

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年4月12日提出
【計算期間】	第10期中(自 2021年7月13日至 2022年1月12日)
【ファンド名】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【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、2022年1月31日現在の状況について記載してあります。

【分散投資コア戦略ファンドA】

（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	11,101,223,974	13.67
親投資信託受益証券	日本	62,689,987,919	77.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,426,251,081	9.14
合計(純資産総額)		81,217,462,974	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 (2013年 7月10日)	258,830,299	258,830,299	9,811	9,811
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	16,628,969,770	16,628,969,770	10,208	10,208
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	23,204,975,199	23,204,975,199	10,550	10,550
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	40,992,277,841	40,992,277,841	9,890	9,890
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	47,152,867,522	47,152,867,522	10,297	10,297
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	56,957,731,265	56,957,731,265	10,442	10,442
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	64,206,017,914	64,206,017,914	10,533	10,533
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	69,610,450,591	69,610,450,591	10,401	10,401
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	80,414,109,882	80,414,109,882	11,262	11,262
2021年 1月末日	75,770,981,126		10,925	
2月末日	75,647,116,097		10,936	
3月末日	77,412,534,510		11,064	
4月末日	78,224,175,602		11,171	
5月末日	79,460,590,901		11,237	
6月末日	79,117,926,476		11,237	
7月末日	80,760,783,711		11,262	
8月末日	81,309,193,796		11,285	
9月末日	80,837,129,898		11,210	
10月末日	82,067,637,612		11,309	
11月末日	81,538,113,444		11,271	

12月末日	82,136,503,137		11,306	
2022年 1月末日	81,217,462,974		11,055	

【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	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	1.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	4.0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.3
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	4.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.4
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.3
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8.3
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	0.0

(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。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(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	23,063,936,964	13.35
親投資信託受益証券	日本	139,580,284,204	80.78

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,143,586,459	5.87
合計(純資産総額)		172,787,807,627	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 (2013年 7月10日)	54,287,050	54,287,050	9,915	9,915
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	9,560,643,872	9,560,643,872	10,451	10,451
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	23,718,308,897	23,718,308,897	11,013	11,013
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	40,713,425,166	40,713,425,166	9,845	9,845
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	57,661,475,690	57,661,475,690	10,759	10,759
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	75,431,956,580	75,431,956,580	11,008	11,008
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	89,663,756,248	89,663,756,248	11,109	11,109
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	143,157,363,596	143,157,363,596	10,980	10,980
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	171,466,226,114	171,466,226,114	12,554	12,554
2021年 1月末日	157,800,420,732		11,802	
2月末日	158,194,575,045		11,892	
3月末日	163,042,267,124		12,133	
4月末日	165,732,996,689		12,344	
5月末日	169,267,709,203		12,498	
6月末日	169,479,793,450		12,508	
7月末日	172,254,659,336		12,552	
8月末日	173,806,239,389		12,625	
9月末日	172,176,011,968		12,507	
10月末日	176,992,124,139		12,771	
11月末日	175,175,030,693		12,682	
12月末日	177,548,376,018		12,808	
2022年 1月末日	172,787,807,627		12,366	

【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	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0

第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	5.4
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	5.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	10.6
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.3
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.3
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.2
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.3
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	1.6

(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)

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	469,555,700,120	99.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,011,367,539	0.85
合計(純資産総額)		473,567,067,659	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,891,925,000	0.82

(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。

日本株式最小分散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	3,292,130,420	97.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		77,249,463	2.29
合計(純資産総額)		3,369,379,883	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	75,940,000	2.25

(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。

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	523,382,985,350	83.58
地方債証券	日本	34,222,175,452	5.46
特殊債券	日本	37,196,149,187	5.94
社債券	日本	27,825,498,560	4.44
	フランス	1,400,688,000	0.22
	スペイン	400,568,000	0.06
	オーストラリア	400,260,000	0.06
	小計	30,027,014,560	4.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,414,644,771	0.23
合計(純資産総額)		626,242,969,320	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。

外国債券インデックスマザーファンド（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（％）
国債証券	アメリカ	28,665,236,942	46.91
	フランス	5,898,337,108	9.65
	イタリア	5,251,361,144	8.59
	ドイツ	4,336,948,048	7.10
	イギリス	3,504,639,693	5.74
	スペイン	3,429,483,145	5.61
	ベルギー	1,327,662,869	2.17
	カナダ	1,194,055,824	1.95
	オランダ	1,145,836,251	1.88
	オーストラリア	942,955,627	1.54
	オーストリア	823,702,639	1.35
	中国	665,278,879	1.09
	アイルランド	463,510,982	0.76
	メキシコ	428,478,029	0.70
	フィンランド	352,856,638	0.58
	マレーシア	301,989,774	0.49
	ポーランド	292,096,021	0.48
	シンガポール	267,148,307	0.44
	デンマーク	263,766,033	0.43
	イスラエル	263,723,388	0.43
スウェーデン	169,740,120	0.28	
ノルウェー	146,388,973	0.24	
	小計	60,135,196,434	98.41
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		970,739,191	1.59
合計（純資産総額）		61,105,935,625	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	120,526,575	0.20
	買建	ドイツ	128,604,676	0.21

(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		263,354,162	0.43
	売建		61,383,448,563	100.45

(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。

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	341,975,429,857	67.35
	イギリス	22,216,842,955	4.38
	カナダ	18,311,804,600	3.61
	スイス	16,580,167,848	3.27
	フランス	16,060,406,259	3.16
	ドイツ	13,251,910,051	2.61
	オランダ	9,253,574,211	1.82
	アイルランド	9,061,787,104	1.78
	オーストラリア	8,755,847,955	1.72
	スウェーデン	5,124,947,050	1.01
	デンマーク	3,682,650,526	0.73
	スペイン	3,582,674,993	0.71
	香港	3,260,798,072	0.64
	イタリア	2,820,923,109	0.56
	フィンランド	1,797,930,814	0.35
	ジャージー	1,547,754,147	0.30
	シンガポール	1,535,553,674	0.30
	ベルギー	1,216,687,825	0.24
	バミューダ	1,124,379,474	0.22
	イスラエル	1,061,295,528	0.21
	ノルウェー	1,008,404,264	0.20
	ケイマン	952,694,777	0.19
	キュラソー	490,707,697	0.10
ルクセンブルク	409,122,423	0.08	

	ニュージーランド	395,394,606	0.08
	オーストリア	359,089,350	0.07
	ポルトガル	261,203,784	0.05
	リベリア	165,746,078	0.03
	パナマ	154,431,522	0.03
	マン島	120,710,007	0.02
	小計	486,540,870,560	95.83
投資信託受益証券	オーストラリア	194,323,709	0.04
	香港	84,067,113	0.02
	小計	278,390,822	0.05
投資証券	アメリカ	9,726,594,630	1.92
	オーストラリア	632,520,740	0.12
	イギリス	332,462,910	0.07
	フランス	236,497,871	0.05
	シンガポール	198,638,607	0.04
	香港	168,550,758	0.03
	カナダ	54,946,111	0.01
	小計	11,350,211,627	2.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,561,185,468	1.88
合計(純資産総額)		507,730,658,477	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	6,944,431,728	1.37
	買建	カナダ	386,080,033	0.08
	買建	ドイツ	1,591,782,587	0.31
	買建	イギリス	183,448,409	0.04
	買建	オーストラリア	390,845,952	0.08

