

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年11月17日提出
【計算期間】	第7期中(自 2021年2月18日至 2021年8月17日)
【ファンド名】	サテライト投資戦略ファンド(株式型)
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

以下は、2021年9月30日現在の状況について記載してあります。

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	2,261,187,149	21.99
	ルクセンブルク	310,906,979	3.02
	小計	2,572,094,128	25.02
投資証券	ケイマン	133,844,941	1.30
親投資信託受益証券	日本	7,498,302,513	72.93
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		77,879,983	0.76
合計（純資産総額）		10,282,121,565	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)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2016年 2月17日)	37,286,279,341	37,286,279,341	8,647	8,647
第2期計算期間末 (2017年 2月17日)	30,621,118,809	30,621,118,809	9,555	9,555
第3期計算期間末 (2018年 2月19日)	18,433,690,243	18,433,690,243	10,131	10,131
第4期計算期間末 (2019年 2月18日)	18,337,969,638	18,337,969,638	9,864	9,864
第5期計算期間末 (2020年 2月17日)	13,138,863,682	13,138,863,682	10,917	10,917
第6期計算期間末 (2021年 2月17日)	11,518,211,025	11,518,211,025	11,845	11,845
2020年 9月末日	11,783,521,081		10,525	
10月末日	11,358,275,965		10,291	
11月末日	11,829,388,584		10,993	
12月末日	11,637,852,393		11,251	
2021年 1月末日	11,350,679,533		11,345	
2月末日	11,126,132,784		11,581	
3月末日	11,073,876,513		12,012	
4月末日	10,974,132,500		12,168	
5月末日	10,891,451,714		12,321	
6月末日	10,730,050,238		12,429	
7月末日	10,533,296,863		12,424	

8月末日	10,540,106,135		12,584	
9月末日	10,282,121,565		12,572	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間	2015年 6月16日～2016年 2月17日	0
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	0
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	0
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2015年 6月16日～2016年 2月17日	13.5
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	10.5
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	6.0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	2.6
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	10.7
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	8.5
第7期中間計算期間	2021年 2月18日～2021年 8月17日	4.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(参考)

J P X日経インデックス400 マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	35,681,662,660	98.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		616,253,248	1.70
合計(純資産総額)		36,297,915,908	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	614,712,000	1.69

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

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

中小型株式 マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	32,187,676,000	93.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,201,375,295	6.40
合計(純資産総額)		34,389,051,295	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。

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	486,963,215,070	98.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,740,158,535	1.37
合計(純資産総額)		493,703,373,605	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	6,781,870,000	1.37

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	344,194,019,791	66.57
	イギリス	21,327,736,235	4.13
	カナダ	17,576,264,659	3.40
	スイス	16,292,266,216	3.15
	フランス	16,062,694,582	3.11
	ドイツ	14,103,169,586	2.73
	オランダ	10,450,957,137	2.02
	アイルランド	9,472,295,686	1.83
	オーストラリア	9,369,443,000	1.81
	スウェーデン	5,356,228,340	1.04
	デンマーク	4,072,671,429	0.79
	スペイン	3,773,442,191	0.73
	香港	3,405,309,610	0.66
	イタリア	2,904,932,127	0.56
	フィンランド	1,957,982,261	0.38
	ジャージー	1,570,114,883	0.30
	シンガポール	1,372,918,552	0.27
	ベルギー	1,296,081,034	0.25
	バミューダ	1,158,246,620	0.22
	ケイマン	998,806,745	0.19
	ノルウェー	987,078,646	0.19
	イスラエル	985,885,555	0.19
	ニュージーランド	501,136,115	0.10
	ルクセンブルク	496,510,489	0.10
	キュラソー	396,196,384	0.08
	オーストリア	342,205,134	0.07
	ポルトガル	250,534,753	0.05
	パナマ	201,419,111	0.04
	リベリア	195,517,401	0.04
	マン島	161,635,455	0.03
パプアニューギニア	64,542,137	0.01	
	小計	491,298,241,864	95.02
投資信託受益証券	オーストラリア	216,518,588	0.04
	香港	81,880,151	0.02
	小計	298,398,739	0.06
投資証券	アメリカ	9,550,254,272	1.85

