

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月29日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	10資産分散投資ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	(1)当初自己設定額 50万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したこと等に伴い、2022年 6月13日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前> 及び <訂正後> に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新・訂正後> に記載している内容は、当該内容にて原届出書が更新されます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

##### (1) ファンドの目的及び基本的性格

###### <ファンドの特色>

「特色」の各マザーファンドが連動する投資成果を目指すインデックスに係る説明文（2、3、7を除く）を以下の内容に更新・訂正します。

###### <更新・訂正後>

- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※4 「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※5 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※6 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※8 「ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)」とは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行うインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスを表します。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。Bloomberg<sup>®</sup>及びブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
- ※9 「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※10 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>及びS&P<sup>®</sup>は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任を負いません。

##### (3) ファンドの仕組み

< 訂正前 >

（前略）

委託会社の概況（2022年 4月28日現在）

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

委託会社の概況（2023年 1月31日現在）

（後略）

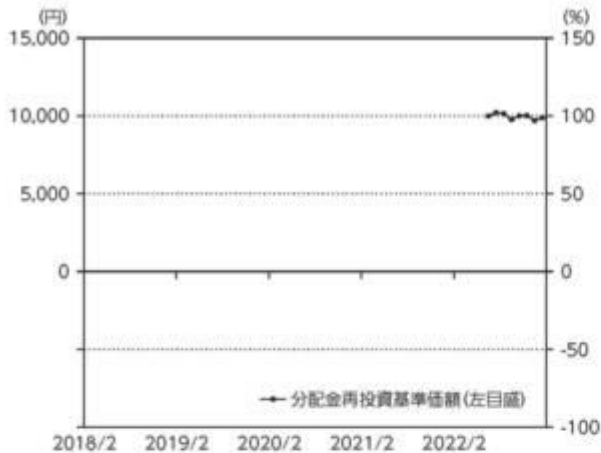
### 3 投資リスク

〔参考情報〕を以下の内容に更新・訂正します。

< 更新・訂正後 >

## 【参考情報】

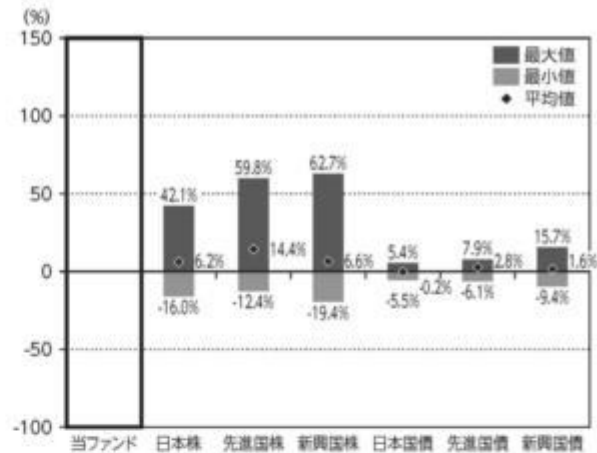
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2018年2月～2023年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ＆コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募定期付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリーリサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 アモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・レティバース・ファイ（円ベース）	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は特許を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 手数料等及び税金

## (5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

上記は、2022年 4月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更

される場合があります。

（後略）

<訂正後>

（前略）

上記は、2023年1月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

## 5 運用状況

<更新・訂正後>

以下は、2023年1月31日現在の状況について記載してあります。

### 10 資産分散投資ファンド

#### （1）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	674,557,758	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,812,518	1.00
合計(純資産総額)		681,370,276	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	125,156,247	1.3394	167,639,797	1.3316	166,658,058	24.46
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	192,733,459	0.8698	167,639,797	0.8636	166,444,615	24.43
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	24,096,535	4.2507	102,427,574	4.2764	103,046,422	15.12
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	41,416,593	1.9784	81,942,060	1.9790	81,963,437	12.03
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	18,570,696	1.8385	34,142,523	1.8392	34,155,224	5.01
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	11,329,157	3.0136	34,142,523	3.0038	34,030,521	4.99
日本	親投資信託受益証券	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	34,819,775	0.9609	33,459,671	0.9573	33,332,970	4.89

日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	5,693,848	3.5978	20,485,512	3.6180	20,600,342	3.02
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	10,048,094	2.0387	20,485,512	2.0352	20,449,880	3.00
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	5,650,185	2.4170	13,657,007	2.4559	13,876,289	2.04

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### (3) 運用実績

#### 純資産の推移

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2022年 6月末日	500,000		10,000	
7月末日	510,893		10,218	
8月末日	507,685		10,154	
9月末日	487,996		9,760	
10月末日	500,471		10,009	
11月末日	500,899		10,018	
12月末日	485,085		9,702	
2023年 1月末日	681,370,276		9,891	

#### 分配の推移

該当事項はありません。

## 収益率の推移

	期 間	収益率（％）
第1期中間計算期間	2022年 6月30日～2022年12月29日	3.0

(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。

## (4) 設定及び解約の実績

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期中間計算期間	2022年 6月30日～2022年12月29日	500,000		500,000

(注1)第1期中間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。

## (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	510,530,134,550	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,726,258,442	0.53
合計(純資産総額)		513,256,392,992	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,607,660,000	0.51

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄



## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,869,300	2,115.60	20,879,491,080	1,896.50	18,717,127,450	3.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,271,400	11,930.44	15,168,361,416	11,580.00	14,722,812,000	2.87
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,239,500	738.97	8,305,653,315	952.70	10,707,871,650	2.09
日本	株式	キーエンス	電気機器	179,800	51,535.93	9,266,160,214	59,280.00	10,658,544,000	2.08
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,309,900	3,982.16	9,198,391,384	3,892.00	8,990,130,800	1.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,293,600	3,999.49	5,173,740,264	5,652.00	7,311,427,200	1.42
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,595,300	3,751.86	5,985,342,258	4,090.00	6,524,777,000	1.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,042,300	5,370.07	5,597,223,961	6,144.00	6,403,891,200	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	1,134,800	5,831.45	6,617,529,460	5,625.00	6,383,250,000	1.24
日本	株式	第一三共	医薬品	1,570,400	3,554.69	5,582,285,176	4,064.00	6,382,105,600	1.24
日本	株式	日立製作所	電気機器	883,000	6,772.07	5,979,737,810	6,782.00	5,988,506,000	1.17
日本	株式	信越化学工業	化学	303,800	18,160.11	5,517,041,418	19,075.00	5,794,985,000	1.13
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	126,800	58,695.81	7,442,628,708	45,170.00	5,727,556,000	1.12
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,368,000	4,675.91	6,396,644,880	4,144.00	5,668,992,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,393,000	4,529.61	6,309,746,730	4,059.00	5,654,187,000	1.10
日本	株式	HOYA	精密機器	383,900	13,936.75	5,350,318,325	14,200.00	5,451,380,000	1.06
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,500	3,194.81	4,445,578,115	3,820.00	5,315,530,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,560,100	1,539.08	3,940,198,708	2,027.50	5,190,602,750	1.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,189,000	4,482.93	5,330,203,770	4,336.00	5,155,504,000	1.00
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,171,800	3,729.45	4,370,169,510	4,183.00	4,901,639,400	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	216,700	20,707.13	4,487,235,071	22,470.00	4,869,249,000	0.95
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,782,500	2,476.97	4,415,199,025	2,714.00	4,837,705,000	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,461,000	3,188.82	4,658,866,020	3,207.00	4,685,427,000	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,896,000	1,492.10	4,321,121,600	1,486.50	4,304,904,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	195,600	19,676.23	3,848,670,588	21,580.00	4,221,048,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	176,400	21,318.02	3,760,498,728	22,905.00	4,040,442,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,100	8,205.04	4,472,567,304	7,394.00	4,030,469,400	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	655,400	5,413.00	3,547,680,200	6,127.00	4,015,635,800	0.78
日本	株式	S M C	機械	58,900	66,087.57	3,892,557,873	65,350.00	3,849,115,000	0.75
日本	株式	富士通	電気機器	180,900	19,366.05	3,503,318,445	18,510.00	3,348,459,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
----	-------	----	---------

株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.30
		建設業	1.95
		食料品	3.40
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.18
		医薬品	5.34
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.84
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.57
		機械	5.21
		電気機器	17.29
		輸送用機器	7.37
		精密機器	2.60
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.23
		陸運業	2.95
		海運業	0.60
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.87
		卸売業	5.90
		小売業	4.52
		銀行業	6.54
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.40
		その他金融業	1.13
不動産業	1.89		
サービス業	5.30		
	小計	99.47	
合計		99.47	

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	132円		2,540,940,250	2,607,660,000	0.51

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	342,498,988,063	65.86
	イギリス	22,980,472,603	4.42
	カナダ	19,248,838,544	3.70
	フランス	17,597,563,251	3.38
	スイス	17,364,363,784	3.34
	ドイツ	13,254,851,926	2.55
	オーストラリア	11,831,469,908	2.28
	オランダ	10,165,452,040	1.95
	アイルランド	9,346,481,317	1.80
	スウェーデン	4,893,001,395	0.94
	デンマーク	4,466,113,474	0.86
	スペイン	3,991,411,356	0.77
	香港	3,477,952,960	0.67
	イタリア	2,802,909,329	0.54
	フィンランド	1,912,532,862	0.37
	シンガポール	1,873,286,895	0.36
	ジャージー	1,699,887,461	0.33
	ベルギー	1,278,007,292	0.25
	ノルウェー	1,108,670,589	0.21
	イスラエル	1,090,923,939	0.21
	ケイマン	1,037,793,544	0.20
	キュラソー	821,607,533	0.16
	バミューダ	786,930,054	0.15
	ニュージーランド	383,751,169	0.07
	ルクセンブルク	379,918,059	0.07
	オーストリア	303,919,684	0.06
	ポルトガル	288,663,239	0.06
リベリア	140,709,176	0.03	
マン島	120,337,586	0.02	
パナマ	117,110,008	0.02	

	小計	497,263,919,040	95.62
投資信託受益証券	オーストラリア	133,199,046	0.03
	香港	73,505,171	0.01
	小計	206,704,217	0.04
投資証券	アメリカ	9,956,662,420	1.91
	オーストラリア	689,031,036	0.13
	イギリス	260,966,314	0.05
	シンガポール	242,700,902	0.05
	フランス	238,670,273	0.05
	香港	182,536,447	0.04
	カナダ	58,278,167	0.01
	ベルギー	53,453,815	0.01
	小計	11,682,299,374	2.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,906,711,669	2.10
合計(純資産総額)		520,059,634,300	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	8,181,170,276	1.57
	買建	カナダ	532,521,202	0.10
	買建	ドイツ	1,696,567,907	0.33
	買建	イギリス	313,004,911	0.06
	買建	オーストラリア	341,382,055	0.07