(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		489,459,846	0.10

(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。

外国株式最小分散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	11,436,555,923	61.91
	スイス	1,466,480,278	7.94
	カナダ	1,071,059,591	5.80
	ドイツ	454,950,137	2.46
	デンマーク	378,373,267	2.05
	香港	373,463,919	2.02
	アイルランド	343,444,998	1.86
	オーストラリア	267,710,951	1.45
	オランダ	250,856,581	1.36
	シンガポール	215,323,062	1.17
	フランス	214,455,269	1.16
	フィンランド	151,348,843	0.82
	イスラエル	121,526,726	0.66
	ベルギー	119,985,874	0.65
	イギリス	90,167,641	0.49
	ノルウェー	73,875,520	0.40
	スウェーデン	66,666,639	0.36
	イタリア	61,142,937	0.33
	ニュージーランド	58,356,311	0.32
	ポルトガル	35,017,058	0.19
	ルクセンブルク	30,741,987	0.17
スペイン	23,024,376	0.12	
バミューダ	17,972,623	0.10	
ケイマン	14,413,921	0.08	
	小計	17,336,914,432	93.85
投資信託受益証券	香港	50,048,617	0.27
投資証券	アメリカ	437,833,989	2.37
	香港	41,717,548	0.23
	小計	479,551,537	2.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		607,090,138	3.29
合計(純資産総額)		18,473,604,724	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	204,247,992	1.11
	買建	カナダ	136,263,541	0.74

(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	アメリカ	142,545,201,056	46.40
	フランス	29,328,653,142	9.55
	イタリア	26,101,314,401	8.50
	ドイツ	21,499,777,229	7.00
	イギリス	17,425,850,684	5.67
	スペイン	17,047,780,269	5.55
	ベルギー	6,598,895,838	2.15
	カナダ	5,939,641,771	1.93
	オランダ	5,639,980,327	1.84
	オーストラリア	4,689,371,872	1.53
	オーストリア	4,094,512,920	1.33
	中国	2,731,100,907	0.89
	アイルランド	2,299,318,561	0.75
	メキシコ	2,133,132,650	0.69
	フィンランド	1,744,957,052	0.57
	マレーシア	1,499,660,053	0.49
	ポーランド	1,450,750,681	0.47
	シンガポール	1,327,536,132	0.43
	デンマーク	1,312,178,641	0.43
	イスラエル	1,308,230,433	0.43
スウェーデン	845,117,194	0.28	
ノルウェー	728,876,891	0.24	
	小計	298,291,838,704	97.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,894,151,537	2.90
合計(純資産総額)		307,185,990,241	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
債券先物取引	買建	アメリカ	3,004,267,388	0.98
	買建	ドイツ	3,234,724,689	1.05

(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		7,106,809,057	2.31

(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。

新興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	ケイマン	17,477,262,056	16.95
	台湾	15,093,699,970	14.64
	インド	11,955,837,112	11.59
	中国	11,482,587,035	11.14
	韓国	11,346,548,904	11.00
	ブラジル	4,219,325,684	4.09
	サウジアラビア	3,584,352,815	3.48
	南アフリカ	3,077,785,577	2.98
	ロシア	2,759,812,435	2.68
	メキシコ	1,790,317,411	1.74
	タイ	1,637,320,302	1.59
	インドネシア	1,481,926,546	1.44
	マレーシア	1,302,306,485	1.26
	アラブ首長国連邦	1,155,018,594	1.12
	香港	1,074,147,127	1.04

	カタール	829,746,246	0.80
	フィリピン	714,169,277	0.69
	ポーランド	667,274,454	0.65
	クウェート	628,544,370	0.61
	バミューダ	504,328,547	0.49
	チリ	396,910,641	0.38
	アメリカ	310,747,325	0.30
	ハンガリー	251,625,453	0.24
	トルコ	238,607,712	0.23
	ギリシャ	222,786,195	0.22
	コロンビア	189,518,502	0.18
	オランダ	167,770,943	0.16
	チェコ	143,702,139	0.14
	キプロス	129,733,274	0.13
	ルクセンブルク	76,594,578	0.07
	ジャージー	72,496,246	0.07
	エジプト	70,468,180	0.07
	マン島	46,451,539	0.05
	シンガポール	23,087,309	0.02
	英ヴァージン諸島	16,891,786	0.02
	ペルー	15,674,282	0.02
	小計	95,155,377,051	92.28
投資信託受益証券	ブラジル	165,034,834	0.16
	メキシコ	35,251,160	0.03
	小計	200,285,994	0.19
投資証券	南アフリカ	50,836,657	0.05
	メキシコ	35,216,220	0.03
	小計	86,052,877	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,678,619,440	7.45
合計(純資産総額)		103,120,335,362	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,717,584,201	7.48

(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。

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		122,635,225	0.12
	売建		1,432,147	0.00

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

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

新興国債券インデックス 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	中国	8,170,685,349	9.81
	インドネシア	8,024,705,218	9.63
	メキシコ	7,546,823,434	9.06
	タイ	7,292,274,311	8.75
	ブラジル	7,126,658,053	8.55
	マレーシア	7,023,405,615	8.43
	南アフリカ	6,963,468,468	8.36
	ポーランド	5,686,677,749	6.82
	ロシア	5,224,844,112	6.27
	チェコ	3,736,112,816	4.48
	コロンビア	3,200,803,499	3.84
	ハンガリー	2,793,618,348	3.35
	ルーマニア	2,407,739,625	2.89
	ペルー	1,739,476,780	2.09
	チリ	1,625,741,395	1.95
	トルコ	895,566,233	1.07
	ドミニカ共和国	114,473,302	0.14
	フィリピン	109,322,355	0.13
ウルグアイ	95,804,776	0.11	
	小計	79,778,201,438	95.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,544,721,690	4.25
合計(純資産総額)		83,322,923,128	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。

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	105,354,777,000	96.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,033,788,366	3.69
合計(純資産総額)		109,388,565,366	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	4,000,546,000	3.66

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

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

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	72,260,727,321	76.32
	オーストラリア	6,014,525,794	6.35
	イギリス	5,188,404,184	5.48
	シンガポール	3,119,335,327	3.29
	カナダ	1,812,911,150	1.91
	フランス	1,767,530,248	1.87
	香港	1,256,173,261	1.33
	ベルギー	1,211,661,151	1.28
	スペイン	382,728,628	0.40
	ニュージーランド	354,141,729	0.37
	ガーンジー	277,327,776	0.29
	オランダ	178,453,625	0.19
	韓国	164,618,206	0.17
	ドイツ	114,712,226	0.12
	アイルランド	104,811,248	0.11
	イスラエル	85,192,083	0.09
	イタリア	28,888,467	0.03

	小計	94,322,142,424	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		359,440,118	0.38
合計(純資産総額)		94,681,582,542	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		125,920,047	0.13

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

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

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	27,222,774,606	99.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		40,446,301	0.15
合計(純資産総額)		27,263,220,907	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		27,745,912,378	101.77