	オーストラリア	688,623,359	0.13
	イギリス	300,430,262	0.06
	フランス	249,172,113	0.05
	シンガポール	230,863,835	0.04
	香港	159,979,297	0.03
	カナダ	75,892,858	0.01
	小計	11,255,215,996	2.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,176,715,369	2.74
合計(純資産総額)		517,028,571,968	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	10,539,740,033	2.04
	買建	カナダ	802,228,647	0.16
	買建	ドイツ	2,014,757,668	0.39
	買建	イギリス	425,716,900	0.08
	買建	オーストラリア	534,077,388	0.10

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,237,360,995	0.24
	売建		317,341,726	0.06

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

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

J-REIT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(%)
投資証券	日本	104,962,167,500	96.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,799,457,463	3.49

合計(純資産総額)	108,761,624,963	100.00
-----------	-----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,789,504,000	3.48

(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。

グローバルREIT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(%)
投資証券	アメリカ	70,492,892,679	75.20
	オーストラリア	6,325,109,335	6.75
	イギリス	5,066,492,407	5.40
	シンガポール	3,320,269,016	3.54
	カナダ	1,841,082,903	1.96
	フランス	1,816,914,722	1.94
	香港	1,257,377,421	1.34
	ベルギー	1,239,784,200	1.32
	スペイン	400,515,938	0.43
	ニュージーランド	391,774,387	0.42
	ガンジー	249,493,764	0.27
	ドイツ	248,936,815	0.27
	オランダ	160,322,393	0.17
	韓国	156,776,906	0.17
	アイルランド	106,310,045	0.11
	イスラエル	69,070,302	0.07
	イタリア	28,311,408	0.03
	小計	93,171,434,641	99.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		572,589,287	0.61
合計(純資産総額)		93,744,023,928	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		186,393,161	0.20

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	27,429,782,337	101.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		410,607,356	1.52
合計(純資産総額)		27,019,174,981	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		28,593,330,716	105.83

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

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

ピクテ マルチストラテジー リンク 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(%)
社債券	ケイマン	43,516,535,040	97.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		965,251,791	2.17
合計(純資産総額)		44,481,786,831	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。

米国株式LS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(%)
社債券	アイルランド	18,169,922,798	99.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,424,253	0.12
合計(純資産総額)		18,191,347,051	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		18,236,847,500	100.25

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

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

コモディティLSアルファ・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(%)
社債券	アイルランド	20,308,992,000	98.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		211,458,928	1.03
合計(純資産総額)		20,520,450,928	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。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	18,488,138,000	98.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		372,923,893	1.98
合計(純資産総額)		18,861,061,893	100.00

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

2【設定及び解約の実績】

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2015年 6月16日～2016年 2月17日	49,526,375,760	6,407,778,915	43,118,596,845
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	11,056,157,024	22,127,791,489	32,046,962,380
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	8,740,142,510	22,591,145,594	18,195,959,296
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	7,015,265,506	6,619,741,116	18,591,483,686
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	1,220,521,390	7,776,843,668	12,035,161,408
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	167,978,519	2,478,672,606	9,724,467,321
第7期中間計算期間	2021年 2月18日～2021年 8月17日	38,880,764	1,322,399,009	8,440,949,076

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

3【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(2021年2月18日から2021年8月17日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2021年 2月17日現在）	第7期中間計算期間 （2021年 8月17日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	205,599,097	170,422,863
投資信託受益証券	2,450,667,667	2,566,259,983
投資証券	135,733,418	132,033,911
親投資信託受益証券	8,840,608,893	7,710,135,543
未収入金	20,121,563	7,989,504
流動資産合計	11,652,730,638	10,586,841,804
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	38,103,631	14,574,921
未払受託者報酬	3,246,328	2,972,519
未払委託者報酬	92,844,876	85,013,867
未払利息	203	299
その他未払費用	324,575	297,193
流動負債合計	134,519,613	102,858,799
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	9,724,467,321	8,440,949,076
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,793,743,704	2,043,033,929
（分配準備積立金）	1,922,926,468	1,661,911,717
元本等合計	11,518,211,025	10,483,983,005
純資産合計		
	11,518,211,025	10,483,983,005
負債純資産合計	11,652,730,638	10,586,841,804