(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		935,753,758	0.18

(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。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,265,668	19,566.58	24,764,801,643	18,657.20	23,613,833,666	4.54
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	557,986	35,656.14	19,895,630,449	31,666.37	17,669,393,195	3.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	722,070	15,083.63	10,891,441,552	13,118.75	9,472,661,950	1.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	472,221	14,660.91	6,923,191,423	12,647.76	5,972,538,725	1.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	436,836	14,735.28	6,436,901,560	12,779.53	5,582,561,606	1.07
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,006	24,464.42	4,795,175,007	25,000.66	4,900,279,638	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	327,418	12,716.91	4,163,745,533	14,816.17	4,851,081,797	0.93
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,518	66,239.61	4,869,804,310	63,381.02	4,659,645,924	0.90
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	209,202	33,024.56	6,908,805,340	21,744.13	4,548,915,526	0.87
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	206,738	23,558.96	4,870,533,905	21,136.13	4,369,643,311	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	230,844	17,105.92	3,948,799,389	18,152.29	4,190,347,487	0.81
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	102,259	41,565.13	4,250,408,895	40,097.34	4,100,314,413	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	128,824	27,769.23	3,577,343,904	29,890.67	3,850,636,574	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,873	19,378.70	3,640,736,215	18,397.57	3,456,407,552	0.66
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	179,617	25,412.94	4,564,597,229	19,186.91	3,446,296,686	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	215,571	16,439.13	3,543,800,211	15,683.05	3,380,810,944	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	146,184	23,197.56	3,391,112,988	22,727.87	3,322,451,533	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	80,384	40,251.29	3,235,560,475	40,998.89	3,295,654,999	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	67,952	46,659.98	3,170,639,376	48,420.02	3,290,237,634	0.63
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,340	42,153.55	2,670,006,003	44,425.03	2,813,881,717	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,300	76,593.86	2,473,981,975	85,417.30	2,758,978,919	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	198,784	12,140.23	2,413,284,176	13,841.56	2,751,481,120	0.53
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	138,845	19,537.88	2,712,737,295	19,002.95	2,638,465,356	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	568,705	4,827.39	2,745,360,830	4,605.59	2,619,222,630	0.50

アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	323,561	8,427.05	2,726,667,087	7,911.70	2,559,917,823	0.49
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	440,027	7,003.62	3,081,786,122	5,681.96	2,500,219,553	0.48
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	21,799	84,623.15	1,844,700,099	113,078.12	2,464,990,112	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	108,690	22,408.22	2,435,549,703	22,112.05	2,403,359,323	0.46
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	31,635	75,929.62	2,402,033,716	75,861.78	2,399,887,458	0.46
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	130,030	14,116.07	1,835,513,024	18,297.34	2,379,203,770	0.46

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.66
		素材	4.53
		資本財	6.55
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.74
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.96
		メディア・娯楽	5.00
		小売	4.49
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.13
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	4.73
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.83
		銀行	6.18
		各種金融	4.83
		保険	3.40
		不動産	0.41
		ソフトウェア・サービス	10.21
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.97		
電気通信サービス	1.45		
公益事業	3.06		
半導体・半導体製造装置	4.52		

			小計	95.62
投資信託受益証券				0.04
投資証券				2.25
合計				97.90

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	311	アメリカドル	61,021,009.5	7,961,411,109	62,705,375	8,181,170,276	1.57
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	22	カナダドル	5,318,099	518,142,385	5,465,680	532,521,202	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	4,177,846	589,326,956	4,292,860	605,550,831	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	185	ユーロ	7,383,492.5	1,045,207,198	7,707,100	1,091,017,076	0.21
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	20	オーストラリアドル	3,574,115	328,568,392	3,713,500	341,382,055	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	25	イギリスポンド	1,903,098.75	306,912,735	1,940,875	313,004,911	0.06

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,000,000.00	650,945,000	652,228,060	0.13
	カナダドル	買建	880,000.00	86,049,040	85,727,048	0.02
	ユーロ	買建	600,000.00	84,911,400	84,923,160	0.02
	イギリスポンド	買建	700,000.00	112,891,800	112,875,490	0.02

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

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

#### 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	24,834,382,817	20.50
	台湾	18,026,121,978	14.88
	インド	16,448,366,645	13.58
	中国	15,832,528,032	13.07
	韓国	15,272,967,313	12.61
	ブラジル	6,237,953,288	5.15
	サウジアラビア	4,897,262,415	4.04
	南アフリカ	4,432,934,733	3.66
	メキシコ	2,942,989,302	2.43
	タイ	2,752,571,714	2.27
	インドネシア	2,319,802,656	1.91
	マレーシア	1,922,583,642	1.59
	アラブ首長国連邦	1,508,526,283	1.25
	香港	1,416,686,404	1.17
	カタール	1,192,098,358	0.98
	クウェート	1,097,297,126	0.91
	フィリピン	949,197,158	0.78
	ポーランド	829,537,595	0.68
	トルコ	761,900,930	0.63
	チリ	734,977,966	0.61
	バミューダ	684,321,448	0.56
	アメリカ	602,577,317	0.50
	ギリシャ	437,971,207	0.36
	チェコ	223,848,422	0.18
	ハンガリー	205,954,574	0.17
	ルクセンブルク	126,528,536	0.10
	コロンビア	122,452,390	0.10
	エジプト	90,638,553	0.07
	オランダ	28,122,883	0.02
	シンガポール	26,134,006	0.02
ペルー	17,825,477	0.01	
ロシア	142	0.00	



	小計	126,977,061,310	104.80
投資信託受益証券	ブラジル	232,056,474	0.19
	メキシコ	94,639,229	0.08
	小計	326,695,703	0.27
投資証券	メキシコ	70,559,358	0.06
	南アフリカ	50,765,421	0.04
	小計	121,324,779	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,269,053,031	5.17
合計(純資産総額)		121,156,028,761	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	2,432,678,385	2.01

(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		8,890,773,092	7.34
	売建		270,907	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。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	3,484,389	1,860.82	6,483,847,385	2,354.23	8,203,055,903	6.77
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	887,900	4,015.12	3,565,026,202	6,446.88	5,724,184,752	4.72
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	674,568	6,588.98	4,444,720,318	6,716.13	4,530,486,382	3.74
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	2,106,688	1,174.43	2,474,170,177	1,814.85	3,823,322,717	3.16
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	651,350	2,371.15	1,544,453,834	2,888.77	1,881,603,596	1.55
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	428,842	4,159.46	1,783,752,508	3,785.59	1,623,421,273	1.34
ブラジル	株式	VALE SA	素材	539,487	1,910.18	1,030,522,217	2,418.50	1,304,751,594	1.08
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	307,661	2,979.73	916,749,069	3,952.70	1,216,094,711	1.00
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	13,765,620	75.13	1,034,246,316	85.58	1,178,075,525	0.97
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウ ェア・サー ビス	474,628	2,434.82	1,155,636,393	2,477.95	1,176,104,927	0.97
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	244,058	4,056.09	989,922,515	4,263.68	1,040,585,824	0.86
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	722,114	1,457.26	1,052,310,483	1,325.35	957,055,234	0.79
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	72,095	8,170.67	589,064,777	12,675.16	913,815,696	0.75
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	895,500	626.57	561,097,539	1,013.98	908,023,568	0.75
サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	280,025	2,956.94	828,017,216	2,850.93	798,334,193	0.66
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	31,120	16,864.86	524,834,482	25,194.62	784,056,671	0.65
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	77,344	9,482.05	733,380,238	9,623.27	744,302,195	0.61
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	118,503	6,002.65	711,333,027	6,079.53	720,442,544	0.59
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	1,689,248	443.24	748,742,690	425.32	718,474,946	0.59
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	316,200	1,437.41	454,509,552	2,266.06	716,529,753	0.59
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウ ェア・サー ビス	128,434	5,207.01	668,757,717	5,530.99	710,367,683	0.59
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	210,804	2,843.89	599,504,258	3,204.00	675,417,787	0.56
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・ 娯楽	282,030	1,662.50	468,876,327	2,342.65	660,698,990	0.55
ケイマン	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイ エンス	522,500	773.58	404,198,852	1,115.55	582,874,875	0.48
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	11,607,200	44.69	518,807,514	50.11	581,712,239	0.48
インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	7,642,300	77.09	589,176,405	75.69	578,445,687	0.48
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	7,779	77,658.73	604,107,317	72,890.69	567,016,755	0.47
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	8,099,515	61.25	496,147,727	69.93	566,399,084	0.47

メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,945,440	137.57	542,797,543	138.36	545,924,721	0.45
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	7,328	74,920.05	549,014,198	72,466.29	531,033,046	0.44

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.88
		素材	9.23
		資本財	3.87
		商業・専門サービス	0.07
		運輸	2.01
		自動車・自動車部品	3.43
		耐久消費財・アパレル	1.75
		消費者サービス	1.51
		メディア・娯楽	7.73
		小売	8.58
		食品・生活必需品小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	4.04
		家庭用品・パーソナル用品	0.89
		ヘルスケア機器・サービス	1.06
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.18
		銀行	16.06
		各種金融	3.26
		保険	2.92
		不動産	1.92
		ソフトウェア・サービス	2.67
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.49
電気通信サービス	3.14		
公益事業	2.86		
半導体・半導体製造装置	9.74		
	小計	104.80	
投資信託受益証券			0.27
投資証券			0.10
合計			105.17

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	356	アメリカドル	18,389,309	2,399,253,145	18,645,500	2,432,678,385	2.01

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	38,002,078.64	4,956,918,609	4,957,439,562	4.09
	メキシコペソ	買建	42,000,000.00	291,740,400	291,790,800	0.24
	トルコリラ	買建	20,000,000.00	138,320,000	138,616,000	0.11
	チェココルナ	買建	7,000,000.00	41,582,100	41,552,700	0.03
	ポーランドズロチ	買建	1,300,000.00	39,086,710	39,066,430	0.03
	香港ドル	買建	170,000,000.00	2,829,718,000	2,830,262,000	2.34
	マレーシアリングット	買建	5,100,000.00	156,528,180	156,570,000	0.13
	南アフリカランド	買建	58,000,000.00	435,290,000	435,475,600	0.36
	ブラジルリアル	売建	10,639.12	270,809	270,907	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。

## 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	518,547,762,410	84.37
地方債証券	日本	32,206,673,335	5.24
特殊債券	日本	35,474,246,337	5.77
社債券	日本	25,990,468,000	4.23
	フランス	793,291,000	0.13
	スペイン	395,452,000	0.06
	小計	27,179,211,000	4.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,238,918,810	0.20
合計(純資産総額)		614,646,811,892	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。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,220,000,000	100.36	7,245,992,000	100.21	7,235,306,400	0.100	2024/9/20	1.18
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	6,860,000,000	100.06	6,864,116,000	99.69	6,838,734,000	0.005	2026/12/20	1.11
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,390,000,000	100.33	6,411,087,000	99.41	6,352,682,400	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,250,000,000	100.12	6,257,500,000	99.88	6,242,562,500	0.005	2026/6/20	1.02
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,237,000,000	98.85	6,165,875,500	96.14	5,996,750,760	0.100	2031/12/20	0.98
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.14	5,908,496,000	0.100	2026/9/20	0.96
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	99.95	5,747,585,000	0.100	2027/3/20	0.94
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,740,000,000	99.94	5,736,839,300	99.74	5,725,477,800	0.100	2027/9/20	0.93
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	5,590,000,000	100.30	5,607,105,400	100.16	5,599,447,100	0.100	2024/3/20	0.91
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,360,000,000	100.46	5,385,127,000	100.23	5,372,649,600	0.100	2025/9/20	0.87
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,340,000,000	99.88	5,333,772,600	99.43	5,309,722,200	0.005	2027/6/20	0.86
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	5,260,000,000	101.27	5,326,946,800	100.87	5,306,130,200	0.600	2024/6/20	0.86
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,370,000,000	99.71	5,354,427,000	97.12	5,215,666,200	0.200	2032/3/20	0.85
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,110,000,000	100.45	5,132,995,000	100.22	5,121,548,600	0.100	2025/6/20	0.83
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,300,000,000	99.07	5,250,995,000	96.43	5,110,949,000	0.100	2031/6/20	0.83
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	101.21	5,080,742,000	100.82	5,061,214,200	0.300	2025/12/20	0.82
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,110,000,000	99.01	5,059,411,000	96.25	4,918,426,100	0.100	2031/9/20	0.80
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	4,930,000,000	100.41	4,950,213,000	99.58	4,909,688,400	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	4,900,000,000	99.82	4,891,180,000	98.90	4,846,443,000	0.200	2032/6/20	0.79
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	4,820,000,000	100.10	4,824,820,000	99.80	4,810,360,000	0.005	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,820,000,000	100.27	4,833,014,000	99.25	4,784,139,200	0.100	2028/6/20	0.78
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.23	4,771,138,400	0.100	2026/3/20	0.78
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	99.46	4,863,936,300	97.13	4,749,657,000	0.100	2030/9/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	98.70	4,728,065,300	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	101.37	4,733,979,000	100.94	4,713,898,000	0.400	2025/6/20	0.77

