため、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
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
（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 2017年4月1日　至 2018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㈱	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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用	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
① 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。
② 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 2018年4月1日　至 2019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㈱	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	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	 18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 無対価	―	―

（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
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、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。
② 投信販売代行手数料等
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。
③ 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。
④ 吸収分割
共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

（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（2018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（2019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 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
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：百万円）

		第34期中間会計期間末 （2019年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826
固定資産		
有形固定資産	※1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780
資産合計		62,606
負債の部		
流動負債		
未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	※2	655
流動負債合計		9,216
固定負債		
退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計	9,935

（単位：百万円）

	第34期中間会計期間末 （2019年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

（単位：百万円）

		第34期中間会計期間 （自　2019年4月1日 至　2019年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	※1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	※2	1,110
営業外費用	※3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		△18
法人税等合計		2,179

中間純利益	4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日　至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	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	2,000	17,239	17,239
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	2,000	17,239	17,239

	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	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		△2,536	△2,305	△2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
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	230	－	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△513	152	△360	△360
当中間期変動額合計	△513	152	△360	2,229
当中間期末残高	△120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自　2019年4月1日
至　2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．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。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．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。

7．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

８．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

（1）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。

（2）連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第34期中間会計期間末 （2019年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額　470百万円 ※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」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第34期中間会計期間 （自　2019年4月1日 至　2019年9月30日）
※1　減価償却実施額 有形固定資産　62百万円 無形固定資産　42百万円 ※2　営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益　481百万円 投資有価証券償還益　309百万円 為替差益　181百万円 ※3　営業外費用の主要項目 デリバティブ費用　456百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日　至 2019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（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日

2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

（金融商品関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

2019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：百万円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	－
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	－
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	－
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	－
(7)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)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並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

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。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、 及び(4)未収運用受託報酬

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。

(5)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。

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円)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、「（5）投資有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

時価のある子会社株式はありません。なお、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子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（単位：百万円）

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	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	3,767	4,101	△334
小計	3,767	4,101	△334
合計	10,344	10,517	△173

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）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34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	872	－	1	1
	英ポンド	52	－	0	0
	カナダドル	2	－	0	0
	スイスフラン	6	－	0	0
	香港ドル	195	－	0	0
	ユーロ	155	－	2	2
合計		1,285	－	5	5

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	－	△57	△57
合計		6,493	－	△57	△57

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド カナダドル スイスフラン 香港ドル ユーロ	有価証券 投資有価証券 子会社株式	 2,500 2,259 22 53 96 113	 － － － － － －	 5 41 0 0 0 1
合計			5,046	－	48

（注）　1．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（セグメント情報等）
（セグメント情報）
第34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019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34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）
１．製品及びサービスごとの情報
単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報
(1)営業収益
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省

略しております。

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

（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34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019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34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019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34期中間会計期間（自　2019年4月1日　至　2019年9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第34期中間会計期間 （自　2019年4月1日 至　2019年9月30日）
1株当たり純資産額　17,557,176円40銭 1株当たり中間純利益　1,631,928円83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34期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 2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。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	9,257	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ａｕカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
リテラ・クレア証券株式会社	3,794	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
東海東京証券株式会社	6,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社京葉銀行	49,759	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社イオン銀行	51,250	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みちのく銀行	36,986	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社きらぼし銀行	43,734	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社群馬銀行	48,652	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
藍澤證券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

株式会社北都銀行※	12,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社千葉銀行	145,069	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

※株式会社北都銀行は、職場積立NISA専用における募集・販売等の取扱いを行います。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2019年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年６月５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2019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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

２０２０年1月１０日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 国内債券インデックス・オープンの２０１９年5月１１日から２０１９年１１月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 国内債券インデックス・オープンの２０１９年１１月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（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．ＸＢＲＬ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

2019年12月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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2019年４月１日から2020年３月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年４月１日から2019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2019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（2019年４月１日から2019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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。