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日	第7期中間計算期間 自 2021年 2月18日 至 2021年 8月17日
営業収益		
受取配当金	-	2,716,899
受取利息	409	93
有価証券売買等損益	357,227,963	604,161,357
その他収益	2,140	-
営業収益合計	357,225,414	606,878,349
営業費用		
支払利息	41,976	22,757
受託者報酬	3,150,550	2,972,519
委託者報酬	90,105,820	85,013,867
その他費用	315,298	297,193
営業費用合計	93,613,644	88,306,336
営業利益又は営業損失()	450,839,058	518,572,013
経常利益又は経常損失()	450,839,058	518,572,013
中間純利益又は中間純損失()	450,839,058	518,572,013
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	44,427,542	33,695,725
期首剰余金又は期首欠損金()	1,103,702,274	1,793,743,704
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	8,373,275
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	8,373,275
剰余金減少額又は欠損金増加額	64,887,011	243,959,338
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,626,858	243,959,338
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,260,153	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	632,403,747	2,043,033,929

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)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。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

	第6期 (2021年 2月17日現在)	第7期中間計算期間 (2021年 8月17日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,724,467,321口	8,440,949,076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 1.1845円 (1万口当たり純資産額) (11,845円)	1口当たり純資産額 1.2420円 (1万口当たり純資産額) (12,420円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	第7期中間計算期間 (2021年 8月17日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第6期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第7期中間計算期間 自 2021年 2月18日 至 2021年 8月17日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,035,161,408円	9,724,467,321円
期中追加設定元本額	167,978,519円	38,880,764円
期中一部解約元本額	2,478,672,606円	1,322,399,009円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資

信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

J P X日経インデックス400 マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	617,648,161
株式	33,378,548,330
派生商品評価勘定	1,254,390
未収配当金	41,446,512
前払金	683,000
差入委託証拠金	10,042,000
流動資産合計	34,049,622,393
資産合計	34,049,622,393
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,961,590
未払金	14,720
未払解約金	287,451,962
未払利息	1,084
流動負債合計	289,429,356
負債合計	289,429,356
純資産の部	
元本等	
元本	19,320,886,087
剰余金	
剰余金又は欠損金()	14,439,306,950
元本等合計	33,760,193,037
純資産合計	33,760,193,037
負債純資産合計	34,049,622,393

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2021年 8月17日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	19,320,886,087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 1.7473円 (1万口当たり純資産額) (17,473円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月17日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

2021年 8月17日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	26,827,957,599円
期中追加設定元本額	3,751,051,412円
期中一部解約元本額	11,258,122,924円
期末元本額	19,320,886,087円
期末元本額の内訳	
SMT J P X日経インデックス400・オープン	4,813,403,348円
SMTAM J P X日経インデックス400オープン	774,061,769円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	11,838,463,162円
J P X日経インデックス400・オープン（SMA専用）	664,026,564円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	270,365,101円
J P X日経400オープン（適格機関投資家専用）	960,566,143円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引		うち1年超	(円)

	買建	379,633,000	-	378,950,000	683,000
	合計	379,633,000	-	378,950,000	683,000

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

中小型株式 マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,695,770,784
株式	29,852,540,000
未収入金	282,899,376
未収配当金	26,397,500
流動資産合計	31,857,607,660
資産合計	31,857,607,660
負債の部	
流動負債	
未払金	411,793,231
未払解約金	11,204,761
未払利息	2,978
流動負債合計	423,000,970
負債合計	423,000,970
純資産の部	
元本等	
元本	6,202,518,395
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,232,088,295
元本等合計	31,434,606,690
純資産合計	31,434,606,690
負債純資産合計	31,857,607,660

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		6,202,518,395口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.0680円 (50,680円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月17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。

（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	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	6,556,166,178円