(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。

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	17,800,860,000	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		164,629,583	0.92
合計(純資産総額)		17,965,489,583	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。

H Fリターン・ターゲット・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(%)
国債証券	日本	6,304,460,400	53.74
投資信託受益証券	アメリカ	630,604,702	5.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,797,215,032	40.89
合計(純資産総額)		11,732,280,134	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	5,073,997,234	43.25
	買建	ドイツ	1,182,256,740	10.08
	買建	イギリス	275,172,614	2.35
	売建	ドイツ	1,754,084,160	14.95
債券先物取引	売建	アメリカ	723,774,557	6.17

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		22,907,565	0.20
	売建		1,706,565,675	14.55

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

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

2【設定及び解約の実績】

【分散投資コア戦略ファンドA】

	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	2013年 3月29日～2013年 7月10日	263,825,167		263,825,167
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	16,300,810,769	274,885,382	16,289,750,554
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	6,829,705,615	1,125,034,771	21,994,421,398
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	21,115,619,373	1,662,548,782	41,447,491,989
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	6,712,164,459	2,368,251,334	45,791,405,114
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	11,384,212,208	2,627,192,900	54,548,424,422
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	9,304,566,486	2,896,398,134	60,956,592,774
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	10,458,038,852	4,487,544,486	66,927,087,140
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8,942,057,064	4,467,543,464	71,401,600,740
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	3,784,940,519	2,069,560,326	73,116,980,933

(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。

【分散投資コア戦略ファンドS】

	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	2013年 3月29日～2013年 7月10日	54,750,331		54,750,331
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	9,258,266,615	164,756,557	9,148,260,389
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	13,807,316,695	1,419,809,778	21,535,767,306
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	22,822,224,799	3,002,745,419	41,355,246,686
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	15,776,145,748	3,537,868,655	53,593,523,779
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	19,014,211,372	4,083,197,323	68,524,537,828
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	17,123,071,331	4,937,538,036	80,710,071,123
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	60,254,110,229	10,583,069,703	130,381,111,649
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	17,432,745,205	11,230,399,627	136,583,457,227
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	7,742,451,712	5,023,134,297	139,302,774,642

(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】

【分散投資コア戦略ファンドA】

(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10期中間計算期間(2021年7月13日から2022年1月12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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,114,065,007	1,421,788,820
投資信託受益証券	14,319,904,876	11,240,693,482
親投資信託受益証券	65,461,331,316	70,125,880,351
流動資産合計	80,895,301,199	82,788,362,653
資産合計	80,895,301,199	82,788,362,653
負債の部		
流動負債		
未払解約金	52,193,497	44,860,972
未払受託者報酬	21,401,889	22,560,042
未払委託者報酬	406,635,814	394,551,114
未払利息	1,700	1,572
その他未払費用	958,417	974,077
流動負債合計	481,191,317	462,947,777
負債合計	481,191,317	462,947,777
純資産の部		
元本等		
元本	71,401,600,740	73,116,980,933
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	9,012,509,142	9,208,433,943
(分配準備積立金)	6,329,338,397	6,150,361,030
元本等合計	80,414,109,882	82,325,414,876
純資産合計	80,414,109,882	82,325,414,876
負債純資産合計	80,895,301,199	82,788,362,653

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 2020年 7月11日 至 2021年 1月10日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
営業収益		
受取利息	2,681	5,409
有価証券売買等損益	4,192,737,117	397,107,930
営業収益合計	4,192,739,798	397,113,339
営業費用		
支払利息	359,363	402,500
受託者報酬	20,125,279	22,560,042
委託者報酬	382,380,237	394,551,114
その他費用	949,732	974,077
営業費用合計	403,814,611	418,487,733
営業利益又は営業損失（ ）	3,788,925,187	21,374,394
経常利益又は経常損失（ ）	3,788,925,187	21,374,394
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,788,925,187	21,374,394
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（ ）	57,001,159	2,689,143
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,683,363,451	9,012,509,142
剰余金増加額又は欠損金減少額	282,691,008	481,209,749
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	282,691,008	481,209,749
剰余金減少額又は欠損金増加額	77,615,607	261,221,411
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	77,615,607	261,221,411
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,620,362,880	9,208,433,943

（ 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	(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。
	(2)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7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第10期中間計算期間は2021年 7月13日から2022年 1月12日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	71,401,600,740口	73,116,980,933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 1.1262円 (1万口当たり純資産額) (11,262円)	1口当たり純資産額 1.1259円 (1万口当たり純資産額) (11,259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10期中間計算期間 (2022年 1月12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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第10期中間計算期間 (2022年 1月12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>「(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> <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	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	66,927,087,140円	71,401,600,740円
期中追加設定元本額	8,942,057,064円	3,784,940,519円
期中一部解約元本額	4,467,543,464円	2,069,560,326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。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(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10期中間計算期間(2021年7月13日から2022年1月12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せん。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,648,918,734	2,800,764,865
投資信託受益証券	26,035,961,567	23,365,292,388
親投資信託受益証券	143,931,416,850	152,629,924,429
流動資産合計	172,616,297,151	178,795,981,682
資産合計	172,616,297,151	178,795,981,682
負債の部		
流動負債		
未払解約金	244,208,892	207,235,853
未払受託者報酬	45,233,071	48,375,185
未払委託者報酬	859,428,294	845,696,204
未払利息	4,042	3,097
その他未払費用	1,196,738	1,232,228
流動負債合計	1,150,071,037	1,102,542,567
負債合計	1,150,071,037	1,102,542,567
純資産の部		
元本等		
元本	136,583,457,227	139,302,774,642
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	34,882,768,887	38,390,664,473
(分配準備積立金)	20,563,834,888	19,828,205,820
元本等合計	171,466,226,114	177,693,439,115
純資産合計	171,466,226,114	177,693,439,115
負債純資産合計	172,616,297,151	178,795,981,682

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 2020年 7月11日 至 2021年 1月10日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
営業収益		
受取利息	6,806	11,860
有価証券売買等損益	12,617,855,427	3,686,341,711
営業収益合計	12,617,862,233	3,686,353,571
営業費用		
支払利息	813,404	858,861
受託者報酬	41,531,362	48,375,185
委託者報酬	789,095,840	845,696,204
その他費用	1,163,789	1,232,228
営業費用合計	832,604,395	896,162,478
営業利益又は営業損失（ ）	11,785,257,838	2,790,191,093
経常利益又は経常損失（ ）	11,785,257,838	2,790,191,093
中間純利益又は中間純損失（ ）	11,785,257,838	2,790,191,093
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（ ）	205,882,945	48,976,788
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,776,251,947	34,882,768,887
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,091,969,702	2,050,165,877
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,091,969,702	2,050,165,877
剰余金減少額又は欠損金増加額	493,654,101	1,283,484,596
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	493,654,101	1,283,484,596
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	24,953,942,441	38,390,664,473

（ 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	(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。
	(2)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7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第10期中間計算期間は2021年 7月13日から2022年 1月12日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	136,583,457,227口	139,302,774,642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 1.2554円 (1万口当たり純資産額) (12,554円)	1口当たり純資産額 1.2756円 (1万口当たり純資産額) (12,756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10期中間計算期間 (2022年 1月12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