日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	4,590,000,000	100.43	4,609,737,000	100.23	4,600,740,600	0.100	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	101.27	4,618,231,200	100.87	4,599,763,200	0.400	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	4,530,000,000	100.11	4,535,235,400	99.93	4,527,146,100	0.005	2026/3/20	0.74
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,670,000,000	99.26	4,635,442,000	96.85	4,523,175,200	0.100	2030/12/20	0.74
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	4,430,000,000	101.47	4,495,121,000	101.02	4,475,451,800	0.400	2025/9/20	0.73

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.37
地方債証券	5.24
特殊債券	5.77
社債券	4.42
合計	99.80

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

#### 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	141,175,997,299	48.54
	フランス	24,338,618,456	8.37
	イタリア	21,861,421,305	7.52
	ドイツ	18,724,242,123	6.44
	スペイン	14,334,524,733	4.93
	イギリス	13,987,456,898	4.81
	中国	11,351,650,059	3.90
	カナダ	5,939,453,636	2.04
	ベルギー	5,295,246,859	1.82
	オーストラリア	4,723,253,003	1.62

	オランダ	4,547,390,923	1.56
	オーストリア	3,358,234,045	1.15
	メキシコ	2,361,876,425	0.81
	アイルランド	1,848,166,829	0.64
	マレーシア	1,659,781,665	0.57
	フィンランド	1,492,182,998	0.51
	シンガポール	1,344,662,394	0.46
	ポーランド	1,292,713,154	0.44
	イスラエル	982,008,977	0.34
	デンマーク	965,611,754	0.33
	ニュージーランド	660,026,113	0.23
	ノルウェー	588,404,283	0.20
	スウェーデン	586,306,947	0.20
	小計	283,419,230,878	97.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,451,476,853	2.56
合計(純資産総額)		290,870,707,731	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	2,325,077,329	0.80
	買建	ドイツ	2,035,149,372	0.70

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		4,725,001,370	1.62
	売建		261,876,709	0.09

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	13,800,000	12,093.15	1,668,855,439	12,219.33	1,686,267,669	2.750	2032/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	12,923.66	1,724,016,929	12,307.50	1,641,820,511	2.625	2029/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,562.83	1,633,168,427	12,415.03	1,613,954,672	0.250	2024/3/15	0.55
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,915.34	1,529,784,192	1,911.46	1,526,686,533	1.990	2025/4/9	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	11,439.60	1,530,619,765	10,901.38	1,458,604,663	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	12,779.26	1,493,896,545	12,332.21	1,441,636,285	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	12,480.28	1,438,976,592	12,249.90	1,412,414,603	2.250	2027/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,011.90	1,421,008,241	11,703.56	1,384,531,942	0.750	2026/8/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,495.52	1,372,565,112	11,395.22	1,360,590,395	0.500	2027/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	11,747.05	1,376,755,276	11,394.21	1,335,401,420	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,480.27	1,355,357,424	12,236.65	1,328,901,158	0.750	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	12,050,000	11,435.69	1,378,001,308	10,935.52	1,317,730,942	1.125	2031/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	11,945.57	1,302,067,377	11,932.14	1,300,603,699	0.250	2025/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,941.50	1,313,562,527	12,575.32	1,276,395,021	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,092.55	1,331,107,128	10,628.71	1,275,446,184	0.625	2030/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,032.86	1,318,427,891	10,576.22	1,263,858,813	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,901.31	1,326,996,099	11,302.98	1,260,282,601	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	12,397.16	1,252,113,526	12,368.14	1,249,182,975	2.875	2032/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,502.95	1,250,295,027	12,328.90	1,232,890,538	0.250	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	9,800,000	12,372.82	1,212,536,566	12,473.13	1,222,367,307	2.875	2029/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	11,030,000	11,474.83	1,265,674,466	10,949.79	1,207,762,570	1.375	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,233.67	1,252,554,308	10,738.80	1,197,376,452	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,810.08	1,205,809,495	11,375.35	1,161,423,554	1.125	2028/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	11,767.05	1,117,870,053	11,798.10	1,120,820,114	0.750	2026/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,479.76	1,124,426,494	12,284.82	1,106,862,349	0.375	2024/7/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,056.58	1,092,390,148	11,201.05	1,106,664,065	0.375	2027/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,472.11	1,122,490,491	12,295.26	1,106,574,167	0.250	2024/6/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,761.08	1,142,117,309	12,307.50	1,101,521,257	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	12,680.37	1,115,873,378	12,398.21	1,091,043,146	1.500	2024/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	11,888.42	1,129,400,508	11,438.03	1,086,613,791	1.250	2028/9/30	0.37

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.44
合計	97.44

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。



## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	63	アメリカドル	6,868,770.2	896,168,448	6,868,968.75	896,194,353	0.31
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	47	アメリカドル	5,368,225.42	700,392,370	5,371,218.75	700,782,910	0.24
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	43	アメリカドル	5,550,526.65	724,177,212	5,580,593.75	728,100,066	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,645,002.5	374,426,554	2,642,125	374,019,215	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	36	ユーロ	4,220,455.6	597,447,694	4,215,960	596,811,297	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	55	ユーロ	7,523,885.5	1,065,081,231	7,518,500	1,064,318,860	0.37

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	18,920,000.00	2,446,560,304	2,463,323,456	0.85
	カナダドル	買建	2,000,000.00	193,659,382	194,474,200	0.07
	ユーロ	買建	11,420,000.00	1,607,277,783	1,614,780,006	0.56
	イギリスポンド	買建	1,550,000.00	246,707,636	249,520,085	0.09
	オフショア人民元	買建	10,530,000.00	202,992,075	202,903,623	0.07
	オフショア人民元	売建	13,576,338.55	261,940,518	261,876,709	0.09

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

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

## 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	32,353,082,902	49.43
	フランス	5,575,115,572	8.52
	イタリア	5,012,017,964	7.66
	ドイツ	4,310,455,546	6.59

スペイン	3,280,479,834	5.01
イギリス	3,201,714,091	4.89
中国	2,620,496,904	4.00
カナダ	1,361,368,273	2.08
ベルギー	1,213,654,147	1.85
オーストラリア	1,082,699,659	1.65
オランダ	1,036,247,138	1.58
オーストリア	776,078,627	1.19
メキシコ	545,009,813	0.83
アイルランド	417,599,378	0.64
マレーシア	375,189,033	0.57
フィンランド	338,025,789	0.52
シンガポール	301,368,164	0.46
ポーランド	298,659,265	0.46
イスラエル	222,847,815	0.34
デンマーク	218,919,831	0.33
ニュージーランド	153,693,540	0.23
ノルウェー	137,209,883	0.21
スウェーデン	136,246,171	0.21
小計	64,968,179,339	99.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	484,961,785	0.74
合計(純資産総額)	65,453,141,124	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	333,995,045	0.51
	買建	ドイツ	246,653,436	0.38

(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	売建		64,115,421,011	97.96

(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。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.625% 05/31/27	4,500,000	12,401.27	558,057,392	12,459.63	560,683,358	2.625	2027/5/31	0.86
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	3,630,000	12,600.03	457,381,391	12,670.36	459,934,423	3.125	2028/11/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	3,580,000	12,303.93	440,480,786	12,368.14	442,779,707	2.875	2032/5/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	3,700,000	11,740.26	434,389,671	11,823.33	437,463,362	1.125	2026/10/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	3,400,000	12,712.67	432,230,802	12,749.36	433,478,421	3.125	2025/8/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 4.25% 10/15/25	3,300,000	13,091.33	432,014,202	13,116.56	432,846,710	4.250	2025/10/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.625% 10/15/24	3,500,000	12,185.94	426,508,215	12,242.01	428,470,360	0.625	2024/10/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	3,750,000	10,808.13	405,305,055	10,901.38	408,801,755	1.250	2031/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	3,240,000	12,544.48	406,441,370	12,575.32	407,440,381	2.250	2024/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	3,410,000	11,211.24	382,303,501	11,302.98	385,431,718	1.625	2031/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	3,000,000	12,180.59	365,417,930	12,236.65	367,099,768	0.750	2024/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	3,160,000	11,483.39	362,875,395	11,568.50	365,564,913	1.500	2028/11/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.25% 10/31/24	2,800,000	12,535.76	351,001,492	12,575.06	352,101,833	2.250	2024/10/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	10,862.64	346,518,434	10,935.52	348,843,295	1.125	2031/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	3,160,000	10,861.62	343,227,429	10,949.79	346,013,573	1.375	2031/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	2,650,000	12,597.23	333,826,733	12,631.12	334,724,862	2.375	2024/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/30/26	2,500,000	11,651.58	291,289,566	11,734.65	293,366,381	0.875	2026/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	2,250,000	12,754.20	286,969,655	12,779.06	287,528,851	2.750	2024/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	2,630,000	10,644.51	279,950,804	10,738.80	282,430,499	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	2,180,000	12,460.90	271,647,715	12,529.45	273,142,053	2.875	2028/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	2,200,000	12,353.62	271,779,713	12,398.21	272,760,786	1.500	2024/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	2,200,000	12,262.65	269,778,322	12,328.90	271,235,917	0.250	2024/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	2,320,000	11,469.63	266,095,602	11,561.88	268,235,721	1.250	2028/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	2,330,000	11,349.36	264,440,111	11,438.03	266,506,329	1.250	2028/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/24	2,100,000	12,658.39	265,826,252	12,685.40	266,393,493	2.500	2024/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.125% 02/15/24	2,100,000	12,370.69	259,784,625	12,437.07	261,178,534	0.125	2024/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	2,200,000	11,749.43	258,487,572	11,834.54	260,360,019	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	2,260,000	11,312.15	255,654,741	11,394.21	257,509,148	1.875	2032/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	2,000,000	12,676.48	253,529,711	12,713.68	254,273,797	3.000	2025/7/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	2,150,000	11,716.30	251,900,620	11,798.10	253,659,289	0.750	2026/4/30	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.26
合計	99.26

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	9	アメリカ ドル	985,180.56	128,536,507	981,281.25	128,027,764	0.20
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	7	アメリカ ドル	802,863.38	104,749,585	799,968.75	104,371,923	0.16
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	6	アメリカ ドル	780,485.85	101,829,989	778,687.5	101,595,358	0.16
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	3	ユーロ	318,081.75	45,027,653	317,055	44,882,306	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	4	ユーロ	472,499	66,886,958	468,440	66,312,366	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	7	ユーロ	971,175.75	137,479,639	956,900	135,458,764	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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	244,503,000.00	31,908,711,797	31,869,132,276	48.69
	カナダドル	売建	13,733,000.00	1,313,148,502	1,336,770,220	2.04
	メキシコペソ	売建	79,235,000.00	529,722,139	549,375,872	0.84
	ユーロ	売建	153,227,000.00	21,166,973,477	21,679,322,095	33.12
	イギリスポンド	売建	19,423,000.00	3,042,993,758	3,129,725,105	4.78
	スウェーデンクローナ	売建	10,765,000.00	133,278,915	134,912,362	0.21
	ノルウェークローネ	売建	10,550,000.00	136,812,930	137,783,000	0.21
	デンマーククローネ	売建	11,341,000.00	210,724,568	215,705,820	0.33
	ポーランドズロチ	売建	9,724,000.00	286,138,032	291,816,266	0.45
	オーストラリアドル	売建	11,463,000.00	1,010,538,740	1,053,048,495	1.61
	ニュージーランドドル	売建	1,794,000.00	146,635,826	151,171,410	0.23
	シンガポールドル	売建	3,067,000.00	298,009,799	304,261,735	0.46
	マレーシアリングgit	売建	12,112,000.00	359,535,129	371,674,887	0.57
	イスラエルシェケル	売建	5,957,000.00	220,299,986	224,048,131	0.34
	オフショア人民元	売建	138,295,000.00	2,617,616,206	2,666,673,337	4.07