区分	2021年 8月17日現在
期中追加設定元本額	295,105,943円
期中一部解約元本額	648,753,726円
期末元本額	6,202,518,395円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	3,206,114,465円
中小型株式オープン(SMA専用)	301,143,620円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	2,635,960,887円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	59,299,423円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,678,712,995
株式	462,768,129,280
派生商品評価勘定	3,466,900
未収配当金	544,468,946
前払金	22,392,000
差入委託証拠金	100,155,000
流動資産合計	466,117,325,121
資産合計	466,117,325,121
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,908,950
未払金	8,716,806
未払解約金	401,358,289
未払利息	4,704
流動負債合計	435,988,749
負債合計	435,988,749
純資産の部	
元本等	
元本	251,694,224,065
剰余金	
剰余金又は欠損金()	213,987,112,307
元本等合計	465,681,336,372
純資産合計	465,681,336,372
負債純資産合計	466,117,325,121

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	251,694,224,065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 1.8502円 (1万口当たり純資産額) (18,502円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月17日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	255,196,239,050円
期中追加設定元本額	12,661,514,876円
期中一部解約元本額	16,163,529,861円
期末元本額	251,694,224,065円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	421,754,111円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,893,253,947円

区分	2021年 8月17日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,184,066円
S M T T O P I X インデックス・オープン	10,739,869,635円
世界経済インデックスファンド	2,954,367,302円
日本株式インデックス・オープン	3,469,745,528円
D C マイセレクション 2 5	6,111,004,920円
D C マイセレクション 5 0	18,094,144,387円
D C マイセレクション 7 5	17,844,285,781円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,866,053,820円
D C マイセレクション S 2 5	2,982,260,538円
D C マイセレクション S 5 0	8,562,852,064円
D C マイセレクション S 7 5	6,128,315,135円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,715,412,933円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	252,963,609円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	688,932,878円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	484,099,146円
D C 世界経済インデックスファンド	3,282,637,624円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,563,534,710円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,789,755円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	20,457,639円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	190,895,275円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	47,302,831円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	170,946,035円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	30,528,034円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	92,853,350円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,125,827,005円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	475,525,115円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,024,684,398円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	176,698,189円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	29,298,087円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	549,058,017円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	310,705,853円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	395,325,610円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	41,816,544円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	646,290,760円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	3,641,067,065円
日本株式ファンド・シリーズ 2	1,952,559,982円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,492,806,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,088,522,067円
分散投資コア戦略ファンド A	1,412,057,804円
分散投資コア戦略ファンド S	6,014,239,060円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	416,403,500円

区分	2021年 8月17日現在
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	392,775,144円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,988,924,716円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	209,439,625円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,458,839円
S M T インデックスバランス・オープン	59,778,929円
国内株式S M T Bセクション(S M A専用)	26,300,419,892円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	604,397,930円
S M T 世界経済インデックス・オープン	36,533,863円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	125,534,946円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	22,953,784円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,380,236円
グローバル経済コア	235,418,101円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	23,173,863円
i - S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	63,676,527円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	18,689,652円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,184,160,857円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	142,737,671円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	4,345,620円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,239,550円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,472,213円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,344,119円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	42,777,357,201円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,167,933,055円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	196,967,610円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	30,193,333円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P(適格機関投資家専用)	46,635,965,847円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	8,021円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	58,821円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2021年 8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,005,112,000	-	2,982,720,000	22,392,000
合計		3,005,112,000	-	2,982,720,000	22,392,000

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,347,803,136
コール・ローン	531,634,103
株式	504,483,305,466
投資信託受益証券	309,367,767
投資証券	11,609,685,075
派生商品評価勘定	421,536,711
未収入金	807,672
未収配当金	574,340,059
差入委託証拠金	3,840,641,409
流動資産合計	529,119,121,398
資産合計	529,119,121,398
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	87,385
前受金	420,822,026
未払解約金	643,366,648
未払利息	933
流動負債合計	1,064,276,992
負債合計	1,064,276,992
純資産の部	
元本等	
元本	133,927,362,195
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	394,127,482,211
元本等合計	528,054,844,406
純資産合計	528,054,844,406
負債純資産合計	529,119,121,398