	第10期中間計算期間 (2022年 1月12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>「(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> <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	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	130,381,111,649円	136,583,457,227円
期中追加設定元本額	17,432,745,205円	7,742,451,712円
期中一部解約元本額	11,230,399,627円	5,023,134,297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。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,793,843,532
株式	498,456,743,930
派生商品評価勘定	43,463,050
未収入金	188,900
未収配当金	671,733,733
差入委託証拠金	186,595,000
流動資産合計	502,152,568,145
資産合計	502,152,568,145
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,511,600
前受金	40,965,200
未払解約金	14,911,758
未払利息	3,090
流動負債合計	58,391,648
負債合計	58,391,648
純資産の部	
元本等	
元本	254,912,335,585
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	247,181,840,912
元本等合計	502,094,176,497
純資産合計	502,094,176,497
負債純資産合計	502,152,568,145

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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。 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。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

	2022年 1月12日現在
	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。
	(2)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）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	254,912,335,585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 1.9697円 (1万口当たり純資産額) (19,697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

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	251,095,419,520円
期中追加設定元本額	15,280,837,513円
期中一部解約元本額	11,463,921,448円
期末元本額	254,912,335,585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）	409,148,377円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,912,217,633円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,706,836円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,110,098,633円
世界経済インデックスファンド	3,468,960,234円
日本株式インデックス・オープン	3,380,060,608円
DCマイセレクション25	6,095,117,706円
DCマイセレクション50	18,213,271,233円
DCマイセレクション75	18,384,403,235円
DC日本株式インデックス・オープン	6,009,404,826円
DCマイセレクションS25	3,010,347,389円
DCマイセレクションS50	8,772,925,494円
DCマイセレクションS75	6,481,795,000円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,987,333,593円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	223,802,659円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	700,161,634円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	502,471,126円
DC世界経済インデックスファンド	3,446,023,676円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,684,014,069円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	5,883,786円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	18,858,291円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,644,035円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	190,402,821円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,239,914円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	33,959,121円

区分	2022年 1月12日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	127,038,697円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,932,294円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	85,912,603円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	980,241,278円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	446,910,304円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,923,370,310円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	82,540,954円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,535,537円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	512,973,451円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	284,154,590円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	367,514,708円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	37,133,693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）	594,149,189円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,528,653,872円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,898,234,978円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,344,624,777円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,711,030,971円
分散投資コア戦略ファンドA	1,375,097,034円
分散投資コア戦略ファンドS	5,791,455,986円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	448,635,304円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	407,357,050円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,995,884,669円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	216,662,052円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,730,001円
SMT インデックスバランス・オープン	58,330,055円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	26,688,154,154円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	559,164,334円
SMT 世界経済インデックス・オープン	41,435,161円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	149,231,141円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	28,210,413円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,252,198円
グローバル経済コア	215,936,253円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,332,753円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	87,104,996円
DCターゲット・イヤーフンド2055	20,538,695円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,270,588,596円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	167,409,376円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	6,344,728円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	4,286,783円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	2,215,109円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	2,359,610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）	42,851,783,952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）	1,051,294,071円

区分	2022年 1月12日現在
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	251,825,101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)	44,545,867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)	85,775,952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)	47,752,560,249円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	10,373,557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)	228,256,250円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2022年 1月12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	3,290,384,800	-	3,331,350,000	40,965,200
合計		3,290,384,800	-	3,331,350,000	40,965,200

(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。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	69,649,437
株式	3,450,841,280
派生商品評価勘定	898,350
未収配当金	7,330,075
差入委託証拠金	3,405,000
流動資産合計	3,532,124,142
資産合計	3,532,124,142
負債の部	
流動負債	
前受金	900,000
未払利息	77
流動負債合計	900,077
負債合計	900,077
純資産の部	
元本等	
元本	2,977,004,834

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	554,219,231
元本等合計	3,531,224,065
純資産合計	3,531,224,065
負債純資産合計	3,532,124,142

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12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>
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>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、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</p> <p>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</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)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,977,004,834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	<p>1口当たり純資産額 1.1862円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (11,862円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	4,074,360,095円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	1,097,355,261円
期末元本額	2,977,004,834円
期末元本額の内訳	

区分	2022年 1月12日現在
分散投資コア戦略ファンドA	564,917,885円
分散投資コア戦略ファンドS	2,412,086,949円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 1月12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	59,670,000	-	60,570,000	900,000
	合計	59,670,000	-	60,570,000	900,000

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	330,770,115
国債証券	543,496,288,700
地方債証券	35,580,401,694
特殊債券	39,253,559,760
社債券	30,004,776,340
未収利息	981,683,114
前払費用	14,746,929
流動資産合計	649,662,226,652
資産合計	649,662,226,652
負債の部	
流動負債	
未払解約金	203,723,177
未払利息	365
流動負債合計	203,723,542
負債合計	203,723,542
純資産の部	
元本等	
元本	462,034,756,241
剰余金	
剰余金又は欠損金()	187,423,746,869
元本等合計	649,458,503,110

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
純資産合計	649,458,503,110
負債純資産合計	649,662,226,652

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <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>
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>債券先物取引</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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	462,034,756,241口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 100,773,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4056円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,056円)</p>

（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）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	451,320,574,372円
期中追加設定元本額	36,015,487,850円
期中一部解約元本額	25,301,305,981円
期末元本額	462,034,756,241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
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,912,151,267円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,074,659円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,041,299,194円
世界経済インデックスファンド	3,305,025,968円
D C マイセクション 2 5	25,198,836,335円
D C マイセクション 5 0	28,674,865,601円

区分	2022年 1月12日現在
D Cマイセレクション7 5	8,409,412,961円
D C日本債券インデックス・オープン	443,010,317円
D C日本債券インデックス・オープンS	93,110,428,516円
D C日本債券インデックス・オープンP	68,242,788,958円
D CマイセレクションS 2 5	12,244,638,648円
D CマイセレクションS 5 0	13,682,412,557円
D CマイセレクションS 7 5	2,936,551,895円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	886,635,958円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	2,082,144,575円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	761,876,348円
D C世界経済インデックスファンド	3,185,514,563円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	8,509,448円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,561,112円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	30,963,756円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,687,330円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,065,314円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	100,447,098円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	143,552,871円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	34,399,011円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	33,251,587円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,148,536,964円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	782,141,912円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,311,250,407円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	136,925,207円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	80,708,395円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,059,903,545円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,173,460,970円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,495,057,344円
国内バランス2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	145,270,376円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,819,118,506円
日本債券ファンド・シリーズ1	14,984,348,946円
分散投資コア戦略ファンドA	25,923,818,430円
分散投資コア戦略ファンドS	32,971,011,995円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	147,376,257円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,309,790,895円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	62,839,865円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,559,922円
S M T インデックスバランス・オープン	58,541,120円
S M T 世界経済インデックス・オープン	31,933,357円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	60,742,974円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	100,843,078円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	8,197,953円
グローバル経済コア	227,719,225円