(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	マレーシア	9,681,381,802	9.99
	タイ	9,677,334,057	9.99
	中国	9,624,012,881	9.93
	ブラジル	9,581,261,587	9.89
	メキシコ	9,570,592,963	9.88
	インドネシア	9,507,132,000	9.81
	南アフリカ	9,352,596,635	9.65
	ポーランド	6,708,047,590	6.92
	チェコ	5,275,429,427	5.44
	コロンビア	3,457,111,919	3.57
	ルーマニア	3,400,357,554	3.51
	ハンガリー	2,892,674,321	2.99
	チリ	2,141,470,913	2.21
	ペルー	2,126,513,211	2.19
	ウルグアイ	129,439,436	0.13
	ドミニカ共和国	73,234,195	0.08
	フィリピン	65,646,257	0.07
	小計	93,264,236,748	96.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,627,077,768	3.74
合計(純資産総額)		96,891,314,516	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		9,715,788,329	10.03
	売建		2,045,382,268	2.11

(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。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	104,100,000	2,216.27	2,307,138,522	2,269.60	2,362,662,823	0.000	2024/1/1	2.44
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	2.39	1,561,070,200	2.55	1,670,559,974	9.850	2027/6/28	1.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	205,400,000	794.06	1,631,014,728	809.26	1,662,236,137	10.500	2026/12/21	1.72
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	63,800,000	2,435.69	1,553,972,498	2,429.04	1,549,730,244	10.000	2025/1/1	1.60
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	1,770.89	1,354,735,530	1,786.18	1,366,434,391	0.000	2026/1/1	1.41
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000	657.51	1,200,623,340	687.72	1,255,791,785	8.000	2030/1/31	1.30
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	50,200,000	2,381.61	1,195,569,998	2,334.24	1,171,789,067	10.000	2027/1/1	1.21
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	617.39	1,082,285,544	629.69	1,103,854,211	5.750	2026/3/5	1.14
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	51,250,000	2,117.13	1,085,032,583	2,137.36	1,095,401,002	0.000	2024/7/1	1.13
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000	641.32	1,061,390,625	659.75	1,091,892,042	8.250	2032/3/31	1.13
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000	620.13	980,434,431	656.95	1,038,640,584	7.750	2031/5/29	1.07
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	635.54	959,680,186	648.45	979,160,934	8.875	2035/2/28	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	155,300,000	614.76	954,735,073	620.47	963,599,539	9.000	2040/1/31	0.99
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000	586.09	927,202,954	595.54	942,149,026	8.750	2048/2/28	0.97
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	645.96	897,885,419	660.40	917,959,047	7.500	2027/6/3	0.95
マレーシア	国債証券	MGS 3.757% 05/22/40	30,350,000	2,760.05	837,677,518	2,923.99	887,431,264	3.757	2040/5/22	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	669.82	860,056,565	671.93	862,770,809	8.000	2024/9/5	0.89
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	424.13	763,445,988	442.02	795,649,744	3.775	2032/6/25	0.82
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	197,000,000	395.25	778,649,986	395.66	779,455,906	1.450	2024/12/17	0.80
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000	2,668.66	728,546,289	2,826.21	771,557,118	2.632	2031/4/15	0.80
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	38,600,000,000	1.74	675,489,925	1.95	753,772,696	7.250	2034/10/18	0.78
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000	1,888.71	734,710,260	1,903.08	740,299,045	0.000	2025/7/1	0.76
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	694.01	723,513,652	696.78	726,402,649	10.000	2024/12/5	0.75
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000	3,069.86	706,068,830	3,112.95	715,979,910	3.955	2025/9/15	0.74
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000	2,306.07	731,026,965	2,244.89	711,632,671	10.000	2029/1/1	0.73
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	24,500,000	2,821.40	691,244,397	2,886.95	707,302,914	2.500	2024/4/25	0.73
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	159,500,000	420.56	670,803,727	436.14	695,645,302	3.650	2031/6/20	0.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000	595.19	676,739,603	610.45	694,082,048	8.500	2037/1/31	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	100,100,000	658.06	658,725,160	688.46	689,153,546	8.500	2029/5/31	0.71

メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	621.49	610,925,478	679.88	668,324,204	8.500	2038/11/18	0.69
------	------	------------------------	------------	--------	-------------	--------	-------------	-------	------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.26
合計	96.26

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	21,700,000.00	2,822,519,000	2,830,804,060	2.92
	メキシコペソ	買建	99,200,000.00	687,555,200	689,182,080	0.71
	ブラジルリアル	買建	29,998,738.70	763,165,940	763,866,881	0.79
	チェココルナ	買建	61,800,000.00	367,586,400	366,850,980	0.38
	ハンガリーフォリント	買建	289,500,000.00	104,856,900	105,063,024	0.11
	ポーランドズロチ	買建	14,400,000.00	432,619,200	432,735,840	0.45
	ルーマニアレイ	買建	16,300,000.00	469,486,129	469,638,860	0.48
	マレーシアリングット	買建	24,100,000.00	740,583,360	739,804,930	0.76
	タイバーツ	買建	147,428,501.88	586,782,574	586,765,436	0.61
	インドネシアルピア	買建	79,344,524,000.00	690,074,598	690,297,358	0.71
	南アフリカランド	買建	145,900,000.00	1,104,463,000	1,095,446,380	1.13
	オフショア人民元	買建	49,000,000.00	945,602,000	945,332,500	0.98
	アメリカドル	売建	15,679,218.48	2,040,023,112	2,045,382,268	2.11

(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。

#### 世界物価連動債マザーファンド 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	940,162,691	51.70
	イギリス	412,072,827	22.66
	フランス	153,553,137	8.44
	イタリア	88,671,673	4.88
	ドイツ	45,260,684	2.49
	スペイン	43,711,583	2.40
	カナダ	31,279,939	1.72
	オーストラリア	19,563,995	1.08
	スウェーデン	12,238,365	0.67
	ニュージーランド	9,587,565	0.53
	デンマーク	2,302,401	0.13
	小計	1,758,404,860	96.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		59,947,038	3.30
合計(純資産総額)		1,818,351,898	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		1,732,162,040	95.26

(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。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 07/15/31	270,000	11,799.70	35,410,625	11,876.32	35,620,607	0.125	2031/7/15	1.96
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 10/15/24	230,000	12,582.52	33,601,185	12,621.36	33,686,853	0.125	2024/10/15	1.85
アメリカ	国債証券	T11 0.875% 01/15/29	220,000	12,646.45	32,823,172	12,691.07	32,921,465	0.875	2029/1/15	1.81
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 01/15/32	260,000	11,710.98	32,719,895	11,781.26	32,899,537	0.125	2032/1/15	1.81
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 07/15/24	190,000	12,620.36	30,082,869	12,662.25	30,166,440	0.125	2024/7/15	1.66
イギリス	国債証券	UKT1 2.5% 07/17/24	50,000	60,034.17	30,017,088	59,960.99	29,980,496	2.500	2024/7/17	1.65
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 04/15/26	210,000	12,364.64	29,494,986	12,381.50	29,518,848	0.125	2026/4/15	1.62



アメリカ	国債証券	TII 0.375% 07/15/25	180,000	12,574.69	28,431,921	12,610.35	28,497,923	0.375	2025/7/15	1.57
アメリカ	国債証券	TII 0.25% 01/15/25	180,000	12,547.29	28,405,531	12,579.53	28,462,906	0.250	2025/1/15	1.57
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 10/15/26	210,000	12,367.25	28,311,849	12,388.61	28,346,100	0.125	2026/10/15	1.56
アメリカ	国債証券	TII 0.375% 07/15/27	180,000	12,440.31	27,269,447	12,466.50	27,311,820	0.375	2027/7/15	1.50
アメリカ	国債証券	TII 0.5% 01/15/28	180,000	12,450.75	27,064,640	12,474.87	27,103,358	0.500	2028/1/15	1.49
アメリカ	国債証券	TII 2.375% 01/15/25	130,000	13,084.83	26,881,814	13,105.04	26,909,243	2.375	2025/1/15	1.48
アメリカ	国債証券	TII 0.5% 04/15/24	170,000	12,676.46	25,452,289	12,715.19	25,517,275	0.500	2024/4/15	1.40
アメリカ	国債証券	TII 1.625% 10/15/27	190,000	13,190.51	25,201,078	13,195.53	25,198,629	1.625	2027/10/15	1.39
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/30	180,000	11,936.70	24,963,690	11,999.98	25,082,539	0.125	2030/7/15	1.38
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/26	160,000	12,406.39	24,668,148	12,416.56	24,675,989	0.125	2026/7/15	1.36
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 04/15/25	170,000	12,475.54	24,458,494	12,500.44	24,494,691	0.125	2025/4/15	1.35
アメリカ	国債証券	TII 0.625% 07/15/32	190,000	12,257.65	23,877,787	12,339.40	24,024,431	0.625	2032/7/15	1.32
アメリカ	国債証券	TII 3.625% 04/15/28	90,000	14,410.41	23,886,938	14,452.25	23,943,339	3.625	2028/4/15	1.32
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 04/15/27	180,000	12,283.75	23,326,392	12,301.27	23,348,836	0.125	2027/4/15	1.28
アメリカ	国債証券	TII 0.75% 07/15/28	150,000	12,607.31	22,441,694	12,652.38	22,510,483	0.750	2028/7/15	1.24
アメリカ	国債証券	TII 2.125% 02/15/41	110,000	14,321.69	21,428,954	14,513.08	21,704,555	2.125	2041/2/15	1.19
アメリカ	国債証券	TII 2% 01/15/26	110,000	13,118.75	21,657,468	13,110.37	21,633,131	2.000	2026/1/15	1.19
アメリカ	国債証券	TII 0.25% 07/15/29	150,000	12,166.32	21,253,199	12,219.08	21,333,600	0.250	2029/7/15	1.17
イギリス	国債証券	UKTI 0.125% 08/10/28	100,000	16,106.03	20,604,938	16,250.88	20,844,524	0.125	2028/8/10	1.15
アメリカ	国債証券	TII 0.625% 01/15/26	130,000	12,606.01	20,545,453	12,609.94	20,540,507	0.625	2026/1/15	1.13
イギリス	国債証券	UKTI 1.25% 11/22/55	50,000	20,776.41	19,307,255	21,379.35	19,920,210	1.250	2055/11/22	1.10
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 01/15/30	140,000	11,964.09	19,393,319	12,019.02	19,471,955	0.125	2030/1/15	1.07
フランス	国債証券	FRTRI 1.85% 07/25/27	100,000	15,138.42	19,502,774	15,112.66	19,462,991	1.850	2027/7/25	1.07