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	2021年 8月17日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		133,927,362,195口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.9428円 (39,428円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	144,587,616,478円
期中追加設定元本額	7,054,116,285円
期中一部解約元本額	17,714,370,568円
期末元本額	133,927,362,195円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,985,217,172円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,541,866円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	28,238,415,312円
世界経済インデックスファンド	8,716,289,399円
外国株式インデックス・オープン	829,502,978円
D C マイセレクション 2 5	847,645,773円
D C マイセレクション 5 0	4,012,043,885円
D C マイセレクション 7 5	4,492,907,579円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,254,618,559円
D C マイセレクション S 2 5	411,389,348円
D C マイセレクション S 5 0	1,880,097,025円
D C マイセレクション S 7 5	1,512,790,449円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	68,892,011円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	186,663,788円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	131,355,001円
D C 世界経済インデックスファンド	9,907,096,342円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,865,578,625円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,439,589円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	5,085,097円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	30,680,695円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,100,476円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	85,251,731円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	14,588,632円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	44,379,526円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	376,011,029円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	209,362,390円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,521,222,034円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	423,760,681円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	42,014,703円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	206,185,194円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	70,705,120円

区分	2021年 8月17日現在
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,184,199,192円
F O F s用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,330,820,845円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,128,066,338円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,206,156,730円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,500,138,862円
分散投資コア戦略ファンドA	1,517,087,653円
分散投資コア戦略ファンドS	8,477,877,522円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,241,017,569円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,123,576,361円
コア投資戦略ファンド(切替型)	971,655,275円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	635,279,907円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30,767,097円
S M T インデックスバランス・オープン	171,689,234円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	675,888,118円
外国株式S M T Bセレクション(S M A専用)	24,111,612,409円
S M T 世界経済インデックス・オープン	163,510,676円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	567,506,160円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	106,509,418円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,513,058円
i - S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	115,382,395円
グローバル経済コア	668,021,097円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	11,904,662円
D Cターゲット・イヤーフンド2055	4,761,997円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	664,326,699円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	77,514,810円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	12,995,084円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	9,687,457円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	4,443,736円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	4,116,001円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	560,351,676円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	879,102,389円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,436,297,607円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	894,404,047円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	138,418,552円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4,684,544円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	34,174円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	21,644円
S M T A M海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	277,587,747円
S M T A Mバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	260,107,582円
S M T A M海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	279,785,392円
S M T A M海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	270,292,284円
S M T A M海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	268,409,933円
S M T A M海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	265,829,351円

区分	2021年 8月17日現在
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	266,176,902円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2021年 8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,046,428,385	-	11,467,250,411	420,822,026
合計		11,046,428,385	-	11,467,250,411	420,822,026

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年 8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	259,952,260	-	259,324,960	627,300
	アメリカドル	98,550,000	-	98,306,100	243,900
	ユーロ	64,292,500	-	64,296,300	3,800
	イギリスポンド	97,109,760	-	96,722,560	387,200
合計		259,952,260	-	259,324,960	627,300

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,235,400,731
投資証券	105,532,695,950
派生商品評価勘定	85,006,800
未収入金	106,427,032
未収配当金	642,207,787
差入委託証拠金	193,698,000
流動資産合計	109,795,436,300
資産合計	109,795,436,300
負債の部	
流動負債	
前受金	85,006,800
未払金	253,397,575
未払解約金	17,035,047
未払利息	5,681
流動負債合計	355,445,103
負債合計	355,445,103
純資産の部	
元本等	
元本	48,724,971,616
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	60,715,019,581
元本等合計	109,439,991,197
純資産合計	109,439,991,197
負債純資産合計	109,795,436,300

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

2021年 8月17日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	48,724,971,616口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2461円 (1万口当たり純資産額) (22,461円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2021年 8月17日現在

（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	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	54,273,798,554円
期中追加設定元本額	2,419,613,890円
期中一部解約元本額	7,968,440,828円
期末元本額	48,724,971,616円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,649,296,385円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,554,084円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,933,174,387円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	22,381,893,600円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,286,420,154円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,886,625,627円
分散投資コア戦略ファンドA	543,785,630円
分散投資コア戦略ファンドS	1,146,948,111円
コア投資戦略ファンド（切替型）	764,643,554円
S M T インデックスバランス・オープン	27,213,988円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	257,938,774円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,588,296円
グローバル経済コア	260,654,397円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,008,397円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	400,278,336円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	46,406,627円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	486,918,119円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	11,016,549円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	41,981,103円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	17,781円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	893,020,541円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	378,166,221円