区分	2022年 1月12日現在
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	27,023,819円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5	14,840,701円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 3 0	10,264,887円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 4 0	4,490,071円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 5 0	1,501,775円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 6 0	964,237円
F O F s 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）	80,983,769,735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）	75,137,645円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	9,633,063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）	330,699,578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。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	12,834,528
コール・ローン	207,551,315
国債証券	52,030,976,017
派生商品評価勘定	20,155,808
未収入金	2,006
未収利息	209,481,971
前払金	3,285,986
前払費用	89,566,730
差入委託証拠金	35,443,935
流動資産合計	52,609,298,296
資産合計	52,609,298,296
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	173,244,449
未払金	529,153
未払利息	229
流動負債合計	173,773,831
負債合計	173,773,831
純資産の部	
元本等	
元本	52,136,560,551
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	298,963,914
元本等合計	52,435,524,465
純資産合計	52,435,524,465

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	52,609,298,296

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <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>
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>債券先物取引</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)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>(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）

		2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		52,136,560,551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)	1.0057円 (10,057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

		2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2022年 1月12日現在
期首	2021年 7月13日
期首元本額	29,670,453,340円
期中追加設定元本額	30,671,445,608円
期中一部解約元本額	8,205,338,397円
期末元本額	52,136,560,551円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	8,951,827,409円
分散投資コア戦略ファンドS	11,334,951,285円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	8,713,972,100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）	1,715,136,806円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,069,272,684円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	3,210,239,536円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,116,598,231円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,097,872,490円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	2,958,132,518円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	2,912,064,048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2021-11（適格機関投資家専用）	3,056,493,444円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 1月12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	債券先物取引 買建	190,420,108	-	187,134,122	3,285,986
	合計	190,420,108	-	187,134,122	3,285,986

(注)1.時価の算定方法

債券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.債券先物取引の残高は、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

（2022年 1月12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				
	売建	52,813,245,618	-	52,963,048,273	149,802,655
	アメリカドル	25,189,946,485	-	25,169,979,251	19,967,234
	カナダドル	1,055,826,912	-	1,070,711,997	14,885,085
	メキシコペソ	379,053,470	-	381,565,103	2,511,633
	ユーロ	20,335,432,038	-	20,441,911,769	106,479,731
	イギリスポンド	3,141,549,825	-	3,177,813,081	36,263,256
	スウェーデンクローナ	153,705,591	-	154,753,020	1,047,429
	ノルウェークローネ	130,507,952	-	132,156,520	1,648,568
	デンマーククローネ	232,623,282	-	233,650,390	1,027,108
	ポーランドズロチ	257,837,818	-	261,538,241	3,700,423
	オーストラリアドル	849,807,821	-	851,366,460	1,558,639
	シンガポールドル	235,010,264	-	235,481,159	470,895
	マレーシアリングット	261,813,296	-	261,943,404	130,108
	イスラエルシェケル	242,062,392	-	242,297,980	235,588
	香港・オフショア 人民元	348,068,472	-	347,879,898	188,574
合計		52,813,245,618	-	52,963,048,273	149,802,655

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	11,569,813,098
コール・ローン	590,630,268
株式	517,348,931,867
投資信託受益証券	289,633,995
投資証券	11,848,677,775
派生商品評価勘定	129,941,852
未収入金	407,939
未収配当金	362,927,831

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	1,652,866,107
流動資産合計	543,793,830,732
資産合計	543,793,830,732
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,089,658
前受金	122,092,810
未払解約金	342,624,364
未払利息	653
流動負債合計	472,807,485
負債合計	472,807,485
純資産の部	
元本等	
元本	126,388,032,327
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	416,932,990,920
元本等合計	543,321,023,247
純資産合計	543,321,023,247
負債純資産合計	543,793,830,732

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>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> <p>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) 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。 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>(1) 先物取引</p>

2022年 1月12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、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 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 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。 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 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 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)

2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	126,388,032,327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 4.2988円 (1万口当たり純資産額) (42,988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

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	137,442,391,078円
期中追加設定元本額	7,110,885,134円
期中一部解約元本額	18,165,243,885円
期末元本額	126,388,032,327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）	1,891,762,243円

区分	2022年 1月12日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,092,804円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	30,002,379,096円
世界経済インデックスファンド	9,591,360,832円
外国株式インデックス・オープン	843,226,061円
D C マイセレクション 2 5	820,086,465円
D C マイセレクション 5 0	3,845,003,450円
D C マイセレクション 7 5	4,403,353,647円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,634,911,297円
D C マイセレクション S 2 5	397,745,316円
D C マイセレクション S 5 0	1,820,498,982円
D C マイセレクション S 7 5	1,524,272,954円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	52,466,797円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	165,407,612円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	118,682,719円
D C 世界経済インデックスファンド	9,583,721,707円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,679,053,410円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,135,155円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	4,613,649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）	30,790,065円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	16,645,660円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	59,529,571円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	11,656,656円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	38,621,871円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	316,336,596円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	186,733,308円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,370,578,580円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	184,622,985円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	35,625,550円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	181,956,985円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	60,913,654円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,153,399,892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）	1,207,148,164円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,153,378,632円
コア投資戦略ファンド（安定型）	709,679,705円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,532,976,315円
分散投資コア戦略ファンド A	1,458,128,299円
分散投資コア戦略ファンド S	8,127,220,507円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,245,950,201円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,082,122,391円
コア投資戦略ファンド（切替型）	651,450,787円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	604,522,822円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,685,039円
S M T インデックスバランス・オープン	159,679,384円

区分	2022年 1月12日現在
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	431,357,615円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	18,442,493,395円
SMT 世界経済インデックス・オープン	173,749,675円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	638,583,403円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	124,486,649円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,770,269円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	151,011,141円
グローバル経済コア	650,696,969円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,528,845円
DCターゲット・イヤーフンド2055	4,851,911円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	480,458,252円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	62,506,125円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	17,846,419円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	12,037,372円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	6,172,110円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	6,743,385円
FOFs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）	342,392,345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）	514,553,693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）	1,056,969,575円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,087,925,268円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	193,549,637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）	107,479,151円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	44,337,473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）	79,923,650円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	269,423,198円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	260,033,035円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	252,448,023円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	250,931,421円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	259,631,356円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	255,658,802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2021-11（適格機関投資家専用）	194,354,350円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,584,967,928	-	122,092,810

合計	9,584,967,928	-	9,707,060,738	122,092,810
----	---------------	---	---------------	-------------

(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

(2022年 1月12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	205,287,400	-	205,303,064	15,664
	アメリカドル	205,287,400	-	205,303,064	15,664
	売建	4,002,455,400	-	4,002,711,680	256,280
	アメリカドル	2,848,651,000	-	2,848,838,720	187,720
	カナダドル	458,820,000	-	458,841,000	21,000
	ユーロ	380,410,400	-	380,457,960	47,560
	イギリスポンド	314,574,000	-	314,574,000	-
	合計	4,207,742,800	-	4,208,014,744	240,616

(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。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	512,931,887
コール・ローン	4,333,719
株式	18,097,996,456
投資信託受益証券	50,095,928
投資証券	493,526,764
派生商品評価勘定	6,419,838
未収配当金	10,085,417

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	93,593,269
流動資産合計	19,268,983,278
資産合計	19,268,983,278
負債の部	
流動負債	
前受金	6,419,838
未払利息	4
流動負債合計	6,419,842
負債合計	6,419,842
純資産の部	
元本等	
元本	12,349,510,928
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,913,052,508
元本等合計	19,262,563,436
純資産合計	19,262,563,436
負債純資産合計	19,268,983,278

