

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月29日提出
【計算期間】	第1期中(自 2022年6月30日至 2022年12月29日)
【ファンド名】	10資産分散投資ファンド
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【ファンドの運用状況】

以下は、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）【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。

(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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。



## 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。

## 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。

#### 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。

#### J-REITインデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	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。

## 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。

## 2【設定及び解約の実績】

## 【10資産分散投資ファンド】

	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。

### 3【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

## 【10 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)
資産の部	
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
負債の部	
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
純資産の部	
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
営業収益	
有価証券売買等損益	14,736
営業収益合計	14,736
営業費用	
受託者報酬	33
委託者報酬	357
営業費用合計	390
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ぬ。	
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	

	第1期中間計算期間 (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	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	

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
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	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 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。

	2022年12月29日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年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 の額	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	(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	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
DC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
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	16,524,804円
マイセレクション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

区分	2022年12月29日現在
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
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	528,958,721円
DC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セレクション（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
DCターゲット・イヤー ファンド2055	26,238,708円
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

区分	2022年12月29日現在
SMTAM日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	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)		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	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
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	



	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <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>

	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) 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。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (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。

## (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ぬ。
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

	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>「(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> <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	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
S M T 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
D C マイセレクション 2 5	792,023,963円
D C マイセレクション 5 0	3,652,347,952円
D C マイセレクション 7 5	4,375,954,172円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,280,381,177円
D C マイセレクション S 2 5	410,867,206円
D C マイセレクション S 5 0	1,880,069,448円

区分	2022年12月29日現在
DCマイセレクションS75	1,678,428,193円
DCターゲット・イヤーフンド2025	35,257,802円
DCターゲット・イヤーフンド2035	152,528,293円
DCターゲット・イヤーフンド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
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・イヤーフンド2055	5,768,850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)	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
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	

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <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>

	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) 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。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (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。

## (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	(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



	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>「(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> <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
DC 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
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	853,423,946円
DC 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

区分	2022年12月29日現在
S M T インデックスバランス・オープン	80,751,821円
S M T 世界経済インデックス・オープン	190,724,106円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	760,769,592円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	127,955,173円
S M T 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
M y S M T 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
F O F s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)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,362,206,567	-	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
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	<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	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
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

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	3,617,760,654円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,168,736円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	27,034,740円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,397,367円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	979,351円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	77,770,734円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	109,307,196円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	31,656,111円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	25,503,308円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,557,664,835円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	725,542,970円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,022,592,251円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	68,284,444円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	51,965,336円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	938,041,472円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,048,580,822円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,368,073,759円
国内バランス25VA1（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NISA対応型）	35,837,546円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	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）2030	39,415,094円
D C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
D C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
D C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
M y S M T 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
F O F s用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	84,896,784,607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）	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

区分	2022年12月29日現在
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	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>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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)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>(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。</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
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 2.9893円 (1万口当たり純資産額) (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	<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	101,329,670,845円
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

区分	2022年12月29日現在
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	2,230,273,616円
S B I 資産設計オープン(分配型)	8,447,944円
S M T 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
D C マイセレクション 2 5	1,931,043,020円
D C マイセレクション 5 0	1,689,028,826円
D C マイセレクション 7 5	1,176,321,243円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,324,028,985円
D C マイセレクション S 2 5	983,777,468円
D C マイセレクション S 5 0	781,285,468円
D C マイセレクション S 7 5	457,747,275円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	25,023,548円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	93,752,686円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	48,860,726円
D C 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 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	1,488,997円
マイセレクション 7 5 V A 1(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 V A 1(適格機関投資家専用)	20,687,289円
バランス 3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	38,189,673円
バランス 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	58,757,179円
バランス 2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	68,608,385円
バランス 5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	63,161,148円
バランス A ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	1,096,083,787円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	406,353,791円
バランス C ( 5 0 ) V A 1(適格機関投資家専用)	1,635,417,845円
世界バランス V A 1(適格機関投資家専用)	61,650,980円
世界バランス V A 2(適格機関投資家専用)	35,832,927円
バランス D ( 3 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	401,358,362円
バランス E ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	150,477,369円
バランス F ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	196,853,436円
F O F s 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
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
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	605,241,396円
D C 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

区分	2022年12月29日現在
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 ファンド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・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	20,776,998円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	24,059,470円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,824,440円
DCターゲット・イヤーファンド(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)		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	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。

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				
	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
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

	2022年12月29日現在
項目	金額（円）
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>
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>

	2022年12月29日現在
	(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 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	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
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)	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	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
	マレーシアリングット	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

## (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)
<b>資産の部</b>	
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
<b>負債の部</b>	
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
<b>純資産の部</b>	
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	<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>

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	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	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	(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	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SMT Bセクション（SMA専用）	1,942,180,440円
SMT 世界経済インデックス・オープン	385,937,842円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	480,511,181円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	777,854,922円
SMT 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
DC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
DC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
DC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
DC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

区分	2022年12月29日現在
My SMT 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
FOFs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
FOFs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
SMTAM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
SMTAM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
SMTAM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
SMTAM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
SMTAM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	
流動負債	
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
負債合計	1,464,223
純資産の部	
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
純資産合計	1,740,441,469
負債純資産合計	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 0.9360円 (1万口当たり純資産額) (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	<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	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 - R E I T 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	

	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	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
<b>負債合計</b>	657,617,464
<b>純資産の部</b>	
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
<b>純資産合計</b>	128,882,231,939
<b>負債純資産合計</b>	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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)



	2022年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 (1万口当たり純資産額)	2.0989円 (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	(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	

区分	2022年12月29日現在
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)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	4,027,843,600	-	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

	2022年12月29日現在
項目	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>

	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>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</p> <p>売買目的有価証券</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>「(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> <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
SBI資産設計オープン（分配型）	5,334,802円
SMT グローバルREIT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（SMA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

区分	2022年12月29日現在
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
SMT 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
SMT 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
SBI資産設計オープン（つみたてNISA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
My SMT グローバルREIT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
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	198,560,231円
FOFs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
SMTAM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
SMTAM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
SMTAM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
SMTAM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
SMTAM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。

#### 4【委託会社等の概況】

##### （１）【資本金の額】

2023年 1月31日現在の資本金の額	20億円
発行可能株式総数	12,000株
発行済株式総数	3,000株

##### （２）【事業の内容及び営業の状況】

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

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	535	14,137,810
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	67	209,923
単体型公社債投資信託	52	181,913
合計	654	14,529,647

##### （３）【その他】

###### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

###### (2)訴訟事件その他の重要事項

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。



## 5【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>利益剰余金</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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	
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	
	利益剰余金	
	その他利益剰余金	

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	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ます。

### （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う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		当事業年度	
	（2021年3月31日）		（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せん。

## 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せん。

## (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	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		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せん。

#### 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	626
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				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
別途積立金		繰越利益剰余金			
当期首残高	500	2,100	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）

<p>第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）</p>
<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。</p> <p>    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> <p>（3）金銭の信託     時価法によっております。</p> <p>2．固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産     定額法によっております。</p> <p>（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。</p> <p>3．引当金の計上基準</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p>

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)				
その他有価証券	-	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	投資有価証券 関係会社株式				
	売建					
	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いません。	

（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

**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。

# 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。