区分	2021年 8月17日現在
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03(適格機関投資家専用)	307,420,955円

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2021年 8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,807,313,200	-	3,892,320,000	85,006,800
合計		3,807,313,200	-	3,892,320,000	85,006,800

(注)1.時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	344,635,368
コール・ローン	27,665,742
投資証券	94,450,670,824
派生商品評価勘定	609,072
未収入金	4,167,133
未収配当金	174,345,705
流動資産合計	95,002,093,844
資産合計	95,002,093,844
負債の部	
流動負債	
未払株式払込金	1,447,465
未払解約金	266,509,402
未払利息	48
流動負債合計	267,956,915
負債合計	267,956,915
純資産の部	
元本等	
元本	41,276,974,006
剰余金	
剰余金又は欠損金()	53,457,162,923
元本等合計	94,734,136,929
純資産合計	94,734,136,929

	2021年 8月17日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	95,002,093,844

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,276,974,006口
2. 1口当たり純資産額	2.2951円

	2021年 8月17日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(22,951円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2021年 2月18日

区分	2021年 8月17日現在
期首元本額	45,206,250,834円
期中追加設定元本額	3,553,313,743円
期中一部解約元本額	7,482,590,571円
期末元本額	41,276,974,006円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	68,825,047円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	108,282,995円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,680,915,791円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,740,331円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,894,381,651円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	18,291,056,494円
コア投資戦略ファンド(安定型)	856,900,086円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,876,449,955円
分散投資コア戦略ファンドA	692,328,368円
分散投資コア戦略ファンドS	1,482,716,195円
コア投資戦略ファンド(切替型)	694,548,221円
SMT インデックスバランス・オープン	151,133,017円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	255,657,000円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,988,909円
グローバル経済コア	263,511,217円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,372,703円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	408,099,388円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	45,839,957円
グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,275,327,994円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	408,780,018円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	102,239,363円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	3,392,209円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	12,981円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	117,496,637円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	120,314,866円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	116,232,884円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	115,423,480円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	112,555,727円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	112,450,522円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2021年 8月17日現在)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	100,482,400	-	100,489,852	7,452
	アメリカドル	100,482,400	-	100,489,852	7,452
	売建	243,090,000	-	242,488,380	601,620
	アメリカドル	243,090,000	-	242,488,380	601,620
合計	343,572,400	-	342,978,232	609,072	

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	30,303,262
コール・ローン	32,497,639
投資信託受益証券	27,947,717,876
派生商品評価勘定	100,002,687
未収入金	19,265,850
流動資産合計	28,129,787,314
資産合計	28,129,787,314
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,653
未払金	271,006,422
未払解約金	1,083,501
未払利息	57
流動負債合計	272,122,633
負債合計	272,122,633
純資産の部	
元本等	
元本	22,325,141,193
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,532,523,488
元本等合計	27,857,664,681
純資産合計	27,857,664,681
負債純資産合計	28,129,787,314

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,325,141,193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 1.2478円 (1万口当たり純資産額) (12,478円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月17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ぬ。

	2021年 8月17日現在
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	25,443,545,465円
期中追加設定元本額	4,319,414,042円
期中一部解約元本額	7,437,818,314円
期末元本額	22,325,141,193円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,248,503,799円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,329,169,406円
分散投資コア戦略ファンドA	1,900,880,848円
分散投資コア戦略ファンドS	6,725,988,548円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,376,230,479円

区分	2021年 8月17日現在
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,632,248円
グローバル経済コア	1,188,335,910円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,264,775,793円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	573,404,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	69,224,234円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	153,521,009円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,963,454,508円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	19,414円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	273,052,250	-	273,072,500	20,250
	アメリカドル	273,052,250	-	273,072,500	20,250
	売建	27,995,240,936	-	27,895,291,152	99,949,784
	アメリカドル	27,995,240,936	-	27,895,291,152	99,949,784
合計		28,268,293,186	-	28,168,363,652	99,970,034