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12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 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) 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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 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、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>

	2022年 1月12日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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、当該先物取引に係るものであります。</p> <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）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,349,510,928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 1.5598円 (1万口当たり純資産額) (15,598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

	2022年 1月12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。

2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	13,765,562,898円
期中追加設定元本額	14,953,141円
期中一部解約元本額	1,431,005,111円
期末元本額	12,349,510,928円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,154,504,393円
分散投資コア戦略ファンドS	6,478,776,127円
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	4,716,230,408円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 1月12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	352,412,667	-	358,832,505	6,419,838
	合計	352,412,667	-	358,832,505	6,419,838

(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はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	117,806,590
コール・ローン	5,149,668,698
国債証券	301,405,992,432
派生商品評価勘定	348,918
未収入金	105,713,688
未収利息	1,712,797,460
前払金	82,153,575
前払費用	86,337,598
差入委託証拠金	405,374,421
流動資産合計	309,066,193,380
資産合計	309,066,193,380
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	82,570,693
未払金	1,806,097
未払解約金	21,019,042
未払利息	5,695
流動負債合計	105,401,527
負債合計	105,401,527
純資産の部	
元本等	
元本	99,685,230,468
剰余金	
剰余金又は欠損金()	209,275,561,385
元本等合計	308,960,791,853

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
純資産合計	308,960,791,853
負債純資産合計	309,066,193,380

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <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>
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>債券先物取引</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) 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>(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）

	2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		99,685,230,468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)	3.0994円 (30,994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

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	100,722,788,748円
期中追加設定元本額	8,518,813,088円
期中一部解約元本額	9,556,371,368円
期末元本額	99,685,230,468円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,359,406,254円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	587,200,239円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,126,889,046円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,559,039円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,055,889,863円
世界経済インデックスファンド	12,327,221,029円
D C マイセレクション 2 5	1,914,304,480円
D C マイセレクション 5 0	1,635,555,712円
D C マイセレクション 7 5	1,138,307,466円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,261,500,503円
D C マイセレクション S 2 5	908,334,505円
D C マイセレクション S 5 0	720,368,107円
D C マイセレクション S 7 5	393,686,027円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	33,957,402円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	88,476,999円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	44,821,688円
D C 世界経済インデックスファンド	12,144,912,659円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	656,333,379円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,796,206円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,288,528円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	28,050,554円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	51,768,994円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	80,521,477円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	77,774,842円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	85,922,076円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,405,317,665円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	458,367,951円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,826,513,457円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	128,983,133円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	58,059,740円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	475,243,560円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	172,815,760円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	221,575,729円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	757,627,819円

区分	2022年 1月12日現在
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	2,053,631,937円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	722,945,345円
外国債券ファンド・シリーズ1	668,108,761円
コア投資戦略ファンド（安定型）	681,973,907円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,818,091,465円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	511,744,320円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,876,029,053円
コア投資戦略ファンド（切替型）	765,503,795円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	245,765,378円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,740,816円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,365,614,613円
SMT インデックスバランス・オープン	197,099,847円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	18,808,266,051円
SMT 世界経済インデックス・オープン	222,647,037円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	266,519,326円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	442,983,184円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,174,977円
グローバル経済コア	835,795,411円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,648,633円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,418,508円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	230,570,686円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,915,195円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,565,496円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	5,475,002円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,158,641円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,727,009円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	379,455,229円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,843,053,587円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	334,312,096円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	334,047,311円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	312,860,878円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	59,170,257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）	81,660,120円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 1月12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	債券先物取引 買建	5,319,145,264	-	5,236,991,689	82,153,575
	合計	5,319,145,264	-	5,236,991,689	82,153,575

(注)1.時価の算定方法

債券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.債券先物取引の残高は、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

(2022年 1月12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	5,294,588,860	-	5,294,520,660	68,200
	アメリカドル	2,596,619,056	-	2,596,540,236	78,820
	カナダドル	206,417,025	-	206,412,525	4,500
	ユーロ	2,153,490,864	-	2,153,507,274	16,410
	イギリスポンド	338,061,915	-	338,060,625	1,290
	合計	5,294,588,860	-	5,294,520,660	68,200

(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。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,050,919,095
コール・ローン	59,101,930
株式	99,274,801,018
投資信託受益証券	183,402,016
投資証券	88,021,637

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	219,798,599
未収入金	1,778,138
未収配当金	71,079,973
差入委託証拠金	1,206,794,306
流動資産合計	107,155,696,712
資産合計	107,155,696,712
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,142
前受金	219,760,185
未払金	9,393
未払解約金	9,860,121
未払利息	65
流動負債合計	229,660,906
負債合計	229,660,906
純資産の部	
元本等	
元本	28,792,469,784
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	78,133,566,022
元本等合計	106,926,035,806
純資産合計	106,926,035,806
負債純資産合計	107,155,696,712

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12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 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) 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>

2022年 1月12日現在	
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 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、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。 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)

2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,792,469,784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 3.7137円 (1万口当たり純資産額) (37,137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

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	26,523,301,434円
期中追加設定元本額	2,875,819,874円
期中一部解約元本額	606,651,524円
期末元本額	28,792,469,784円
期末元本額の内訳	

区分	2022年 1月12日現在
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,629,877,452円
世界経済インデックスファンド	5,211,086,063円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,173,263,711円
D C 世界経済インデックスファンド	5,094,661,766円
新興国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	209,353,519円
分散投資コア戦略ファンドA	223,488,884円
分散投資コア戦略ファンドS	1,291,777,359円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	688,094,245円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	581,552,507円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	329,964,821円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	16,076,659円
S M T インデックスバランス・オープン	82,012,785円
S M T 世界経済インデックス・オープン	139,649,878円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	525,678,598円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	94,611,069円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,658,703円
グローバル経済コア	349,659,264円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	38,569,491円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	9,935,467円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	6,706,429円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	3,447,242円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,717,176円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	884,949,857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)	153,113,538円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	37,074,170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)	10,489,131円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2022年 1月12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	株価指数先物取引 買建	7,211,327,272	-	7,431,087,457	219,760,185
	合計	7,211,327,272	-	7,431,087,457	219,760,185

(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はありません。

通貨関連

（2022年 1月12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	103,797,000	-	103,804,272	7,272
	アメリカドル	103,797,000	-	103,804,272	7,272
合計		103,797,000	-	103,804,272	7,272

(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はありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	738,626,352
コール・ローン	630,115,262
国債証券	80,249,870,929
未収入金	180,369,836
未収利息	1,036,501,977
前払費用	168,507,196
流動資産合計	83,003,991,552
資産合計	83,003,991,552
負債の部	
流動負債	
未払金	103,880,700
未払解約金	11,904,409
未払利息	696
流動負債合計	115,785,805
負債合計	115,785,805
純資産の部	
元本等	
元本	47,173,566,586
剰余金	
剰余金又は欠損金()	35,714,639,161
元本等合計	82,888,205,747
純資産合計	82,888,205,747