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.70
合計	96.70

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	7,098,000.00	909,260,898	925,171,065	50.88
	カナダドル	売建	320,000.00	30,596,032	31,148,800	1.71
	ユーロ	売建	2,353,000.00	326,934,055	332,914,205	18.31
	イギリスポンド	売建	2,483,000.00	388,301,968	400,098,205	22.00
	スウェーデンクローナ	売建	976,000.00	12,033,787	12,231,720	0.67
	デンマーククローネ	売建	122,000.00	2,278,923	2,320,440	0.13
	オーストラリアドル	売建	206,000.00	18,401,382	18,924,190	1.04
	ニュージーランドドル	売建	111,000.00	9,096,838	9,353,415	0.51

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

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

## J - R E I T 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	121,418,819,400	96.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,761,793,130	3.01
合計(純資産総額)		125,180,612,530	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,752,386,000	3.00

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	13,835	640,473.53	8,860,951,287	567,000	7,844,445,000	6.27
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,860	601,306.17	7,131,491,176	557,000	6,606,020,000	5.28
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	59,839	107,667.42	6,442,710,745	100,300	6,001,851,700	4.79
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,991	314,341.95	6,284,009,922	294,300	5,883,351,300	4.70
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	38,352	168,274.7	6,453,671,294	151,900	5,825,668,800	4.65
日本	投資証券	GLP投資法人	38,279	151,760.71	5,809,248,218	146,700	5,615,529,300	4.49
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	17,877	302,190.14	5,402,253,132	282,800	5,055,615,600	4.04
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,631	189,384.38	4,475,342,283	178,700	4,222,859,700	3.37
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,530	154,236.77	4,091,901,508	147,800	3,921,134,000	3.13
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,858	336,945.73	3,995,502,466	317,500	3,764,915,000	3.01
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,246	74,506.61	2,849,579,806	82,200	3,143,821,200	2.51
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	52,200	45,586.75	2,379,628,350	55,300	2,886,660,000	2.31
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,111	389,824.63	3,161,867,573	352,000	2,855,072,000	2.28
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,723	156,045.19	2,765,588,902	143,900	2,550,339,700	2.04
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	35,638	79,851.16	2,845,735,640	71,000	2,530,298,000	2.02
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	6,261	432,654.13	2,708,847,507	389,000	2,435,529,000	1.95
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,095	620,390.46	2,540,498,933	583,000	2,387,385,000	1.91
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,997	320,761.48	2,565,129,555	296,100	2,367,911,700	1.89
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,519	162,892.79	2,365,040,418	157,300	2,283,838,700	1.82
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,400	516,861.61	2,274,191,084	501,000	2,204,400,000	1.76
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	6,901	335,506.4	2,315,329,666	308,500	2,128,958,500	1.70
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,685	492,902.03	2,309,246,010	453,500	2,124,647,500	1.70
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,946	159,586.44	2,225,592,492	147,600	2,058,429,600	1.64
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,128	160,804.92	2,111,046,989	143,600	1,885,180,800	1.51
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,434	116,229.43	1,910,114,452	108,700	1,786,375,800	1.43
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	11,096	171,327.52	1,901,050,161	155,200	1,722,099,200	1.38
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,697	209,829.79	1,824,889,683	193,600	1,683,739,200	1.35
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,075	447,170.52	1,822,219,890	408,500	1,664,637,500	1.33
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,517	310,631.16	1,713,752,109	288,900	1,593,861,300	1.27
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,952	210,330.38	1,672,547,181	195,800	1,557,001,600	1.24

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.99
合計	96.99

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,068	円	4,027,843,600	3,752,386,000	3.00

(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	65,107,390,012	76.03
	オーストラリア	5,898,551,721	6.89
	イギリス	4,045,720,945	4.72
	シンガポール	3,288,822,380	3.84
	カナダ	1,623,100,241	1.90
	フランス	1,588,465,953	1.86
	香港	1,230,144,011	1.44
	ベルギー	925,771,040	1.08
	スペイン	358,997,966	0.42
	ニュージーランド	330,189,290	0.39
	韓国	224,453,282	0.26
	ガーンジー	176,315,353	0.21
	オランダ	158,842,873	0.19
	イスラエル	120,995,630	0.14
	ドイツ	45,660,745	0.05
	アイルランド	34,365,106	0.04
	イタリア	13,178,026	0.02
	小計	85,170,964,574	99.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		459,723,443	0.54
合計(純資産総額)		85,630,688,017	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		14,349,698	0.02

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	443,673	14,213.28	6,306,051,882	16,672.76	7,397,254,024	8.64
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	44,511	78,370.82	3,488,363,580	94,572.48	4,209,515,844	4.92
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	76,108	37,143.34	2,826,905,330	38,996.17	2,967,921,138	3.47
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	302,080	8,254.20	2,493,431,009	8,841.95	2,670,976,830	3.12
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	157,476	14,748.12	2,322,475,749	16,432.69	2,587,755,314	3.02
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	227,769	8,676.24	1,976,179,132	9,722.62	2,214,512,437	2.59
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	464,353	4,115.52	1,911,055,034	4,420.32	2,052,590,525	2.40
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	137,862	12,684.36	1,748,692,121	14,486.08	1,997,080,526	2.33
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	825,591	1,578.21	1,302,958,395	1,851.47	1,528,557,134	1.79
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,027	20,752.78	1,390,996,870	22,606.53	1,515,248,349	1.77
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,631	18,638.99	1,335,130,207	20,533.36	1,470,825,726	1.72
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	164,383	7,793.00	1,281,036,723	8,096.96	1,331,003,924	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	193,249	5,468.72	1,056,826,289	6,690.50	1,292,932,744	1.51
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	64,238	19,772.40	1,270,139,636	19,961.91	1,282,313,175	1.50
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	55,419	19,881.27	1,101,800,606	21,103.52	1,169,536,113	1.37
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	279,270	3,890.37	1,086,465,933	4,148.94	1,158,676,149	1.35
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	59,918	17,461.71	1,046,270,889	19,262.59	1,154,175,916	1.35
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	99,817	10,233.20	1,021,447,612	11,058.63	1,103,839,989	1.29
香港	投資証券	LINK REIT	1,012,000	832.90	842,899,984	1,070.59	1,083,442,140	1.27
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	140,829	6,430.81	905,645,128	7,105.39	1,000,645,841	1.17
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	258,007	3,123.12	805,788,137	3,540.95	913,591,383	1.07
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	30,952	27,065.60	837,734,648	28,643.38	886,570,015	1.04
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	124,874	6,539.54	816,619,238	6,865.33	857,301,393	1.00
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	295,175	2,712.97	800,803,238	2,884.69	851,488,873	0.99
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	341,290	2,194.69	749,026,663	2,417.60	825,105,810	0.96
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	51,702	14,303.33	739,511,251	15,627.69	807,983,170	0.94
イギリス	投資証券	SEGO PLC	584,939	1,276.24	746,525,869	1,354.02	792,020,812	0.92
アメリカ	投資証券	UDR INC	145,930	4,905.80	715,904,794	5,396.23	787,473,186	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	84,968	8,085.69	687,025,102	8,826.29	749,952,676	0.88
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	88,507	6,997.64	619,340,219	8,124.36	719,063,341	0.84

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.46
合計	99.46

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 （円）	時価 （円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	アメリカドル	買建	110,000.00	14,307,700	14,349,698	0.02

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

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

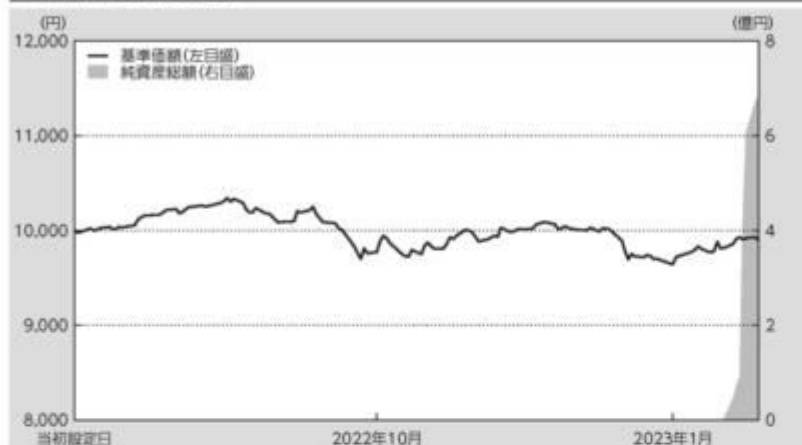
#### 参考情報

#### 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2022年6月30日

作成基準日：2023年1月31日

**基準価額・純資産の推移**

基準価額 9,891円

純資産総額 6.81億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来 分配金合計額	0円

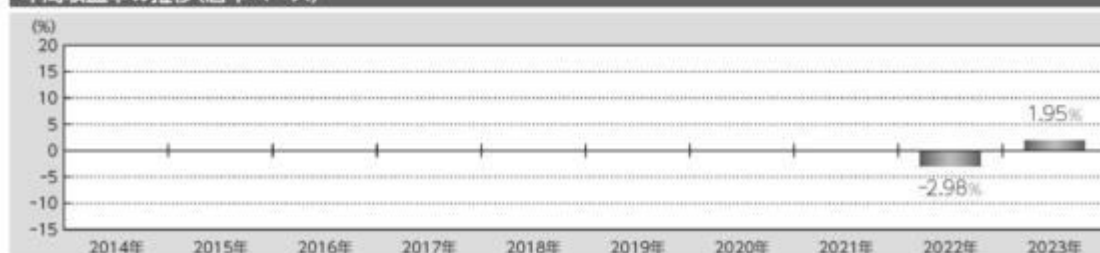
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券インデックスマザーファンド	24.5%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.3%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	24.4%	T 2.625% 05/31/27	アメリカ	国債	-	2.625%	2027/05/31	0.2%
外国株式インデックスマザーファンド	15.1%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア及び機器	-	-	0.7%
国内株式インデックスマザーファンド	12.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.4%
新興国債券インデックスマザーファンド	5.0%	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.1%
外国債券インデックスマザーファンド	5.0%	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.0%
世界地理動向マザーファンド(為替ヘッジあり)	4.9%	TII 0.125% 07/15/31	アメリカ	国債	-	0.125%	2031/07/15	0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	3.0%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.2%
J-REITインデックスマザーファンド	3.0%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.2%
グローバルREITインデックスマザーファンド	2.0%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.2%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2022年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第3【ファンドの経理状況】

<更新・訂正後>

(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1期中間計算期間(2022年6月30日から2022年12月29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 財務諸表

## 中間財務諸表

## 1 0 資産分散投資ファンド

## ( 1 ) 中間貸借対照表

(単位：円)

	第1期中間計算期間 (2022年12月29日現在)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	5,000
親投資信託受益証券	480,264
流動資産合計	485,264
資産合計	485,264
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	33
未払委託者報酬	357
流動負債合計	390
負債合計	390
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	500,000
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	15,126
元本等合計	484,874
純資産合計	484,874
負債純資産合計	485,264

## ( 2 ) 中間損益及び剰余金計算書



(単位：円)

第1期中間計算期間	
自 2022年 6月30日	
至 2022年12月29日	
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	14,736
<b>営業収益合計</b>	<b>14,736</b>
<b>営業費用</b>	
受託者報酬	33
委託者報酬	357
<b>営業費用合計</b>	<b>390</b>
営業利益又は営業損失（ ）	15,126
経常利益又は経常損失（ ）	15,126
中間純利益又は中間純損失（ ）	15,126
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,126