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,951,695,521
社債券	41,934,182,560
流動資産合計	43,885,878,081
資産合計	43,885,878,081
負債の部	
流動負債	
未払金	499,731,540

項目	2021年 8月17日現在	
	金額（円）	
未払解約金		1,810,483
未払利息		3,427
流動負債合計		501,545,450
負債合計		501,545,450
純資産の部		
元本等		
元本		40,776,179,295
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		2,608,153,336
元本等合計		43,384,332,631
純資産合計		43,384,332,631
負債純資産合計		43,885,878,081

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2021年 8月17日現在	
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）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。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,776,179,295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 1.0640円 (1万口当たり純資産額) (10,640円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月17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。

	2021年 8月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	34,923,179,852円
期中追加設定元本額	5,988,299,590円
期中一部解約元本額	135,300,147円
期末元本額	40,776,179,295円
期末元本額の内訳	
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	459,160,351円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（SMA専用）	707,991,540円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	19,169,302,177円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	19,610,642,194円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	829,083,033円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 8月17日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	373,163,883
社債券	18,082,084,500
派生商品評価勘定	93,660,000
流動資産合計	18,548,908,383
資産合計	18,548,908,383
負債の部	
流動負債	
未払解約金	973,699
未払利息	655
流動負債合計	974,354
負債合計	974,354
純資産の部	
元本等	
元本	18,847,253,694
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	299,319,665
元本等合計	18,547,934,029
純資産合計	18,547,934,029
負債純資産合計	18,548,908,383

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

2021年 8月17日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,847,253,694口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 299,319,665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 0.9841円 (1万口当たり純資産額) (9,841円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 8月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	25,924,256,698円
期中追加設定元本額	391,678,115円
期中一部解約元本額	7,468,681,119円
期末元本額	18,847,253,694円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,808,371,074円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,194,805,213円
コア投資戦略ファンド（切替型）	866,643,807円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	327,413,832円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	12,253,598,460円
米国株式LSファンド（SMA専用）	496,161,766円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	295,448,402円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	33,223,232円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	571,587,908円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	18,440,402,400	-	18,346,742,400	93,660,000
	アメリカドル	18,440,402,400	-	18,346,742,400	93,660,000
合計		18,440,402,400	-	18,346,742,400	93,660,000

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

貸借対照表

2021年 8月17日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	353,736,138
社債券	20,623,086,000
流動資産合計	20,976,822,138
資産合計	20,976,822,138
負債の部	
流動負債	
未払解約金	161,331,572
未払利息	621
流動負債合計	161,332,193
負債合計	161,332,193
純資産の部	
元本等	
元本	18,184,409,340
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,631,080,605
元本等合計	20,815,489,945
純資産合計	20,815,489,945
負債純資産合計	20,976,822,138

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2021年 8月17日現在	
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券

	2021年 8月17日現在
	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,184,409,340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 1.1447円 (1万口当たり純資産額) (11,447円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	15,707,334,651円
期中追加設定元本額	2,762,344,330円
期中一部解約元本額	285,269,641円
期末元本額	18,184,409,340円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,670,140,800円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,997,970,855円
コア投資戦略ファンド（切替型）	856,409,411円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	325,142,098円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	12,085,700,218円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	283,994,156円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,458,680円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	352,070,291円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	578,522,831円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	291,025,320
社債券	18,856,872,000
流動資産合計	19,147,897,320
資産合計	19,147,897,320
負債の部	
流動負債	
未払解約金	518,428
未払利息	511
流動負債合計	518,939
負債合計	518,939

	2021年 8月17日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	21,531,521,724
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,384,143,343
元本等合計	19,147,378,381
純資産合計	19,147,378,381
負債純資産合計	19,147,897,320

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)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。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,531,521,724口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,384,143,343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 0.8893円 (1万口当たり純資産額) (8,893円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月17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。