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	83,003,991,552

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <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>
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>
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>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)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,173,566,586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	<p>1口当たり純資産額 1.7571円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,571円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	40,865,028,836円
期中追加設定元本額	6,993,968,425円
期中一部解約元本額	685,430,675円
期末元本額	47,173,566,586円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,089,921,768円
世界経済インデックスファンド	10,867,249,252円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,038,636,515円
DC世界経済インデックスファンド	10,339,939,668円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,801,849,154円
コア投資戦略ファンド(安定型)	146,670,330円
コア投資戦略ファンド(成長型)	399,809,303円

区分	2022年 1月12日現在
新興国債券インデックス・オープン(S M A 専用)	73,922,284円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	424,048,192円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,298,369,731円
コア投資戦略ファンド(切替型)	148,300,289円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	203,092,501円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	91,360,929円
S M T インデックスバランス・オープン	165,983,998円
外国債券S M T Bセレクション(S M A 専用)	3,971,420,056円
S M T 世界経済インデックス・オープン	291,531,565円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	347,791,692円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	582,519,790円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,232,732円
グローバル経済コア	729,545,311円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	43,103,997円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	5,601,256円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	10,546,104円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	6,579,184円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	3,221,852円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,323,599円
F O F s 用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	78,698,004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)	404,956,181円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	77,566,626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)	16,098,054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)	300,810,171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)	311,357,275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)	302,274,976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)	300,458,970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)	289,902,869円
S M T A M 海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	285,373,626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。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,339,964,597
投資証券	106,345,480,300
未収配当金	721,609,564
前払金	22,748,000
差入委託証拠金	191,290,000
流動資産合計	110,621,092,461
資産合計	110,621,092,461
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,748,000
未払金	114,593,795
未払解約金	649,149
未払利息	3,694
流動負債合計	137,994,638
負債合計	137,994,638
純資産の部	
元本等	
元本	51,340,136,228
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,142,961,595
元本等合計	110,483,097,823
純資産合計	110,483,097,823
負債純資産合計	110,621,092,461

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12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>
3.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>

	2022年 1月12日現在
	(2)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）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	51,340,136,228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 2.1520円 (1万口当たり純資産額) (21,520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

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	49,323,843,791円
期中追加設定元本額	5,824,476,010円
期中一部解約元本額	3,808,183,573円
期末元本額	51,340,136,228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）	1,663,318,244円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,854,508円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,902,294,276円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	24,009,371,343円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,263,376,555円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,858,973,308円
分散投資コア戦略ファンドA	720,122,850円
分散投資コア戦略ファンドS	1,541,414,897円
コア投資戦略ファンド（切替型）	791,804,026円
S M T インデックスバランス・オープン	26,560,116円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	255,743,577円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,360,999円
グローバル経済コア	237,819,335円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,962,246円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	441,288,869円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	59,301,346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）	480,209,438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）	16,304,525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）	527,406,533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）	74,350,626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）	878,271,875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）	265,671,600円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	302,355,136円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2022年 1月12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	4,149,442,000	-	4,126,694,000	22,748,000
	合計	4,149,442,000	-	4,126,694,000	22,748,000

(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

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	536,017,028
コール・ローン	69,836,860
投資証券	100,448,523,144
派生商品評価勘定	2,280
未収入金	4,939,519,254
未収配当金	293,270,435
流動資産合計	106,287,169,001
資産合計	106,287,169,001
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,098,208
未払金	1,275,318
未払解約金	5,197,113,003
未払利息	77
流動負債合計	5,203,486,606
負債合計	5,203,486,606
純資産の部	
元本等	
元本	39,466,464,420
剰余金	
剰余金又は欠損金()	61,617,217,975
元本等合計	101,083,682,395
純資産合計	101,083,682,395
負債純資産合計	106,287,169,001

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12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)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,466,464,420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 2.5613円 (1万口当たり純資産額) (25,613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

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	41,364,083,335円
期中追加設定元本額	4,456,095,870円
期中一部解約元本額	6,353,714,785円
期末元本額	39,466,464,420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	61,766,844円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	97,873,344円

区分	2022年 1月12日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,688,421,461円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,841,023円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	11,911,777,227円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	16,749,132,560円
コア投資戦略ファンド（安定型）	709,208,254円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,597,861,481円
分散投資コア戦略ファンドA	680,511,872円
分散投資コア戦略ファンドS	1,463,074,073円
コア投資戦略ファンド（切替型）	661,940,906円
S M T インデックスバランス・オープン	139,992,472円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	214,485,652円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,416,285円
グローバル経済コア	232,545,072円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	11,239,225円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	382,414,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	50,672,643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）	1,380,441,209円
F O F s 用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	349,889,730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）	144,251,705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）	77,675,076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）	46,397,182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）	115,466,049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）	110,748,209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）	107,517,416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）	106,871,710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）	111,276,286円
S M T A M海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	109,554,738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2021-11（適格機関投資家専用）	141,199,719円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 1月12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	34,599,000	-	34,601,280	2,280
	アメリカドル	34,599,000	-	34,601,280	2,280
	売建	5,116,720,010	-	5,121,818,218	5,098,208
	アメリカドル	3,921,220,000	-	3,921,519,200	299,200

カナダドル	122,952,600	-	123,888,285	935,685
ユーロ	205,184,870	-	205,970,184	785,314
イギリスポンド	281,932,200	-	283,119,300	1,187,100
オーストラリアドル	348,222,000	-	349,398,000	1,176,000
ニュージーランドドル	19,516,500	-	19,579,475	62,975
香港ドル	57,688,800	-	57,718,830	30,030
シンガポールドル	160,003,040	-	160,624,944	621,904
合計	5,151,319,010	-	5,156,419,498	5,095,928

(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

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	29,375,477
コール・ローン	65,777,838
投資信託受益証券	28,270,717,804
派生商品評価勘定	22,125,374
流動資産合計	28,387,996,493
資産合計	28,387,996,493
負債の部	
流動負債	
未払金	2,869,350
未払解約金	6,805,569
未払利息	72
流動負債合計	9,674,991
負債合計	9,674,991
純資産の部	
元本等	
元本	22,342,212,888
剰余金	
剰余金又は欠損金()	6,036,108,614
元本等合計	28,378,321,502
純資産合計	28,378,321,502
負債純資産合計	28,387,996,493

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</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>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)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,342,212,888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	<p>1口当たり純資産額 1.2702円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,702円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	28,562,552,203円
期中追加設定元本額	1,988,297,609円
期中一部解約元本額	8,208,636,924円
期末元本額	22,342,212,888円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,210,009,688円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,275,277,651円
分散投資コア戦略ファンドA	1,942,701,798円
分散投資コア戦略ファンドS	7,022,243,579円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,353,134,012円

区分	2022年 1月12日現在
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	517,515,815円
グローバル経済コア	863,927,699円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,564,087,825円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	678,991,983円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	88,396,614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）	228,710,610円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,522,000,563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）	75,215,051円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 1月12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	28,028,161,148	-	28,006,035,774	22,125,374
	アメリカドル	28,028,161,148	-	28,006,035,774	22,125,374
合計		28,028,161,148	-	28,006,035,774	22,125,374

(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。

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

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	134,785,468
社債券	19,914,293,000
流動資産合計	20,049,078,468
資産合計	20,049,078,468
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,597,522
未払利息	149
流動負債合計	1,597,671