## ( 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月25日から翌年5月24日までとなっておりますが、第1期計算期間は設定日(2022年 6月30日)から2023年 5月24日までとなっております。第1期中間計算期間は設定日(2022年 6月30日)から2022年12月29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1期中間計算期間 (2022年12月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数		500,000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	15,126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)	0.9697円 (9,697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1期中間計算期間 (2022年12月29日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第1期中間計算期間 自 2022年 6月30日 至 2022年12月29日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 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12月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,301,957,824
株式	491,086,126,260
派生商品評価勘定	13,350
未収入金	835,862,844
未収配当金	873,496,845
前払金	68,260,700
差入委託証拠金	60,186,200
流動資産合計	496,225,904,023
資産合計	496,225,904,023
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	68,298,250
未払金	85,538,973
未払解約金	32,890,478
未払利息	4,785
流動負債合計	186,732,486
負債合計	186,732,486
純資産の部	
元本等	
元本	261,263,735,616
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	234,775,435,921
元本等合計	496,039,171,537
純資産合計	496,039,171,537
負債純資産合計	496,225,904,023

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2022年12月29日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2022年12月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	261,263,735,616口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.8986円
	(1万口当たり純資産額) (18,986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12月29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>

2022年12月29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	金融商品の時価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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	263,160,749,632円
期中追加設定元本額	10,416,557,217円
期中一部解約元本額	12,313,571,233円
期末元本額	261,263,735,616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）	383,618,572円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,081,775,710円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,529,462円
SMT TOPIXインデックス・オープン	12,021,286,006円
世界経済インデックスファンド	4,453,660,965円
日本株式インデックス・オープン	3,229,097,666円
DCマイセレクション25	6,171,069,736円
DCマイセレクション50	19,068,199,899円
DCマイセレクション75	19,445,793,710円
DC日本株式インデックス・オープン	6,255,013,687円
DCマイセレクションS25	3,258,561,122円
DCマイセレクションS50	9,585,263,032円
DCマイセレクションS75	7,464,942,621円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,688,467,213円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	160,044,275円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	694,614,852円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	519,589,698円

区分	2022年12月29日現在
D C 世界経済インデックスファンド	3,838,178,107円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,349,150,949円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,917,118円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	16,524,804円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,793,533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）	170,552,848円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	25,730,894円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	96,208,989円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	22,360,893円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	61,800,559円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	781,754,481円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	411,878,353円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,664,654,675円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	38,605,215円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	16,014,252円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	444,770,425円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	247,091,476円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	326,345,710円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	33,926,824円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	555,538,506円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,994,967,455円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,723,583,109円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,756,334,500円
分散投資コア戦略ファンドA	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドS	6,384,583,887円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	528,958,721円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	448,786,217円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,763,584,536円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,072,374円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,974,283円
SMT インデックスバランス・オープン	56,360,991円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	27,911,153,723円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	452,804,007円
SMT 世界経済インデックス・オープン	54,692,644円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	207,415,995円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,490,835円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,189,371円
グローバル経済コア	221,444,035円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	30,520,430円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	516,349,038円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	26,238,708円

区分	2022年12月29日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	239,237,780円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	21,287,433円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	18,630,287円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	7,482,895円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	9,923,628円
10資産分散投資ファンド	32,436円
FOFs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）	44,450,743,580円
FOFs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）	767,722,434円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	344,749,491円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,926,668円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	367,521,214円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	45,665,039,665円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	19,708,459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）	214,311,254円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2022年12月29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	5,070,135,700	-	5,001,875,000	68,260,700
	合計	5,070,135,700	-	5,001,875,000	68,260,700

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2022年12月29日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,860,835,010
コール・ローン	297,458,907
株式	493,141,379,663
投資信託受益証券	227,229,909

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
投資証券	11,354,031,020
派生商品評価勘定	2,883,186
未収入金	5,135,071
未収配当金	523,885,903
前払金	492,256,992
差入委託証拠金	2,923,016,732
流動資産合計	516,828,112,393
資産合計	516,828,112,393
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	494,317,156
未払解約金	22,564,686
未払利息	431
流動負債合計	516,882,273
負債合計	516,882,273
純資産の部	
元本等	
元本	125,849,612,429
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	390,461,617,691
元本等合計	516,311,230,120
純資産合計	516,311,230,120
負債純資産合計	516,828,112,393

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月29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12月29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12月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	125,849,612,429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 4.1026円 (1万口当たり純資産額) (41,026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12月29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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	125,790,379,423円
期中追加設定元本額	8,468,942,843円
期中一部解約元本額	8,409,709,837円
期末元本額	125,849,612,429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）	1,852,872,737円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,410,575円

区分	2022年12月29日現在
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,327,737,709円
世界経済インデックスファンド	12,018,438,146円
外国株式インデックス・オープン	902,420,665円
DCマイセレクション25	792,023,963円
DCマイセレクション50	3,652,347,952円
DCマイセレクション75	4,375,954,172円
DC外国株式インデックス・オープン	12,280,381,177円
DCマイセレクションS25	410,867,206円
DCマイセレクションS50	1,880,069,448円
DCマイセレクションS75	1,678,428,193円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	35,257,802円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	152,528,293円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	114,097,305円
DC世界経済インデックスファンド	10,115,138,742円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,200,792,940円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,096,466円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,459,609円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	26,196,546円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	11,383,065円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	41,440,667円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	10,140,485円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	28,035,739円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	224,736,331円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	158,047,129円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,164,123,792円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	88,544,485円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,022,313円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	146,173,399円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	46,949,641円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	966,793,660円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,036,865,069円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,173,994,515円
コア投資戦略ファンド（安定型）	491,761,850円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,181,204,042円
分散投資コア戦略ファンドA	1,541,300,012円
分散投資コア戦略ファンドS	8,319,598,587円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,396,414,621円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,152,873,746円
コア投資戦略ファンド（切替型）	546,672,331円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	585,277,545円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,211,959円
SMT インデックスバランス・オープン	151,767,191円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	311,714,378円

区分	2022年12月29日現在
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	12,982,398,818円
SMT 世界経済インデックス・オープン	220,632,452円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	848,433,449円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	157,969,142円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,514,166円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	419,831,281円
グローバル経済コア	640,118,044円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,560,725円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,768,850円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	456,682,822円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	88,545,549円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	56,373,866円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	49,649,160円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	19,822,442円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	26,218,394円
10資産分散投資ファンド	18,092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）	231,877,269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）	179,835,407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）	853,137,110円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,410,941,846円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,636,438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）	84,904,553円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	81,195,771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）	74,325,199円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	219,879,354円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	213,286,445円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	212,187,298円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	214,996,816円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	212,832,396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）	109,473,077円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2022年12月29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	13,335,847,462	-	12,843,590,470	492,256,992
合計		13,335,847,462	-	12,843,590,470	492,256,992

## (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12月29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	1,580,815,720	-	1,581,638,742	823,022
	アメリカドル	1,155,128,000	-	1,155,668,978	540,978
	カナダドル	69,005,300	-	69,015,170	9,870
	ユーロ	142,445,000	-	142,449,400	4,400
	イギリスポンド	80,675,500	-	80,683,450	7,950
	スイスフラン	57,585,600	-	57,830,640	245,040
	オーストラリアドル	75,976,320	-	75,991,104	14,784
合計		1,580,815,720	-	1,581,638,742	823,022

## (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12月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,750,011,156
コール・ローン	19,452,614
株式	109,284,775,572
投資信託受益証券	262,406,342
投資証券	118,802,327
派生商品評価勘定	150,187
未収入金	197,997
未収配当金	130,840,598
前払金	56,003,751

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	871,881,304
流動資産合計	112,494,521,848
資産合計	112,494,521,848
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,047,927
未払金	27,533
未払解約金	2,464,393
未払利息	28
流動負債合計	58,539,881
負債合計	58,539,881
純資産の部	
元本等	
元本	32,842,479,952
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	79,593,502,015
元本等合計	112,435,981,967
純資産合計	112,435,981,967
負債純資産合計	112,494,521,848

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月29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> <p>(1) 先物取引</p>

2022年12月29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12月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	32,842,479,952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 3.4235円 (1万口当たり純資産額) (34,235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12月29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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	30,921,081,675円
期中追加設定元本額	2,613,540,716円
期中一部解約元本額	692,142,439円
期末元本額	32,842,479,952円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,774,796,964円
世界経済インデックスファンド	6,797,624,844円
DC 新興国株式インデックス・オープン	5,656,813,926円



区分	2022年12月29日現在
D C世界経済インデックスファンド	5,725,338,306円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	127,569,953円
分散投資コア戦略ファンドA	276,729,621円
分散投資コア戦略ファンドS	1,486,419,585円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	853,423,946円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	648,007,181円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	343,663,400円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	16,523,041円
SMT インデックスバランス・オープン	80,751,821円
SMT 世界経済インデックス・オープン	190,724,106円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	760,769,592円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	127,955,173円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,311,762円
グローバル経済コア	358,471,389円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	85,796,342円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	34,970,240円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	30,791,114円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	12,292,779円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	16,284,581円
10資産分散投資ファンド	4,133円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,253,875,445円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	96,914,005円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	70,479,839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)	10,176,864円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2022年12月29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	3,362,206,567	-	3,306,202,816	56,003,751
合計		3,362,206,567	-	3,306,202,816	56,003,751

(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12月29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	570,752,131	-	570,883,536	131,405
	アメリカドル	312,692,131	-	312,780,036	87,905
	香港ドル	258,060,000	-	258,103,500	43,500
	売建	4,423,131	-	4,448,525	25,394
	ブラジルリアル	4,423,131	-	4,448,525	25,394
合計		575,175,262	-	575,332,061	106,011

## (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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年12月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,220,233,168
国債証券	517,524,465,600
地方債証券	32,351,798,145
特殊債券	35,873,171,468
社債券	27,535,561,000
未収利息	803,097,586
前払費用	23,125,020
流動資産合計	616,331,451,987
資産合計	616,331,451,987
負債の部	
流動負債	
未払金	1,391,401,300
未払解約金	140,632,247
未払利息	3,217
流動負債合計	1,532,036,764
負債合計	1,532,036,764
純資産の部	
元本等	
元本	461,026,216,867
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	153,773,198,356
元本等合計	614,799,415,223

2022年12月29日現在	
項目	金額（円）
純資産合計	614,799,415,223
負債純資産合計	616,331,451,987

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2022年12月29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12月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	461,026,216,867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 98,997,000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 1.3335円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,335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12月29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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	453,660,085,228円
期中追加設定元本額	20,218,489,804円
期中一部解約元本額	12,852,358,165円
期末元本額	461,026,216,867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）	4,204,102,267円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,992,721円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,972,267,532円
世界経済インデックスファンド	4,390,241,042円
D C マイセレクション 2 5	26,534,761,263円
D C マイセレクション 5 0	30,605,701,016円
D C マイセレクション 7 5	9,164,136,680円
D C 日本債券インデックス・オープン	431,628,100円

区分	2022年12月29日現在
D C日本債券インデックス・オープンS	91,838,514,972円
D C日本債券インデックス・オープンP	66,742,032,066円
D CマイセレクションS 2 5	13,871,729,300円
D CマイセレクションS 5 0	15,471,512,294円
D CマイセレクションS 7 5	3,549,373,045円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	681,729,899円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	2,371,904,047円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	902,198,980円
D C世界経済インデックスファンド	3,617,760,654円
国内バランス6 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,168,736円
マイセレクション5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	27,034,740円
マイセレクション7 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	7,397,367円
国内バランス6 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	979,351円
バランス3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	77,770,734円
バランス5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	109,307,196円
バランス2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	31,656,111円
バランス5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	25,503,308円
バランスA ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	2,557,664,835円
バランスB ( 3 7 . 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	725,542,970円
バランスC ( 5 0 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	3,022,592,251円
世界バランスV A 1 (適格機関投資家専用)	68,284,444円
世界バランスV A 2 (適格機関投資家専用)	51,965,336円
バランスD ( 3 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	938,041,472円
バランスE ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,048,580,822円
バランスF ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,368,073,759円
国内バランス2 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	134,416,893円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,571,025,390円
日本債券ファンド・シリーズ1	16,948,120,864円
分散投資コア戦略ファンドA	19,987,138,934円
分散投資コア戦略ファンドS	25,033,949,794円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	183,006,305円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,479,581,375円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	73,638,628円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,293,144円
S M T インデックスバランス・オープン	59,108,360円
S M T 世界経済インデックス・オープン	44,119,340円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	86,270,976円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	138,726,218円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	12,777,188円
グローバル経済コア	233,326,633円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	35,837,546円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5	22,016,218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	39,415,094円