	2021年 8月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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	2021年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	19,052,814,135円
期中追加設定元本額	2,567,910,455円
期中一部解約元本額	89,202,866円
期末元本額	21,531,521,724円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	620,000,000円
コア投資戦略ファンド（成長型）	755,000,000円
分散投資コア戦略ファンドA	2,026,367,965円
分散投資コア戦略ファンドS	8,997,719,621円
コア投資戦略ファンド（切替型）	280,000,000円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	159,246,941円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	6,947,531,206円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	100,000,000円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,350,833円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（SMA専用）	257,620,767円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	205,411,306円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,171,273,085円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

2021年 9月30日現在の資本金の額	20億円
発行可能株式総数	12,000株
発行済株式総数	3,000株

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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。

2021年9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	535	14,650,754
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	76	276,621
単体型公社債投資信託	51	304,685
合計	662	15,232,060

(3)【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年11月17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。

5【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。

なお、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。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	（単位：百万円）	
	前事業年度 （2020年3月31日）	当事業年度 （2021年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	24,869	21,589
金銭の信託	5,823	10,857
前払費用	348	397
未収委託者報酬	7,284	8,471
未収運用受託報酬	5,842	6,151
未収収益	190	177
その他	4,624	3,428
流動資産合計	48,983	51,072
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 256	1 301
器具備品	1 576	1 692
その他	1 0	1 0
有形固定資産合計	832	993
無形固定資産		
ソフトウェア	3,030	4,104
その他	40	41
無形固定資産合計	3,070	4,145
投資その他の資産		
投資有価証券	8,469	9,950
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	700	311
その他	35	39
投資その他の資産合計	14,842	15,937
固定資産合計	18,745	21,077
資産合計	67,729	72,149

（単位：百万円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
固定負債		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額	587	791
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824

負債・純資産合計	67,729	72,149
----------	--------	--------

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848

一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31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
当期変動額			

剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	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
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31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
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	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
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	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	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

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、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。

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、決算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) 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。

(2) 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。

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。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

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		当事業年度	
	(2020年3月31日)		(2021年3月31日)	
建 物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
そ の 他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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(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
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

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(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020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

2021年6月23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(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託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金銭の信託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。

金銭の信託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7.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。

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。

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。

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. 金融商品の時価等に関する事項

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（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	24,869	24,869	-
（2）金銭の信託	5,823	5,823	-
（3）未収委託者報酬	7,284	7,284	-
（4）未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	-
（6）未払金	(7,988)	(7,988)	-
（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	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

（*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。

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	21,589	21,589	-
（2）金銭の信託	10,857	10,857	-
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	-

(4) 未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(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	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(*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

現金及び預金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 その他有価証券

投資有価証券の時価について、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

未払金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) 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:百万円)

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

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、「(5)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(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	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	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-
----------------	---	---	-------	---

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

	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	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(2020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:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度(2021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:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(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	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

当事業年度(2021年3月31日)

(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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

(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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020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 (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	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(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	8,412	-	358	358

合計	8,412	-	358	358
----	-------	---	-----	-----

(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	種類	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	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
	合計		5,666	-	114

(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。

当事業年度(2021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 (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	2,889	-	41
	英ポンド	128	-	0
	カナダドル	21	-	0
	スイスフラン	51	-	0
	香港ドル	128	-	1
	ユーロ	246	-	0
	買建			
	米ドル	99	-	1
	香港ドル	2	-	0
	合計	3,567	-	41

(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	13,711	-	315
	合計	13,711	-	315

(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	種類	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	投資有価証券 子会社株式				
	売建					
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(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。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44百万円、当事業年度92百万円であります。

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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

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。

(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 2019年4月1日 至 2020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	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(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 2019年4月1日 至 2020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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員 兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売 代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(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

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。

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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	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	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

（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

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。

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。

（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（2020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（2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	当事業年度 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	当事業年度 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

独立監査人の監査報告書

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員**監査意見**

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第35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。

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2021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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月15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
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

中間監査意見

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」に掲げられているサテライト投資戦略ファンド（株式型）の2021年2月18日から2021年8月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、サテライト投資戦略ファンド（株式型）の2021年8月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年2月18日から2021年8月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。