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
負債合計	1,597,671
純資産の部	
元本等	
元本	23,676,450,353
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,628,969,556
元本等合計	20,047,480,797
純資産合計	20,047,480,797
負債純資産合計	20,049,078,468

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12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）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,676,450,353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 3,628,969,556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 0.8467円 (1万口当たり純資産額) (8,467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

	2022年 1月12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

	2022年 1月12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>「(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> <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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	21,125,701,112円
期中追加設定元本額	3,516,659,847円
期中一部解約元本額	965,910,606円
期末元本額	23,676,450,353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	2,451,736,764円
分散投資コア戦略ファンドS	10,130,805,762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)	147,960,259円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	7,294,191,710円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	122,244,049円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	15,915,197円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	249,266,249円
F O F s 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)	198,246,469円

区分	2022年 1月12日現在
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）	1,411,083,894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。

H Fリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

項目	2022年 1月12日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	459,107
コール・ローン	3,157,683,270
国債証券	6,305,556,600
投資信託受益証券	612,004,535
派生商品評価勘定	75,620,070
未収入金	25,174,574
差入委託証拠金	1,593,065,672
流動資産合計	11,769,563,828
資産合計	11,769,563,828
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	63,568,881
前受金	12,062,231
未払金	36,148,979
未払解約金	1,031,202
未払利息	3,492
流動負債合計	112,814,785
負債合計	112,814,785
純資産の部	
元本等	
元本	11,820,789,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	164,040,220
元本等合計	11,656,749,043
純資産合計	11,656,749,043
負債純資産合計	11,769,563,828

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 国債証券

	<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> <p>(2)投資信託受益証券</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>株価指数先物取引及び債券先物取引</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>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)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,820,789,263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	164,040,220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 (1万口当たり純資産額)	0.9861円 (9,861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

	2022年 1月12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	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2021年 10月20日

期首元本額	11,300,495,000円
期中追加設定元本額	525,725,983円
期中一部解約元本額	5,431,720円
期末元本額	11,820,789,263円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	3,414,628,132円
分散投資コア戦略ファンドS	3,684,178,339円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	4,589,623,200円
HFリターン・ターゲット・ファンド・為替ヘッジあり(SMA専用)	132,359,592円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2022年 1月12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	6,672,488,591	-	6,721,571,419	49,082,828
	売建	1,739,098,582	-	1,779,036,902	39,938,320
合計		8,411,587,173	-	8,500,608,321	9,144,508

(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。

債券関連

(2022年 1月12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	債券先物取引				
	売建	698,920,760	-	696,003,037	2,917,723
合計		698,920,760	-	696,003,037	2,917,723

(注)1. 時価の算定方法

債券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. 債券先物取引の残高は、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はありません。

通貨関連

（2022年 1月12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	22,400,008	-	22,400,700	692
	カナダドル	15,320,830	-	15,320,580	250
	スウェーデンク ローナ	7,079,178	-	7,080,120	942
	売建	2,237,817,345	-	2,237,829,079	11,734
	アメリカドル	1,869,882,867	-	1,869,879,779	3,088
	ユーロ	119,806,599	-	119,812,990	6,391
	イギリスポンド	147,012,668	-	147,019,400	6,732
	スイスフラン	101,115,211	-	101,116,910	1,699
合計	2,260,217,353	-	2,260,229,779	11,042	

(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はありません。

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

2022年 1月31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。

2022年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	14,928,919
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	70	247,727
単体型公社債投資信託	55	301,731
合計	658	15,478,377

（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

2022年 4月12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。

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

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、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、第35期事業年度（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。

また、第36期事業年度の中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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：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		
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		

その他の有価証券評価差額	587	791
金		
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 （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）

	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	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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
	建 物	77	百万円	106
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	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
合計		3,567	-	41	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	315
合計		13,711	-	315	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 売建	投資有価証券 子会社株式				
	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る原因別の内訳

	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おります。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(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	三井住友	東京都		信託業務及び		営業上の取引	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176

の子会社	信託銀行(株)	千代田区	342,037	銀行業務	-	役員の兼任	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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	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いません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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

中間貸借対照表

（単位：百万円）

第36期中間会計期間末

（2021年9月30日）

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		18,523
金銭の信託		15,986
未収委託者報酬		9,080
未収運用受託報酬		6,066
その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

（単位：百万円）

第36期中間会計期間末

（2021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	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	39,182
利益剰余金合計	41,782
株主資本合計	61,022
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	995
繰延ヘッジ損益	78
評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

中間損益計算書

(単位：百万円)

	第36期中間会計期間	
	(自 2021年4月1日	
	至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	2	971
営業外費用	3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
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	-	-	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	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	791	65	726	60,824
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	203	13	190	190
当中間期変動額合計	203	13	190	1,114
当中間期末残高	995	78	916	61,938

重要な会計方針

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 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あります。)</p> <p>市場価格のない株式等 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p>

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) 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。

(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。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. 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、ヘッジ対象は子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。

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。

(会計方針の変更)

第36期中間会計期間

(自 2021年4月1日

至 2021年9月30日)

1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取る見込まれる金額で収益を認識することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

(追加情報)

第36期中間会計期間

(自 2021年4月1日

至 2021年9月30日)

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当中間会計期間より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、重要な会計方針 6. 引当金の計上基準(2) 退職給付引当金をご参照ください。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末 (2021年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 591百万円
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36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 90百万円
	無形固定資産 376百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 738百万円
	投資有価証券償還益 219百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,012百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（金融商品関係）

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない非上場株式及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	1,051	1,296	-	2,347
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	242	(103)	-	138
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(79)	-	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	-	58

(*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)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。

(*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額13,639百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。

(*4)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。

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル1の時価に分類しております。また、金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注2）市場価格のない非上場株式の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

（有価証券関係）

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間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

(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	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,595	1,611	16
小計	1,595	1,611	16
合計	6,629	5,195	1,434

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がないことから、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36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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	4,614	-	98	98
	英ポンド	260	-	1	1
	カナダドル	81	-	1	1
	スイスフラン	98	-	0	0
	香港ドル	177	-	3	3
	ユーロ	497	-	1	1
合計	5,729	-	103	103	

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(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	19,350	-	242	242
合計		19,350	-	242	242

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

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 (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		4,438	-	94
	英ポンド		3,125	-	17
	カナダドル		4	-	0
	スイスフラン		78	-	0
	香港ドル		120	-	2
	ユーロ		115	-	0
	人民元		16	-	0
	合計		7,900	-	79

(収益認識関係)

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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	5,205百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	3,454百万円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	20,646,304円65銭
1株当たり中間純利益	1,240,458円75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36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
中間純利益	3,721百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721百万円
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。

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12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

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、「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2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021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。

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2021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（2021年4月1日から2021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。

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、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、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、継続企業的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。

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。

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、継続企業的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。継続企業的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、企業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、監査等委員会に対して、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

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

以上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年3月11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 松崎雅則 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」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2021年7月13日から2022年1月12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、分散投資コア戦略ファンドAの2022年1月12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7月13日から2022年1月12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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年3月11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 松崎雅則 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」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2021年7月13日から2022年1月12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、分散投資コア戦略ファンドSの2022年1月12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7月13日から2022年1月12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。