区分	2022年12月29日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	22,117,576円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	5,826,315円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	4,501,626円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	83,365,420円
10資産分散投資ファンド	89,612円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	84,896,784,607円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	46,839,219円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,249,075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）	398,297,967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

貸借対照表

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	203,991,503
コール・ローン	4,212,965,434
国債証券	285,017,828,689
派生商品評価勘定	7,526,335
未収利息	1,853,300,577
前払金	89,215,131
前払費用	117,119,047
差入委託証拠金	418,464,090
流動資産合計	291,920,410,806
資産合計	291,920,410,806
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	168,729,549
未払金	276,198
未払解約金	24,296,582
未払利息	6,105
流動負債合計	193,308,434
負債合計	193,308,434
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	97,589,767,976
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	194,137,334,396
元本等合計	291,727,102,372
純資産合計	291,727,102,372
負債純資産合計	291,920,410,806

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年12月29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12月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,589,767,976口

		2022年12月29日現在	
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)	2.9893円 (29,893円)	

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

		2022年12月29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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	101,329,670,845円



区分	2022年12月29日現在
期中追加設定元本額	9,297,219,487円
期中一部解約元本額	13,037,122,356円
期末元本額	97,589,767,976円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,252,674,905円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	546,732,631円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,230,273,616円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,447,944円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,772,901,747円
世界経済インデックスファンド	15,905,464,884円
DCマイセレクション25	1,931,043,020円
DCマイセレクション50	1,689,028,826円
DCマイセレクション75	1,176,321,243円
DC外国債券インデックス・オープン	2,324,028,985円
DCマイセレクションS25	983,777,468円
DCマイセレクションS50	781,285,468円
DCマイセレクションS75	457,747,275円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	25,023,548円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	93,752,686円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	48,860,726円
DC世界経済インデックスファンド	13,547,814,593円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	467,715,322円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,488,997円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,003,475円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	20,687,289円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	38,189,673円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	58,757,179円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	68,608,385円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	63,161,148円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,096,083,787円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	406,353,791円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,635,417,845円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	61,650,980円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	35,832,927円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	401,358,362円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	150,477,369円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	196,853,436円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	696,884,441円
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）	3,262,748,799円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	677,802,405円
外国債券ファンド・シリーズ1	735,116,048円

区分	2022年12月29日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	191,540,029円
コア投資戦略ファンド（成長型）	956,949,109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）	605,241,396円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,309,286,655円
コア投資戦略ファンド（切替型）	439,121,979円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	254,448,474円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,309,992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）	1,326,073,555円
SMT インデックスバランス・オープン	191,029,650円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	10,125,547,189円
SMT 世界経済インデックス・オープン	295,261,159円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	368,296,353円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	596,588,711円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,060,866円
グローバル経済コア	855,426,588円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,367,783円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,893,782円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	102,830,030円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,279,245円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	20,776,998円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	24,059,470円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	10,824,440円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	15,667,643円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	92,541,067円
10資産分散投資ファンド	7,886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）	150,803,814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）	11,429,735,633円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,699,476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）	287,298,434円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	184,404,378円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,068,977,644円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	110,275,169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）	52,423,793円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年12月29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	4,490,955,731	-	4,401,740,600	89,215,131
	合計	4,490,955,731	-	4,401,740,600	89,215,131

## (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。

- 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。
- 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。
- 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12月29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	4,963,802,133	-	4,891,814,050	71,988,083
	アメリカドル	2,634,772,443	-	2,596,022,640	38,749,803
	カナダドル	197,894,090	-	194,884,668	3,009,422
	ユーロ	1,686,943,759	-	1,668,221,284	18,722,475
	イギリスポンド	254,620,145	-	246,549,402	8,070,743
	オフショア人民元	189,571,696	-	186,136,056	3,435,640
	合計	4,963,802,133	-	4,891,814,050	71,988,083

## (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12月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	52,048,005
コール・ローン	622,224,654
国債証券	62,612,643,037
派生商品評価勘定	831,526,111

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
未収入金	211,562
未収利息	379,320,672
前払金	14,844,150
前払費用	32,757,270
差入委託証拠金	75,191,623
流動資産合計	64,620,767,084
資産合計	64,620,767,084
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,002,803
未払金	18,584
未払利息	901
流動負債合計	17,022,288
負債合計	17,022,288
純資産の部	
元本等	
元本	76,175,123,745
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,571,378,949
元本等合計	64,603,744,796
純資産合計	64,603,744,796
負債純資産合計	64,620,767,084

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月29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>

2022年12月29日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年12月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	76,175,123,745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 11,571,378,949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 0.8481円 (1万口当たり純資産額) (8,481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12月29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

	2022年12月29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>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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	72,192,637,350円
期中追加設定元本額	5,918,922,182円
期中一部解約元本額	1,936,435,787円
期末元本額	76,175,123,745円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,935,394,012円
分散投資コア戦略ファンドS	26,477,156,346円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	329,036,702円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	146,427,849円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	28,477,561円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	5,654,282円
10資産分散投資ファンド	136,344円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	5,984,134,969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）	2,684,617,150円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,263,958,827円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,278,973,203円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,262,071,982円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,173,756,238円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,145,272,905円

区分	2022年12月29日現在
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）	3,460,055,375円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2022年12月29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	565,893,624	-	551,049,474	14,844,150
	合計	565,893,624	-	551,049,474	14,844,150

（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12月29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	65,298,792,280	-	64,469,424,822	829,367,458
	アメリカドル	32,835,703,974	-	32,264,396,825	571,307,149
	カナダドル	1,356,462,863	-	1,314,330,865	42,131,998
	メキシコペソ	568,923,279	-	556,401,799	12,521,480
	ユーロ	22,177,044,532	-	22,139,698,184	37,346,348
	イギリスポンド	3,154,419,825	-	3,081,261,279	73,158,546
	スウェーデンクローナ	134,253,635	-	131,753,837	2,499,798
	ノルウェークローネ	135,508,916	-	132,039,154	3,469,762
	デンマーククローネ	220,738,780	-	220,391,178	347,602
	ポーランドズロチ	280,044,053	-	280,979,883	935,830
	オーストラリアドル	1,058,401,782	-	1,030,404,275	27,997,507
	ニュージーランドドル	144,220,606	-	141,720,840	2,499,766
	シンガポールドル	305,788,742	-	302,234,476	3,554,266

マレーシアリン ギット	350,591,785	-	342,915,907	7,675,878
イスラエルシェケ ル	239,770,728	-	228,635,926	11,134,802
オフショア人民元	2,336,918,780	-	2,302,260,394	34,658,386
合計	65,298,792,280	-	64,469,424,822	829,367,458

## (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。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,212,766,845
コール・ローン	809,914,625
国債証券	82,927,602,741
未収利息	1,109,085,382
前払費用	59,316,532
流動資産合計	86,118,686,125
資産合計	86,118,686,125
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,609,449
未払利息	1,173
流動負債合計	1,610,622
負債合計	1,610,622
純資産の部	
元本等	
元本	47,765,852,217
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	38,351,223,286
元本等合計	86,117,075,503
純資産合計	86,117,075,503
負債純資産合計	86,118,686,125

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券



2022年12月29日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<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>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12月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,765,852,217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 1.8029円 (1万口当たり純資産額) (18,029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12月29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</p> <p>売買目的有価証券</p> <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</p>

	2022年12月29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>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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	46,806,253,157円
期中追加設定元本額	4,078,227,655円
期中一部解約元本額	3,118,628,595円
期末元本額	47,765,852,217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	4,963,628,414円
世界経済インデックスファンド	14,020,748,458円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,296,374,872円
DC 世界経済インデックスファンド	11,596,672,915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）	3,980,408円
コア投資戦略ファンド（安定型）	35,878,977円
コア投資戦略ファンド（成長型）	181,683,363円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	36,585,357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
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	506,300,766円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,689,668,758円
コア投資戦略ファンド（切替型）	81,053,946円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,722,493円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,277,270円
SMT インデックスバランス・オープン	163,575,483円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	1,942,180,440円

区分	2022年12月29日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	385,937,842円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	480,511,181円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	777,854,922円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	10,781,045円
グローバル経済コア	747,095,762円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	19,402,087円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	3,565,644円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	36,197,464円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	29,040,168円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,989,226円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,927,142円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	21,440,981円
10資産分散投資ファンド	13,984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）	30,540,868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）	232,401,185円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	143,766,248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）	9,996,616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）	258,840,573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）	259,681,915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）	258,343,972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）	250,720,521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）	246,972,169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。

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

貸借対照表

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	105,801
コール・ローン	33,426,501
国債証券	1,692,048,297
派生商品評価勘定	11,727,371
未収利息	3,623,931
前払費用	973,791
流動資産合計	1,741,905,692
資産合計	1,741,905,692
負債の部	

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	1,458,501
未払解約金	5,674
未払利息	48
流動負債合計	1,464,223
<b>負債合計</b>	1,464,223
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,859,449,740
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	119,008,271
元本等合計	1,740,441,469
<b>純資産合計</b>	1,740,441,469
<b>負債純資産合計</b>	1,741,905,692

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年12月29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> <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12月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		1,859,449,740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	119,008,271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)	0.9360円 (9,360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12月29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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	9,382,969,444円
期中追加設定元本額	1,090,868,151円
期中一部解約元本額	8,614,387,855円
期末元本額	1,859,449,740円
期末元本額の内訳	
10資産分散投資ファンド	24,160円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,335,391,235円
私募世界物価連動債パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	524,034,345円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2022年12月29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	1,778,426,954	-	1,768,158,084	10,268,870
	アメリカドル	937,656,666	-	936,801,178	855,488
	カナダドル	32,531,768	-	32,112,108	419,660
	ユーロ	342,994,122	-	344,442,135	1,448,013
	イギリスポンド	421,851,451	-	411,985,063	9,866,388
	スウェーデンクローナ	12,649,867	-	12,423,566	226,301
	デンマーククローネ	2,459,578	-	2,470,066	10,488
	オーストラリアドル	18,664,674	-	18,442,048	222,626
	ニュージーランドドル	9,618,828	-	9,481,920	136,908
合計	1,778,426,954	-	1,768,158,084	10,268,870	

#### （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### J-REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,191,815,869
投資証券	125,002,941,500
未収入金	13,926,000
未収配当金	930,594,434
前払金	156,547,600
差入委託証拠金	244,024,000
流動資産合計	129,539,849,403
資産合計	129,539,849,403
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	156,547,600
未払金	466,057,700
未払解約金	35,007,539
未払利息	4,625
流動負債合計	657,617,464
負債合計	657,617,464
純資産の部	
元本等	
元本	61,405,744,281
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	67,476,487,658
元本等合計	128,882,231,939
純資産合計	128,882,231,939
負債純資産合計	129,539,849,403

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月29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>

	2022年12月29日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年12月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	61,405,744,281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 2.0989円 (1万口当たり純資産額) (20,989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12月29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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	54,376,403,459円
期中追加設定元本額	10,310,138,345円
期中一部解約元本額	3,280,797,523円
期末元本額	61,405,744,281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）	1,738,659,714円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,348,462円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,639,249,094円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	32,194,660,906円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,164,268,574円
分散投資コア戦略ファンドA	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドS	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,021,696,978円
S M T インデックスバランス・オープン	25,624,199円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	243,554,016円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	8,862,329円
グローバル経済コア	245,569,785円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,259,506円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	607,009,296円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	117,061,800円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	221,709,369円
10資産分散投資ファンド	7,002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）	507,447,340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）	9,904,791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）	539,185,488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）	85,031,588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）	582,612,151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）	255,869,762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）	291,761,793円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（2022年12月29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	不動産投信指数先物 取引 買建	4,027,843,600	-	3,871,296,000	156,547,600
合計		4,027,843,600	-	3,871,296,000	156,547,600

## (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

項目	2022年12月29日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	326,332,065
コール・ローン	3,900,104
投資証券	78,703,315,272
派生商品評価勘定	10,025
未収配当金	260,358,098
流動資産合計	79,293,915,564
資産合計	79,293,915,564
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,505
未払金	243,521,986
未払解約金	2,615,074
未払利息	5
流動負債合計	246,139,570
負債合計	246,139,570
純資産の部	
元本等	
元本	34,579,932,591
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	44,467,843,403
元本等合計	79,047,775,994
純資産合計	79,047,775,994
負債純資産合計	79,293,915,564

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月29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12月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	34,579,932,591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 2,2859円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (22,859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12月29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12月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	39,267,097,419円
期中追加設定元本額	4,004,501,513円
期中一部解約元本額	8,691,666,341円
期末元本額	34,579,932,591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	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	95,811,278円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,698,240,419円

区分	2022年12月29日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,334,802円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	12,428,995,818円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	13,100,481,492円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドA	683,082,118円
分散投資コア戦略ファンドS	1,486,865,880円
コア投資戦略ファンド（切替型）	489,201,341円
S M T インデックスバランス・オープン	128,686,506円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	182,175,015円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,562,269円
グローバル経済コア	237,548,639円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	12,656,057円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	64,258,364円
M y S M T グローバルR E I Tインデックス（ノーロード）	79,478,476円
10資産分散投資ファンド	3,975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）	1,095,915,998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）	198,560,231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）	77,982,119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）	60,705,130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）	34,779,496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）	100,614,514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）	96,331,436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）	95,834,788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）	97,458,043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）	96,415,726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）	78,211,546円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2022年12月29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	86,402,045	-	86,409,565	7,520
	アメリカドル	51,869,610	-	51,877,853	8,243
	ユーロ	10,686,975	-	10,686,870	105
	香港ドル	12,915,750	-	12,913,350	2,400
	シンガポールドル	10,929,710	-	10,931,492	1,782

合計	86,402,045	-	86,409,565	7,520
----	------------	---	------------	-------

## (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。

## 2 ファンドの現況

## 10 資産分散投資ファンド

## 純資産額計算書

(2023年 1月31日現在)

資産総額	681,385,899円
負債総額	15,623円
純資産総額( - )	681,370,276円
発行済口数	688,899,449口
1口当たり純資産額( / )	0.9891円
(1万口当たり純資産額)	(9,891円)

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 1月31日現在)

資産総額	514,014,453,682円
負債総額	758,060,690円
純資産総額( - )	513,256,392,992円
発行済口数	259,357,316,097口
1口当たり純資産額( / )	1.9790円
(1万口当たり純資産額)	(19,790円)

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 1月31日現在)

資産総額	520,409,645,700円
負債総額	350,011,400円
純資産総額（ - ）	520,059,634,300円
発行済口数	121,611,575,664口
1口当たり純資産額（ / ）	4.2764円
（1万口当たり純資産額）	（42,764円）

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

資産総額	132,870,244,859円
負債総額	11,714,216,098円
純資産総額（ - ）	121,156,028,761円
発行済口数	33,487,076,309口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6180円
（1万口当たり純資産額）	（36,180円）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

資産総額	622,657,136,612円
負債総額	8,010,324,720円
純資産総額（ - ）	614,646,811,892円
発行済口数	461,596,968,679口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3316円
（1万口当たり純資産額）	（13,316円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

資産総額	290,956,156,328円
負債総額	85,448,597円
純資産総額（ - ）	290,870,707,731円
発行済口数	96,834,005,630口

1口当たり純資産額（ / ）	3.0038円
（1万口当たり純資産額）	（30,038円）

## 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

資産総額	66,250,421,571円
負債総額	797,280,447円
純資産総額（ - ）	65,453,141,124円
発行済口数	75,791,386,928口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8636円
（1万口当たり純資産額）	（8,636円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

資産総額	104,541,931,088円
負債総額	7,650,616,572円
純資産総額（ - ）	96,891,314,516円
発行済口数	52,682,346,123口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8392円
（1万口当たり純資産額）	（18,392円）

## 世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

## 純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

資産総額	1,826,772,325円
負債総額	8,420,427円
純資産総額（ - ）	1,818,351,898円
発行済口数	1,899,404,516口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9573円
（1万口当たり純資産額）	（9,573円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド



## 純資産額計算書

(2023年 1月31日現在)

資産総額	126,026,198,234円
負債総額	845,585,704円
純資産総額（ - ）	125,180,612,530円
発行済口数	61,508,217,895口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0352円
（1万口当たり純資産額）	（20,352円）

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 1月31日現在)

資産総額	85,636,364,154円
負債総額	5,676,137円
純資産総額（ - ）	85,630,688,017円
発行済口数	34,867,344,191口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4559円
（1万口当たり純資産額）	（24,559円）

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1 委託会社等の概況

<訂正前>

(1)資本金の額（2022年 4月28日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2022年 6月13日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)資本金の額（2023年 1月31日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2023年 3月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### 2 事業の内容及び営業の概況

<訂正前>

（前略）

2022年4月28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	<u>545</u>	<u>14,288,273</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>72</u>	<u>235,344</u>
単位型公社債投資信託	<u>51</u>	<u>236,285</u>
合計	<u>668</u>	<u>14,759,902</u>

<訂正後>

（前略）

2023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	<u>535</u>	<u>14,137,810</u>
追加型公社債投資信託	0	0

単位型株式投資信託	67	209,923
単位型公社債投資信託	52	181,913
合計	654	14,529,647

### 3 委託会社等の経理状況

<更新・訂正後>

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

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

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、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36期事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292

その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

(単位：百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
固定負債		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
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	500	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	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

## (2) 損益計算書

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972

退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

### （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

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おります。）

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。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。



## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づ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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

### (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、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事業年度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、退職給付に係る当事業年度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」という。）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。

## 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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

（会計方針の変更）

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「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）等を当事業年度の期首から適用し、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と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」等の適用

「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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

「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 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

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、退職給付に係る事業年度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、当事業年度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。

（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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	"	535	"
そ の 他	4	"	-	"
計	503	"	681	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
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

## 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

2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022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8．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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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、「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。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
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)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(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。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	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)	-	196	-	196
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	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

（\*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）投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

（\*3）金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

（\*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) 時価をもって貸借対照表計上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、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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(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(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

当事業年度(2022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	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

(有価証券関係)

#### 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)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

#### 2. その他有価証券

前事業年度(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
----	-------	-------	-------

当事業年度（2022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	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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) 上記取引の評価損益は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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

(注) 上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式				
	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

当事業年度（2022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	5,498	-	54	54
	英ポンド	277	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	139	-	2	2
	香港ドル	190	-	1	1
	ユーロ	676	-	18	18
	買建 ユーロ	21	-	0	0
合計	6,915	-	80	80	

(注) 上記取引の評価損益は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	17,197	-	1,333	1,333
合計		17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は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	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				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

### (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従来簡便法により、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したが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っております。

#### 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
	退職給付債務の期首残高	600
勤務費用	-	124
利息費用	-	2

転籍者受入	18	-
退職給付の支払額	69	81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
退職給付債務の期末残高	626	820

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表  
該当事項はありません。

(3) 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820
退職給付引当金	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

### 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92百万円、当事業年度100百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	107	百万円	112	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170	"	177	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	191	"	251	"
税務上の収益認識差額	71	"	74	"
税務上の費用認識差額	-		439	
繰延ヘッジ損益	28	"	224	"
その他	123	"	76	"
繰延税金資産 合計	693	"	1,357	"
繰延税金負債				

有価証券評価差額	349	〃	415	〃
その他	32	〃	34	〃
繰延税金負債 合計	382	〃	450	〃
繰延税金資産の純額	311	〃	907	〃

## 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。

### （収益認識関係）

#### 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事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降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]

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 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(*)	6,372百万円

(\*)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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)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 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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（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）

当事業年度（2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

### (重要な後発事象)

該当事項はありません。

### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金

21,051

金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747
固定資産		
有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098
固定資産合計		18,909
資産合計		76,657
負債の部		
流動負債		
未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619
固定負債		
退職給付引当金		871
資産除去債務		153
その他		20
固定負債合計		1,045
負債合計		12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022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		42,655
利益剰余金合計		45,255

株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間		
(自 2022年4月1日		
至 2022年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90
法人税等合計		1,492
中間純利益		3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	

	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本合計
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
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	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	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	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

## 注記事項

(重要な会計方針)

第37期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 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おります。)</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。 なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法によっております。</p>



### (3) 金銭の信託

時価法によっております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち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

従業員の退職給付に備えるため、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間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。

## 4. 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」という。）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。

## 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. ヘッジ会計の方法

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱いの適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日。以下、「実務対応報告第42号」）という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

(表示方法の変更)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

(中間貸借対照表関係)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額 777百万円

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37期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	95百万円
無形固定資産	608百万円
2 営業外収益の主要項目	
デリバティブ利益	2,027百万円
投資有価証券売却益	317百万円
3 営業外費用の主要項目	
為替差損	1,011百万円
金銭の信託運用損	904百万円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

## (2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

## (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

第37期中間会計期間末(2022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、

「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 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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順位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計上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）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
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	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(\*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)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

(\*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計上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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

##### 投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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）市場価格のない株式等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
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022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）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
	香港ドル	2	-	0	0
合計	8,141	-	0	0	

（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	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（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 関係会社株式				
	米ドル		3,036	-	2	
	英ポンド		3,333	-	19	
	スイスフラン		70	-	0	
	香港ドル		87	-	0	
	ユーロ		82	-	0	
	買建					
	米ドル		93	-	0	
	英ポンド		77	-	2	
	スイスフラン		53	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	ユーロ		60	-	1	
	合計		6,898	-	22	

（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。

（収益認識関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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4．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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1)営業収益

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

## (2)有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第37期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、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37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## 5 その他

< 訂正前 >

（前略）

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

2022年 6月13日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

< 訂正後 >

（前略）

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

2023年 3月29日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 訂正前 >

#### (1) 受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

（中略）

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容

（後略）

< 訂正後 >



## (1) 受託会社

( 中略 )

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

( 中略 )

## (2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （ <u>2022年3月末日</u> 現在）	事業の内容
----	--------------------------------------	-------

( 後略 )

## 3 資本関係

## &lt; 訂正前 &gt;

( 前略 )

資本金の額：51,000百万円（2021年3月末日現在）

( 後略 )

## &lt; 訂正後 &gt;

( 前略 )

資本金の額：51,000百万円（2022年3月末日現在）

( 後略 )

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年3月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

## 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10資産分散投資ファンドの2022年6月30日から2022年12月29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、10資産分散投資ファンドの2022年12月29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（2022年6月30日から2022年12月29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。

[次へ](#)

**独立監査人の監査報告書**

2022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  
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

**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2022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。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**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**

2022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2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022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。